

(上接A31版)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

(二)注册登记机构  
名称：汇源基金资产管理股份有限公司  
住所：上海市黄浦区九江路288号6幢538室  
办公地址：上海市福建路99号震旦国际大厦22楼  
法定代表人：林利辉  
电话：(021) 29832888  
传真：(021) 29832998  
联系人：王小红  
(三)律师事务所和经办律师  
名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人：韩炯  
电话：(021) 31350966  
传真：(021) 31350900  
经办律师：吕红、黎明  
联系人：吕红  
(四)会计师事务所和经办注册会计师  
名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
首席合伙人：吴玉平  
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东楼9层经緯大厦大楼16层  
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东楼经緯大厦大楼16层  
邮政编码：100738  
公司电话：(010) 58153000  
公司传真：(010) 85128208  
盖章会计师：徐波、汤澎  
业务联系人：徐波、汤澎

**四、基金的名称**  
本基金名称：汇源富实业绩驱动型证券投资基金。  
**五、基金的类型**  
本基金为债券型证券投资基金。  
**六、基金的投资目标**  
在严格管理风险和保持资产流动性的基础上，努力实现资产的长期稳健增值。  
**七、基金的投资方向**  
本基金的投资范围主要为固定收益类金融工具，包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款及协议存款)，以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于二级市场权证。  
本基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的80%；其中对实业类资产的投资比例不低于债券类资产的380%，实业类指以生产制造为基础设施类资产所发行的债券，包括公司债、企业债(含城投债)、可转换债券、可分离债券、短期融资券(不含金融企业短期融资券)、中期票据和中小企业私募债券；基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

**八、基金的投资策略**  
(一)投资策略  
本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下确定大类资产配置及组合久期，并依据内部信用评级模型，自上而下确定久期配置和品种配置，并动态调整久期，从而预期出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与久期综合分析，制定出具体化的利率策略。

1. 同类资产配置策略  
不同类属的币种，由于受到不同的因素影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种种群的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场流动性及流动性等因素，合理配置并动态调整不同类属债券的投资比例。

2. 普通债券投资策略  
(1)利率策略  
本基金将通过宏观研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与久期综合分析，制定出具体化的利率策略。

具体而言，本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要宏观经济指标，分析宏观经济形势，建立经济前景的短期模型，进而预测财政政策、货币政策等宏观政策取向。同时，本基金将对金融市场的资金供求状况变化趋势与结构，影响资金面的因素进行详细分析与研判，建立资金面的市场模型。

在此基础上，本基金将结合历史与经验数据，区分当前利率曲线形态的期限利差、曲率与利率波动率所面临的不同压力，判断利率曲线形态变化的程度与概率，即对收益率曲线平移的方向、陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析，以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现向上平移的概率较大时，即调升利率将上升，本基金将降低低久期久期以规避损失；如出现向下平移的概率较大时，则调高组合久期；如收益率曲线处于陡峭期，则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上，利用策略获取超额收益。

(2)实业信用债策略  
实业信用债券收益率是与其具有相同期限的无风险收益率加上反映信用风险的信用利差之和。基准利率主要受宏观经济环境的影响，信用利差收益率主要受对应的信用利差曲线以及该信用资产本身信用变化的影响，因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本信用变化的策略。

1. 基于实业信用利差曲线变化的策略  
本基金将以下两方面分析信用利差的变化情况，并采取相应的投资策略：宏观经济环境对信用利差的影响：当宏观经济向好时，信用利差可能由于实业债发行主体盈利能力的改善而收窄；反之，信用利差可能扩大。本基金将根据宏观经济的变动情况，加大对信用利差收窄的债券的投资比例。

市场供求关系对信用利差的影响：信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给，而需求的变化，其他类属资产的收益率等也将影响市场对信用债券的需求。从而对信用利差产生影响。本基金将结合分析信用债券市场容量、流动性因素，在具有不同信用利差的品种间进行动态调整。

2. 基于本身信用变化的策略  
本基金将依据内部信用评级系统持续跟踪研究实业债发行主体的经营状况、财务状况等指标，对其信用风险进行评估并作出及时反应。

务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。

为了准确评估发行主体的信用风险，本基金设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”-“公司风险”(包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况、及企业财务状况) -“外部支持”(外部流动性支持能力、及债券担保情况) -“得到评级”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量的信息分析和研究，包括对定量分析无法充分体现、能够有效提高定量分析准确性的信息。

本基金内部的信用评级体系定位为定期评级，侧重于评级的准确性，从而为信用产品的及时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，发掘相对价值被低估的资产，以便及时有效地抓住信用债券本身信用变化带来的市场交易机会。

3. 可转换债券策略  
本基金将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、规模、期限、息票率、转股时点、提前偿还及赎回等因素的基础上，建立收益率曲线模型和信用利差曲线模型，并通过这些模型进行估值。重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善，以及价值尚未被市场充分发现的个券。

4. 中小企业私募债券策略  
基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等因素，本基金在一、二级市场市场资产可转换债券，以达到在严格控制风险的前提下，实现基金资产稳健增值的目的。

1. 行业投资策略  
本基金将根据宏观经济走势、经济周期，以及阶段性市场投资主题的变化，综合考虑宏观调控目标、产业结构调整等因素，精选成长前景明确或受益政策扶持的行业内公司发行的可转换债券进行投资布局。另外，由宏观经济所处的时期和市场的发展阶段不同，不同行业的可转换债券也将表现出不同的风险收益特征。在经济复苏的初期，持有资源类行业的可转换债券将获得良好的投资收益；而在经济衰退时期，持有防御类非周期行业的可转换债券，将获得更加稳定的收益。

2. 个券投资策略  
本基金将运用企业基本面分析和理论定价分析策略，在严格控制风险的前提下，精选具有投资价值可转换债券，力争实现较高的投资收益。

3. 条款转换策略  
本基金将深入分析公司基本面，包括经营状况和财务状况，预测其未来发展战略和策略实施，结合流动性、到期收益率、纯债溢价率等因素，充分发掘这些条款对可转换债券带来的投资机会。

4. 中小企业私募债券投资策略  
本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程，投资授权审批机制、集中交易管理等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地定价、到期和赎回时及时反应，实现投资收益最大化。

本基金依据内部信用评级系统持续跟踪研究实业主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，对中小企业私募债券进行分类，以便准确评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。

(二)投资策略依据  
1. 投资决策依据  
(1) 国家有关法律、法规和基金合同的相关规定；  
(2) 国内外宏观经济形势及对中国经济发展的影响；  
(3) 国家货币及财政政策及债券市场政策；  
(4) 金融行业的信息披露；  
(5) 信用债券市场的基本情况。

2. 投资决策流程  
本基金投资决策流程为：  
(1) 宏观分析判断宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向，提出策略报告。

(2) 债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告。  
(3) 信用分析员负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。  
(4) 数量分析师对衍生品市场和信用产品进行分析。  
(5) 在分析研究的基础上，基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议。

(6) 投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。  
(7) 如审议通过，基金经理在考虑资产配置的情况下，挑选合适的债券品种，灵活采取各种策略，构建投资组合。  
(8) 集中交易员执行交易指令。

(三) 投资限制  
(1) 组合限制  
基金的投资组合应遵循以下限制：  
(1) 本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；其中对实业类的投资比例不低于债券类资产的80%，实业类指以生产制造和基础设施为主要的企业所发行的债券，包括公司债、企业债(含城投债)、可转换债券、可分离债券、短期融资券(不含金融企业短期融资券)、中期票据和中小企业私募债券；  
(2) 保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；  
(3) 本基金持有一家上市公司股票，其市值不得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%；  
(8) 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%；  
(9) 本基金持有的同一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%；  
(10) 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%；  
(11) 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、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；  
(12) 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%；  
(13) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；  
(14) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；  
(15) 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。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权登记结算等业务等因素导致基金持有的同一因素导致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。

如果今后法律法规及中国证监会的规定或今后其他监管部门的规定与《基金合同》约定不一致，基金管理人有权在不损害基金份额持有人利益的前提下，对基金合同进行修改，并报中国证监会备案。

法律法規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。

1. 承销行为  
(1) 承销行为  
(2) 向他人贷款或提供担保；  
(3) 从事承担无限责任的投资或；  
(4) 买卖其他基金资产，但基金合同另有规定的除外；  
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承购承销的证券；  
(7) 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；  
(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规和监管部门取消上述禁止性规定的，则本基金不受上述相关限制。

**九、基金的业绩比较基准**  
本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。  
中债综合指数是中国市场债券指数，以2001年12月31日为基期，基点为100点，并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的编制具有广泛的代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成为债券市场国债、企业债、可转债等所有主要债券种类。选择中债综合指数作为本基金固定收益类资产投资比较基准的依据的主要理由为：第一，该指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网(www.chinabond.com.cn)公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；第二，该指数的样本覆盖面广，能较好地反映债券市场的整体状况。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称，或者有更权威、更能作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业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

**十、基金的风险收益特征**  
本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

**十一、基金的投资组合报告**  
基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

基金管理人承诺遵守《基金合同》所载投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等，并承诺不从事任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属投资  
明细：  
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
1.8 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权证投资明细：  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.9.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注：报告期末本基金无国债期货持仓。  
1.9.3 本期国债期货投资损益  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
1.10 投资组合报告附注  
1.10.1  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
1.10.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
1.7 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贵金属