

(上接B202页)

本基金以自上而下的个股精选策略为主,结合行业配置均衡策略、构造和优化组合,力争实现超额收益。

首先,在个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,通过“投资备选库流程”,强化投资纪律,保护组合质量,生成作为主要买入备选股票的“优质企业群”。

进而,在行业配置上,本基金采用行业配置均衡策略,通过滚动执行“行业配置策略”,力争实现超额收益。

(1)个股选择  
●个股选择:本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

●估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水平较低或合理的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。  
第二步,从公司内部和股票层面,深度分析投资价值,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

●从股票层面看,  
个股情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的行业,并具备较好的行业地位;个股选择上,本基金采用自上而下的个股精选策略,力争实现超额收益,无论经济环境行业环境如何变化,总是一些优质企业超越其竞争对手,获得高于市场平均水平的回报。因此,自上而下的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,“本基金执行”投资备选库流程,包括:  
第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值模型和特殊环境分析,建立投资备选库;

7.基金管理人将根据跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购和赎回导致的现金流变动情况,以组合风险和流动性的评估结果,按照《基金合同》的规定对投资组合进行动态调整。

8.基金管理人将根据基金申购赎回情况,在符合基金合同约定的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资组合做出调整。

9.基金业绩比较基准  
业绩比较基准:沪深300指数×95%+上证国债指数×5%  
十、基金的风险收益特征  
本基金为股票型基金,预期风险和预期收益均高于债券型基金、货币型基金。

十一、基金的投资组合报告  
基金管理人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。

本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年4月10日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2014年3月31日(“报告期末”),本报告所列数据未经审计。

#### 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	3,596,606,410.15	87.89
其中:股票	3,596,606,410.15	—	
2	固定收益投资	80,022,000.00	1.96
其中:债券	80,022,000.00	—	
3	衍生金融资产	—	—
4	金融资产公允价值变动	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
其中:买入返售金融资产-买入回购	—	—	
6	应收利息	407,070,253.15	9.95
7	其他资产	8,669,674.79	0.21
合计	4,092,374,338.09	100.00	

#### 2.报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,142,500.00	—
B	制造业	2,436,171,929.92	60.51
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
D	建筑业	31,502,540.00	0.78
E	交通运输、仓储和邮政业	—	—
F	金融业	—	—
G	信息技术业	—	—
H	房地产业	—	—
I	医药、生物和医疗保健	—	—
J	公用事业	1,004,180,281.83	24.78
K	消费品	4,579,500.00	0.11
L	租赁和商务服务业	25,661,085.01	0.63
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	教育、文化和体育业	—	—
Q	综合	—	—
R	其他	30,916,374.40	0.76
S	合计	5,332,552,500.00	1.32
合计	合计	3,596,606,410.15	87.75

#### 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明细

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	002262	天华能源	22,270,387	509,113,933.93	5.16
2	002458	广汇能源	9,759,295	193,897,596.30	4.78
3	300020	银江股份	5,914,758	186,788,752.40	4.63
4	600517	百润生物	10,368,538	186,218,906.56	4.59
5	002565	上海医药	8,834,683	169,803,064.90	4.19
6	002219	中航光电	6,698,609	165,038,941.74	4.07
7	300112	易世达	3,783,068	144,905,512.00	3.58
8	300214	昂利光	3,103,195	138,870,848.25	3.43
9	002358	森源电气	6,219,432	136,486,744.00	3.29
10	002551	顺荣医疗	3,475,245	123,872,185.15	3.13

#### 4.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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130002	13国债02	20,000,000.00	0.49
2	130003	13国债03	60,022,000.00	1.48
3	130004	13国债04	60,022,000.00	1.48
4	130005	13国债05	60,022,000.00	1.48
5	130006	13国债06	60,022,000.00	1.48
6	130007	13国债07	20,000,000.00	0.49
7	130008	13国债08	20,000,000.00	0.49
8	130009	13国债09	20,000,000.00	0.49
合计	合计	80,022,000.00	1.97	

#### 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股指期货投资明细

报告期末,本基金未持有股指期货投资。

#### 6.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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

#### 7.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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证投资。

#### 8.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资产支持证券投资

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

#### 9.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权益类投资

报告期末,本基金未持有权益类投资。

#### 10.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固定收益类投资

报告期末,本基金未持有固定收益类投资。

#### 11.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衍生品投资

报告期末,本基金未持有衍生品投资。

#### 12.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资产支持证券投资

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

#### 13.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权证投资

报告期末,本基金未持有权证投资。

#### 14.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股指期货

报告期末,本基金未持有股指期货。

#### 15.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贵金属

报告期末,本基金未持有贵金属。

#### 16.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权证

报告期末,本基金未持有权证。

#### 17.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资产支持

报告期末,本基金未持有资产支持。

#### 18.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权益类

报告期末,本基金未持有权益类。

#### 19.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固定收益

报告期末,本基金未持有固定收益。

#### 20.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衍生品

报告期末,本基金未持有衍生品。

#### 21.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资产支持

报告期末,本基金未持有资产支持。

#### 22.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权证