

(上接 C53 版)

113	珠海盈米财富管理有限公司 注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 法定代表人:肖雯 客服电话:020-89629066 网址: www.yingmi.com	珠海盈米财富管理有限公司 注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 法定代表人:肖雯 客服电话:020-89629066 网址: www.yingmi.com
114	信达证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人:张志刚 客服电话:95321 网址: www.cindasc.com	信达证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人:张志刚 客服电话:95321 网址: www.cindasc.com
115	恒泰证券股份有限公司 注册地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 法定代表人:庞公民 客服电话:4001-996-188 网址: www.htht.com.cn	恒泰证券股份有限公司 注册地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 法定代表人:庞公民 客服电话:4001-996-188 网址: www.htht.com.cn
116	中山证券有限责任公司 注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强新新发展大厦 7 层 A 座 法定代表人:吕瑞荣 客服电话:95329 网址: www.zszq.com	中山证券有限责任公司 注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强新新发展大厦 7 层 A 座 法定代表人:吕瑞荣 客服电话:95329 网址: www.zszq.com
117	联讯证券股份有限公司 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 法定代表人:徐刚 客服电话:95564 网址: www.lxsec.com	联讯证券股份有限公司 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 法定代表人:徐刚 客服电话:95564 网址: www.lxsec.com
118	中衍期货有限公司 注册地址:北京市朝阳区东四环中路 82 号金长安大厦 B 座 7 层 法定代表人:马彦波 客服电话:400608117 网址: www.cdfo.com.cn	中衍期货有限公司 注册地址:北京市朝阳区东四环中路 82 号金长安大厦 B 座 7 层 法定代表人:马彦波 客服电话:400608117 网址: www.cdfo.com.cn

(二) 登记机构
名称: 前海开源基金管理有限公司
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址: 深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼
法定代表人: 王兆华
联系人: 任福丽
电话: (0755) 83180910
传真: (0755) 83181121
(三) 律师事务所和经办律师
名称: 广东信达律师事务所
注册地址: 深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 12 楼
负责人: 麻晨云
经办律师: 杨杨、胡云云
电话: (0755) 188265288
传真: (0755) 188265537
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址: 北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层
办公地址: 北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
法定代表人: 杨剑涛
联系人: 王红霞
经办会计师: 张富根、郭红霞
电话: (010) 88095588
传真: (010) 88091199

四、基金名称

前海开源沪深深优秀精选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的投资

开放式

七、基金的投资

(一) 投资目标

本基金主要投资于中国大陆 A 股市场 and 法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场, 通过跨境资产配置, 重点投资沪深深股票市场中的优势行业和优势个股, 在严格控制风险的前提下, 力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人可在履行适当程序后, 将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: 本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95% (其中投资于国内依法发行上市股票的资产占基金资产的比例为 0-95%、投资于港股通标的股票的比例占基金资产的比例为 0-5%)、持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%; 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约的投资保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金参与股指期货交易, 应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

(三) 投资策略

本基金的投资策略主要有以下七方面内容:

1、大类资产配置

本基金综合运用定性和定量的分析手段, 在对宏观经济因素进行充分研究的基础上, 判断宏观经济周期所处阶段, 本基金将依据经济周期理论, 结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估, 制定本基金在中国 A 股、港股、债券、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控, 根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中, 根据其参与市场基本要素的变动, 调整各类资产在基金投资组合中的比例。

2、行业配置策略

本基金根据宏观经济发展周期、行业发展阶段、市场风格, 决定不同行业的配置比例。

从宏观经济周期的角度, 周期性行业在经济复苏期往往表现较好, 之后成长性行业则表现更为突出, 防御性行业在经济衰退期是更好的选择。从行业发展阶段的角度, 处于成长期的行业具有更大的增长潜力, 而处于衰退期的行业则应尽量回避。

中国 A 股市场和港股市场的优势行业具有差异性和互补性, 本基金通过深入分析两市场的异同, 重点配置 A 股和港股的优势行业。

3、股票投资策略

本基金以企业基本面研究为核心, 结合股票估值, 自下而上精选具有较大成长空间和较高成长性的上市公司股票构建投资组合。主要考虑的因素包括: 公司的行业前景、成长空间、行业地位、核心竞争力、盈利能力、运营效率、治理结构等。

另外, 沪港两地股市互联互通机制的开通将为港股带来长期的价值重估机遇, 本基金还将从以下三方面精选港股投资机会:

(1) 高成长的新兴产业公司。该类公司相对同类 A 股公司具有较大的估值折价, 有机会从中选出具具有更高回报率的公司;

(2) 中小市值公司。境外研究机构对该类公司的研究覆盖不充分, 境内机构加入覆盖可能加速其中优质公司的价值发现;

(3) 被错杀的公司。港股投资者以境外机构为主, 港股市场是境外机构配置中国的工具, 属于边缘市场。当全球股市出现系统性风险时, 边缘市场股票往往被大规模抛售。许多优质公司因此被错杀, 出现难得的投资机会。

本基金将通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场, 但不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。

4、债券投资策略

在债券投资策略方面, 本基金将在综合分析研究的基础上实施积极主动的组合管理, 采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面, 结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析, 根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征, 定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整, 确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面, 本基金以中长期利率趋势分析为基础, 结合经济政策、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素, 重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略包括收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略和构建债券投资组合。

5、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究结果确定权证的合理价值, 发现市场对股票权证的非理性定价; 利用权证衍生工具的特性, 通过权证与证券的组合投资, 来达到改善组合风险收益特征的目的。

6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比

率的预估, 借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价, 在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下, 谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资, 以降低流动性风险。

7、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的, 参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素, 结合定性和定量方法, 确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模, 以及中国证监会的相关限制和要求, 确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考量股指期货的收益率、流动性及风险性特征, 运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险, 如大额申购赎回等; 利用金融衍生品的杠杆作用, 以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组, 负责股指期货投资管理的有关事项, 同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度, 并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时, 基金管理人期货投资管理从其最新规定, 以符合上述法律法规和监管要求的变化。

(四) 投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据, 并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

(1) 投资决策委员会制定整体投资策略。

(2) 研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果, 构建股票备选库、精选库, 对拟投资对象进行持续跟踪调研, 并提供个股、债券决策支持。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的投资战略, 设计和调整投资组合、设计和调整投资组合需要考量的基本因素包括: 每日申购和赎回净现金流量; 基金合同的投资限制和比例限制; 研究员的投资建议; 基金经理的独立判断; 绩效与风险评估小组的建议等。

(4) 投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析, 并形成决策纪要。

(5) 根据决策纪要, 基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案, 交由交易所执行。

(6) 交易所按有关交易规则执行, 并将有关信息反馈基金经理。

(7) 基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估, 并向投资决策委员会提交评估意见和改进方案。

(8) 风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责, 尤其重点关注基金投资组合的风险状况; 基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

(五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×35%+中证全债指数收益率×30%。

业绩比较基准选择理由:

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由中证指数公司编制发布, 选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的价值, 具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量 A 股投资部分的绩效。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制, 以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本, 以其发行量为权数的加权平均股价计算, 是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成, 中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价, 能更为真实地反映债券的实际价值和收益特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束, 设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×35%+中证全债指数收益率×30%, 该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称, 或者今后法律法规发生变化, 或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时, 基金管理人协商基金托管人后可以报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告, 但不需要召集基金份额持有人大会。

(六) 风险收益特征

本基金为混合型基金, 属于中高风险收益的投资品种, 其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金, 低于股票型基金。本基金为跨境证券投资基金, 主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场。除了需要承担与境内证券投资基金类似的的市场波动风险等一般投资风险之外, 本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。

(七) 投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95% (其中投资于国内依法发行上市股票的资产占基金资产的比例为 0-95%、投资于港股通标的股票的比例占基金资产的比例为 0-5%);

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(3) 本基金持有一家上市公司发行的证券(同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算), 其市值不超过基金资产净值的 10%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;

(5) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;

(9) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(13) 本基金参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(15) 本基金投资流通受限证券, 基金管理人应事先根据中国证监会相关规定, 与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例, 根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(16) 本基金管理人管理的全部开放公募基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金不符合该比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(18) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定对手开展回购保持一致;

(19) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%, 并且不得超过基金资产净值的 10%;

(20) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%;

(21) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%; 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(22) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

(23) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(24) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

(25) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的, 应当根据风险管理

的原则, 并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例, 应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前, 应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项外, 因证券、期货市场波动, 上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或活动:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额, 但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动;

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易时, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股, 不参与所投资上市公司的经营管理;

2、有利于基金资产的安全与增值;

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利, 保护基金份额持有人的利益;

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利, 保护基金份额持有人的利益。

(九) 基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

(十) 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏, 并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 06 月 30 日(未经审计)。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,734,781.66	0.09
-	其中: 股票	1,734,781.66	0.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	924,960,000.00	46.78
-	其中: 债券	924,960,000.00	46.78
-	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	300,000,000.00	15.17
-	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	735,989,996.43	37.22
8	其他资产	14,996,654.77	0.74
9	合计	1,977,281,432.86	100.00

注: 权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,514,536.41 元, 占资产净值比例 0.08%。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,459.26	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
-	合计	220,245.25	0.01

注: 以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1398	工商银行	107,000	529,542.68	0.03
2	0700	腾讯控股	1,500	498,019.17	0.03
3	2318	中国平安	8,000	486,974.56	0.02
4	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
5	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
6	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
7	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
8	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

注: ①所用证券代码采用当地市场代码。

②本基金本报告期末未持有上述股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,152,000.00	5.08
-	其中: 政策性金融债	100,152,000.00	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	824,808,000.00	41.80
9	其他	-	-
10	合计	924,960,000.00	46.88

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111815049	18 民生银行 CD049	1,500,000	146,670,000.00	7.43
2	111809136	18 浦发银行 CD163	1,000,000	99,030,000.00	5.02
3	111810048	18 兴业银行 CD048	1,000,000	97,750,000.00	4.95
4	111711493	17 平安银行 CD1493	1,000,000	96,650,000.00	4.90