招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计,毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2015年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年6月11日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	招商丰泽混合	
基金主代码	001427	
交易代码	001427	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月11日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,541,973,263.85份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	招商丰泽混合A	招商丰泽混合C
下属分级基金的交易代码:	001427	001446
报告期末下属分级基金的份额总额	7,334,344.37份	2,534,638,919.48份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置,在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。
投资策略	本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况,在权益类资产、固定收益类资产和现金三大类资产类别间进行相对灵活的配置,并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例。 本基金战略性资产类别配置的决策将从经济运行周期和政策取向的变动,判断市场利率水平、通货膨胀率、货币供应量、盈利变化等因素对证券市场的影响,分析类别资产的预期风险收益特征,通过战略资产配置决策确定基金资产在各大类资产类别间的比例,并参照定期编制的投资组合风险评估报告及相关数量分析模型,适度调整资产配置比例,以便基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化投资组合。
业绩比较基准	中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%(单利年化)
风险收益特征	本基金是混合型基金,在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	王永民
	联系电话	0755-83196666	010-66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755-83196475	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	(1)招商基金管理有限公司 地址:中国深圳深南大道7088号招商银行大厦 (2)中国银行股份有限公司 地址:北京市复兴门内大街1号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年6月11日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	招商丰泽混合A	招商丰泽混合C
本期已实现收益	-2,373,871.99	525,427.38
本期利润	-1,578,773.88	6,184,991.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0004	0.0091
本期基金份额净值增长率	3.20%	4.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0056	0.0040
期末基金资产净值	7,570,539.00	2,644,547,145.28
期末基金份额净值	1.032	1.043
3.1.3 累计期末指标	2015年末	
基金份额累计净值增长率	3.20%	4.30%

注:1.基金业绩指标不包括持有人认(申)购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
2.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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
3.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数;
4.本基金合同于2015年6月11日生效,截止本报告期末基金成立未满1年。

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

招商丰泽混合A

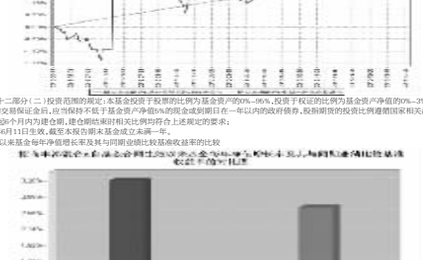
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.20%	0.23%	1.15%	0.01%	2.05%	0.22%
过去六个月	3.72%	0.27%	2.39%	0.01%	1.33%	0.26%
自基金合同生效起至今	3.20%	0.26%	2.67%	0.01%	0.53%	0.25%

招商丰泽混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.06%	0.22%	1.15%	0.01%	1.91%	0.21%
过去六个月	4.82%	0.36%	2.39%	0.01%	2.43%	0.35%
自基金合同生效起至今	4.30%	0.34%	2.67%	0.01%	1.63%	0.33%

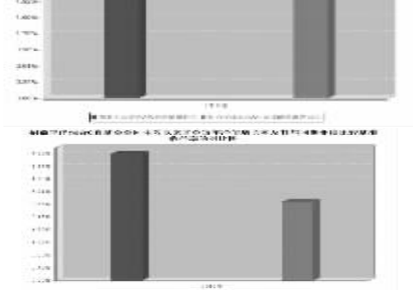
注:1.业绩比较基准收益率=中国人民银行公布金融机构人民币一年期存款基准利率+3%(单利年化),业绩比较基准在每个交易日实现再平衡;
2.本基金合同于2015年6月11日生效,截止本报告期末基金成立未满1年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.根据基金合同第十二部分(二)投资范围的规定:本基金投资于股票的比例为基金资产的0%-95%,投资于权证的比例为基金资产净值的0%-3%,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,应当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,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金于2015年6月11日成立,自基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期结束时相关比例均符合上述规定的要求;
2.本基金合同于2015年6月11日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2015年6月11日生效,截至本报告期末基金成立未满一年,故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年6月11日成立,自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会(2002)100号文批准设立。目前,公司注册资本金为21亿元人民币,其中,招商银行股份有限公司持有公司全部股权的56%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的45%。

截至2015年12月31日,本基金管理人共管理63只共同基金,具体如下:

基金名称	基金类型	基金成立日
招商安泰偏股混合型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰平衡型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰债券投资基金	债券型基金	2003-04-28
招商现金增值开放式证券投资基金	货币市场型基金	2004-01-14
招商先锋证券投资基金	混合型基金	2004-06-01
招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)	混合型基金	2005-11-17
招商安本增利债券型证券投资基金	债券型基金	2006-07-11
招商核心价值混合型证券投资基金	混合型基金	2007-03-30
招商大盘蓝筹混合型证券投资基金	混合型基金	2008-06-19
招商安心收益债券型证券投资基金	债券型基金	2008-10-22
招商行业领先混合型证券投资基金	混合型基金	2009-06-19
招商中小盘精选混合型证券投资基金	混合型基金	2009-12-25
招商全球资源股票型证券投资基金	国际(QDII)基金	2010-03-25
招商深证100指数证券投资基金	股票型基金	2010-06-22
招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2010-06-25
上证消费80交易型开放式指数证券投资基金	股票型基金	2010-12-08
招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型基金	2010-12-08
招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)	国际(QDII)基金	2011-02-11
招商安瑞进取债券型证券投资基金	债券型基金	2011-03-17
深证中子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金	股票型基金	2011-06-27
招商深证电子信息传媒产业 (TMT)50交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型基金	2011-06-27
招商安达保本混合型证券投资基金	混合型基金	2011-09-01
招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2012-02-01
招商产业债券型证券投资基金	债券型基金	2012-03-21
招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金	股票型基金	2012-06-28
招商信用增强债券型证券投资基金	债券型基金	2012-07-20
招商安盈保本混合型证券投资基金	混合型基金	2012-08-20
招商理财7天债券型证券投资基金	货币市场型基金	2012-12-07
招商央视财经50指数证券投资基金	股票型基金	2013-02-05
招商双债增强债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2013-03-01
招商安润保本混合型证券投资基金	混合型基金	2013-04-19
招商保证金快钱货币市场基金	货币市场型基金	2013-05-17
招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金	股票型基金	2013-08-01
招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2013-11-06
招商标普高收益红利债券指数增强型证券投资基金	国际(QDII)基金	2013-12-11
招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-03-20
招商招钱宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-03-25
招商招金宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-06-18
招商可转债分级债券型证券投资基金	债券型基金	2014-07-31
招商丰利灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-08-12
招商行业精选股票型证券投资基金	混合型基金	2014-09-03
招商招利1个月理财债券型证券投资基金	货币市场型基金	2014-09-25
招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-13
招商沪深300地产等权重指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-27
招商医药健康产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-01-30
招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	混合型基金	2015-04-17
招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商中证银行指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商国证生物医药指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商中证白酒指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-11
招商移动互联网产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-06-19
招商国企改革主题混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-29
招商安益保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-07-14
招商丰庆灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2015-07-31
招商体育文化休闲股票型证券投资基金	股票型基金	2015-08-18
招商丰融灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰享灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-02
招商境远保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-15
招商招益一年定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2015-12-25
招商安弘保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-29

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓栋	本基金的基金经理	2015年6月11日	-	6	邓栋,男,中国国籍,工学硕士。2008年加入毕马威华振会计师事务所,从事审计工作,2010年1月加入招商基金管理有限公司,曾任固定收益投资部研究员、招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理,现任固定收益投资部副总监兼行政负责人、招商安达保本混合型证券投资基金、招商安润保本混合型证券投资基金、招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金、招商信用增强债券型证券投资基金、招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、招商全球资源股票型证券投资基金及招商丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1.本基金管理人基金经理的任职日期为本基金合同生效日期,离任基金经理的任职日期以及历任基金经理的聘任日期为公司做出决定的公告(至少1个工作日)日期;
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明:在本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,严格控制风险的前提下,为基金持有人实现最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和执行方法

基金管理人(以下简称“公司”)根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订)的规定,制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定,为保证投资决策合作投资信息、投资建议和实施投资决策方案等有公平的机会,公司合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,建立了科学的投资决策体系、加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司已建立较完善的研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库,制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放,在投资研究层面不存在投资组合间不公平的问题。公司交易室在取得同一时所有组合的各条指令后,当在中央交易员的统一分派下,本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

报告期内,公司按照法规要求,连续四个季度期间内,不同时段至少(如日内、3日内、5日内)对公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析,相关基金经理也对分析中发现的异常情况进行正常范围的情况进行了合理性解释。根据分析结果,公司旗下组合的同向交易情况基本正常,没有发现有明显异常并且无合理理由的同向交易异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,公司要求相关投资组合经理提供决策依据,并留存纪录备查,以全程留有关痕迹的方式进行投资决策。报告期内,本基金不存在同日反向交易的情况。

报告期内,本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关规定执行,各次交易均有充分依据,交易价格公允合理,交易时间合理,交易对象均为具有证券投资资格的机构,交易记录完整,交易手续齐全,交易结果合法有效。报告期内,公司旗下管理的投资组合间的同向交易价差、同日反向交易、投资组合间的交易量、投资组合间的交易对象等方面不存在违反公平交易原则的情况。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济分析:

2015年经济延续下行趋势,经济结构调整取得一定进展,投资和第二产业所占比重继续下降,

消费和第三产业占有所上升,投资领域房地产、基建、制造业投资增速均持续放缓,拖累工业品价格,并带来一定程度的PPI通缩压力。房地产领域销售增速回暖,但投资增速仍在继续下行,全年以去库存为主的过程并未结束。基建投资增速有所下滑,但随着PPP模式的推广,或成为稳增长的重要力量。

CPI全年低位震荡,PPI持续下行并保持在通缩区间。2015年的货币政策全年以宽松为主,8月份央行启动汇率市场化定价机制改革,通过降准等手段保持了资金面的流动性,并通过多种政策工具的组合运用,发挥了稳健货币政策、降低融资成本和经济结构调整多重作用。

债券市场回顾:

2015年的债券市场延续了2014年的牛市行情,上半年在货币政策宽松背景下短端利率快速下行,长端利率下行幅度有限;6月份以后,经济下行幅度加快,股市资金回流,下半年,长端利率下行快于短端,债券收益率中枢下移,信用品种超越利率品种下行,一度造成短期资产荒的格局。全年来看,经济下行、货币宽松、股市资金回流是影响债市走牛的重要驱动因素。

权益市场回顾:

全年股票市场呈现出大波动、大分化的走势,总体而言,全年市场有小幅度的上涨,但以中小创为代表的成长性股票上涨幅度更大。

基金操作回顾:

回顾2015年的基金操作,我们严格遵照基金合同的相关约定,按照既定的投资流程进行了规范运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,招商丰泽A份额净值为1.032元,招商丰泽C份额净值为1.043元。本报告期,招商丰泽A份额净值增长率为3.20%,招商丰泽C份额净值增长率为4.30%,同期业绩基准增长率为2.67%,招商丰泽A份额基金业绩落后于同期比较基准0.53%,招商丰泽C份额基金业绩高于同期比较基准1.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年的债券市场,经济仍有下行压力,通货膨胀压力不大,基本面对债券市场仍有支撑。配合供给侧改革的落实,去库存、去产能将成为实体企业需要解决的首要问题,这一过程预期仍将持续下去,保证长期资产的供给规模和质量的财政政策,从高层高态来看,短期内央行切实稳定住经济增长大概率还会保持警惕,降准等重量级的数量宽松手段会新教使用,预计债券收益率将呈现震荡走势,后续需关注人民币兑美元汇率贬值压力及经济基本面变化对央行货币政策节奏的影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值业务管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策。估值委员会由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会,公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者触发交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整相应证券的估值方法,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能地大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

4.4.3 报告期内基金持有的流通受限证券的公允价值及在当期损益中反映的情况

7.4.1.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015-12-28	2016-1-6	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-
7.4.1.2.1.2 受限证券类别:债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-1-8	新债流通受限	100.00	99.99	6,520	651,957.13	651,957.13	-
7.4.1.2.1.3 受限证券类别:权证									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

7.4.1.2.1 受限证券类别:股票												

停牌日期	期末估值单价	复牌日期	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.2 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.9.3.3 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币130,000,000.00元,于2016年1月7日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有卖出证券交易所交易的债券或在新招募说明书允许限下纳入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 期末持有的指数型基金在报告期内可进行证券投资的证券投资品种情况说明

本基金报告期末未持有股票。

7.4.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.4.11.1 报告期末本基金投资国债期货的投机目的

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.11.2 报告期末本基金投资国债期货的套保目的

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.11.3 报告期末本基金国债期货投资的保证金明细

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.11.4 报告期末本基金国债期货投资的交易明细

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.11.5 报告期末本基金国债期货投资的期货结算明细

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.11.6 报告期末本基金国债期货投资的交易保证金变动情况说明

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.11.7 报告期末本基金应计的国债期货保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.11.8 本期国债期货投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

7.4.12 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.4.12.1 报告期末本基金投资股指期货的投机目的

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.12.2 报告期末本基金投资股指期货的套保目的

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.12.3 报告期末股指期货投资的保证金明细

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.12.4 报告期末本基金投资股指期货的交易明细

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.12.5 报告期末本基金股指期货投资的期货结算明细

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.12.6 报告期末本基金股指期货投资的保证金变动情况说明

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.12.7 报告期末本基金应计的股指期货保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.12.8 本期股指期货投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

7.4.13 报告期末本基金投资的外汇期货交易情况说明

7.4.13.1 报告期末本基金投资外汇期货的投机目的

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.13.2 报告期末本基金投资外汇期货的套保目的

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.13.3 报告期末本基金投资外汇期货的保证金明细

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.13.4 报告期末本基金投资外汇期货的交易明细

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.13.5 报告期末本基金外汇期货投资的期货结算明细

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.13.6 报告期末本基金外汇期货投资的保证金变动情况说明

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.13.7 报告期末本基应计的外汇期货保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.13.8 本期外汇期货投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与外汇期货交易。

7.4.14 报告期末本基金投资的股票期权交易情况说明

7.4.14.1 报告期末本基金投资股票期权的投机目的

本基金报告期末未持有股票期权。

7.4.14.2 报告期末本基金投资股票期权的套保目的

本基金报告期末未持有股票期权。

7.4.14.3 报告期末股票期权投资的保证金明细

本基金报告期末未持有股票期权。

7.4.14.4 报告期末本基应计的股票期权保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有股票期权。

7.4.14.5 本期股票期权投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股票期权交易。

7.4.15 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.4.15.1 报告期末本基应计的国债期货保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有国债期货。

7.4.15.2 本期国债期货投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

7.4.16 报告期末本基应计的股指期货保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有股指期货。

7.4.16.2 本期股指期货投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

7.4.17 报告期末本基应计的外汇期货保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有外汇期货。

7.4.17.2 本期外汇期货投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与外汇期货交易。

7.4.18 报告期末本基应计的股票期权保证金余额及利息收益情况

本基金报告期末未持有股票期权。

7.4.18.2 本期股票期权投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股票期权交易。

7.4.19 报告期末本基应计的其他投资品种情况说明

本基金报告期末未持有其他投资品种。

7.4.19.2 本期其他投资品种投资说明

根据本基金合同规定,本基金不参与其他投资品种。

7.4.20 报告期末本基应计的应付证券清算款余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的应付证券清算款余额及利息收益为零。

7.4.21 报告期末本基应计的应付赎回款余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的应付赎回款余额及利息收益为零。

7.4.22 报告期末本基应计的应付管理费余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的应付管理费余额及利息收益为零。

7.4.23 报告期末本基应计的应付托管费余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的应付托管费余额及利息收益为零。

7.4.24 报告期末本基应计的应付销售服务费余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的应付销售服务费余额及利息收益为零。

7.4.25 报告期末本基应计的其他应付款余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他应付款余额及利息收益为零。

7.4.26 报告期末本基应计的其他应收款余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他应收款余额及利息收益为零。

7.4.27 报告期末本基应计的其他资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他资产余额及利息收益为零。

7.4.28 报告期末本基应计的其他负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他负债余额及利息收益为零。

7.4.29 报告期末本基应计的其他综合收益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他综合收益余额及利息收益为零。

7.4.30 报告期末本基应计的其他各项余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项余额及利息收益为零。

7.4.31 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.32 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.33 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.34 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.35 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.36 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.37 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.38 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.39 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.40 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.41 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.42 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.43 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.44 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.45 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.46 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.47 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.48 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.49 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.50 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.51 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.52 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.53 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.54 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.55 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.56 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.57 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.58 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.59 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.60 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.61 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.62 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.63 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.64 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.65 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.66 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.67 报告期末本基应计的其他各项负债余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项负债余额及利息收益为零。

7.4.68 报告期末本基应计的其他各项权益余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项权益余额及利息收益为零。

7.4.69 报告期末本基应计的其他各项资产余额及利息收益情况

本基金报告期末应计的其他各项资产余额及利息收益为零。

7.4.70 报告期末