

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十八日

1 重要提示
1.1 重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的投资在业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

2 基金简介
2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金存续期间, 基金管理人, 基金托管人, 基金注册登记机构, 基金销售机构

2.1.1 目标基金基本情况
基金名称: 上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金

2.1.2 基金投资目标
本基金投资于上证非周期行业100ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

2.1.3 基金投资策略
本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,按照标的指数成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重进行资产配置。

2.1.4 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证非周期行业100指数

2.1.5 基金风险收益特征
本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.1.6 基金管理人、基金托管人
基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 姓名, 职务
基金管理人: 姓名: 魏峻, 职务: 董事长
基金托管人: 姓名: 姜国华, 职务: 副董事长

2.4 信息披露方式
基金管理人网站: http://www.hftfund.com
基金年度报告全文披露日期: 2016年3月31日

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

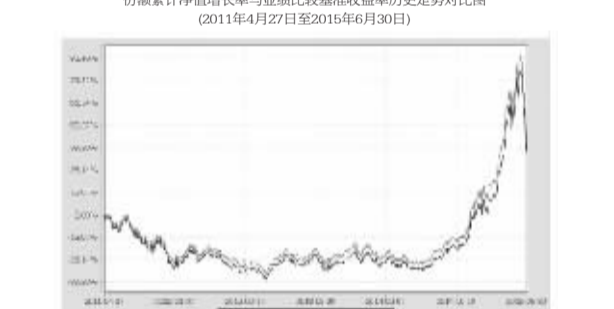
Table with 2 columns: 报告期(2015年1月1日至2015年6月30日), 本报告期末(2015年6月30日)
资产: 6,948,428.24
负债: 3,174,403.13
净资产: 3,774,025.11

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 期间, 基金份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-②, ③-④
过去一个月: -14.70%, 3.47%, -13.70%, 3.02%, -0.09%, -0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起三个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同(一)投资范围、(六)投资策略中规定的各项比例。

4 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准,由海通证券股份有限公司和中国工商银行股份有限公司(现更名为“法国巴黎投资管理有限公司”)于2003年4月1日共同发起设立。

4.1.2 基金基金经理(或基金小组)及基金经理助理的简介
姓名: 刘斌, 职务: 基金经理, 任职日期: 2011-04-27, 离任日期: 14年

注:1、对基金的前任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司作出决定之日;非前任基金经理,其任职日期和离任日期指公司做出决定之日。
2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 基金管理人内部控制制度的说明
本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况
公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务授权体系、交易控制制度、制度流程并建立了自上而下投资、债券的一级市场、二级市场交易策略等投资管理制度,建立了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节、同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议以及投资决策决策方面享有公平的机会。

4.4 关联交易情况的说明
本报告期内,本基金管理人未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.5.1 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明
对于2015年上半年市场走势,可总结为一句话:震荡加剧,震荡加剧,震荡加剧。

4.5.2 报告期内基金业绩表现的说明
截至2015年6月30日,本基金资产净值为3,774,025.11元,基金份额净值为1.151元,基金份额总额为41,180,797.47份。

4.5.3 报告期内基金投资组合的说明
截至2015年6月30日,本基金投资组合如下表所示:

Table with 2 columns: 资产, 期末余额
货币资金: 3,774,025.11
交易性金融资产: 3,174,403.13

4.5.4 报告期内基金资产组合的说明
截至2015年6月30日,本基金资产组合如下表所示:

Table with 2 columns: 资产, 期末余额
货币资金: 3,774,025.11
交易性金融资产: 3,174,403.13

4.5.5 报告期内基金资产组合的说明
截至2015年6月30日,本基金资产组合如下表所示:

Table with 2 columns: 资产, 期末余额
货币资金: 3,774,025.11
交易性金融资产: 3,174,403.13

4.5.6 报告期内基金资产组合的说明
截至2015年6月30日,本基金资产组合如下表所示:

Table with 2 columns: 资产, 期末余额
货币资金: 3,774,025.11
交易性金融资产: 3,174,403.13

4.5.7 报告期内基金资产组合的说明
截至2015年6月30日,本基金资产组合如下表所示:

Table with 2 columns: 资产, 期末余额
货币资金: 3,774,025.11
交易性金融资产: 3,174,403.13

4.5.8 报告期内基金资产组合的说明
截至2015年6月30日,本基金资产组合如下表所示:

4.5.9 报告期内基金资产组合的说明
截至2015年6月30日,本基金资产组合如下表所示:

信息披露 Disclosure 2015 半年度报告摘要

海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

的似度,降低跟踪误差。
4.2 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.3 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.4 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.5 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.6 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.7 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.8 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.9 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.10 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.11 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.12 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.13 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.14 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.15 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.16 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.17 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.18 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.19 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.20 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.21 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.22 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.23 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.24 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.25 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.26 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.27 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.28 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.29 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.30 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.31 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.32 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.33 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.34 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.35 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.36 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.37 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.38 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.39 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.40 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.41 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.42 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.43 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.44 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

4.45 报告期内基金的投资表现
报告期内,本基金净值增长率为40.50%,同期业绩比较基准收益率为42.92%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0065%,年化跟踪误差为2.17%,在合同约定的目标跟踪误差范围内。

会计准则,其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”),中国证监会公告[2010]15号《证券投资基金信息披露XBRL模板第2号-年度报告和半年度报告》、中国证监会公告[2007]年15号颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业业务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定
本基金2015年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015年上半度的业绩变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明
本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]18号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税收法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以公允价值方式销售基金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、基金的差价收入不征收营业税。

(2) 基金从证券市场取得的收入,包括买卖股票、基金的差价收入、股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 自2015年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
关联方名称: 关联方关系: 关联方交易: 关联方交易金额: 占基金净资产比例(%)

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期
关联方交易: 6,948,428.24, 3,174,403.13

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费,支付基金管理人海富通基金管理有限公司的报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后余额部分为负数,则调整为0。管理费计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理费=(前一日基金资产净值-基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值)X 0.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期
基金托管费: 10,000.00, 10,000.00

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,支付基金管理人中国工商银行股份有限公司的报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后余额部分为负数,则调整为0。托管费计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=(前一日基金资产净值-基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值)X 0.1% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间内,除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期
关联方存款: 6,948,428.24, 3,174,403.13

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同期同业市场的利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销的证券发行情况
本基金本报告期及上年度可比期间内未通过关联方承销其承销的证券。

6.4.8.7 其他关联方事项的说明
于报告期末,本基金持有15,697,829.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为75.38%。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
单位:人民币元

Table with 2 columns: 股票代码, 股票名称, 停牌原因, 数量, 成本, 公允价值, 备注

注:本基金截止2015年6月30日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他重要事项
截至资产负债表日,本基金无需说明的其他重要事项。

7 投资组合报告
7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例(%)
1 权益投资: 60,479,000.00, 61.3

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 2 columns: 代码, 行业名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)
A 医药、生物制品: 1,200,000.00, 0.007

7.3 期末按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 2 columns: 代码, 行业名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)
A 医药、生物制品: 1,200,000.00, 0.007

7.4 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
单位:人民币元

Table with 2 columns: 代码, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)
1 601766 长城军工: 800, 3,200,000.00, 0.008

注:买入股票成本、卖出股票收入(成交金额)列示,不考虑相关交易费用。

7.5 基金资产净值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)
1 601766 长城军工: 6,720,000.00, 6.36

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交价款乘以成交数量)列示,不考虑相关交易费用。

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交价款乘以成交数量)列示,不考虑相关交易费用。

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交价款乘以成交数量)列示,不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)
1 601766 长城军工: 6,720,000.00, 6.36

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交价款乘以成交数量)列示,不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券投资。

7.7 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
本基金本报告期末持有债券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。

7.9 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
本基金本报告期末持有贵金属。

7.10 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
本基金本报告期末未持有权证。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资策略
根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12.1 本期国债期货投资情况
根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12.3 本期国债期货投资情况
根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

7.13 投资组合报告附注
7.13.1 报告期内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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定范围之外的股票。

7.13.3 报告期内基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定范围之外的股票。

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额
1 银行存款: 30,761,000.00

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值, 占基金资产净值比例(%)
1 601766 长城军工: 1,200,000.00, 0.007