

(上接B106版)

23	英大证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区新洲中泰商务大厦三十一、三十二、三十三层 办公地址:深圳市福田区新洲中泰商务大厦三十一、三十二、三十三层 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.ewind.com.cn
24	中天证券股份有限公司	注册地址:成都高新区天府大道中段121号万润国际中心4楼证券营业部 办公地址:成都市高新区天府大道中段121号万润国际中心4楼证券营业部 法定代表人:王洪强 联系人:李海峰 联系电话:028-85066666 客服电话:400-443636 网址:www.ztc.com.cn
25	五矿证券有限公司	注册地址:深圳市福田区福强路302号五矿国际广场10楼1001-1002号 办公地址:深圳市福田区福强路302号五矿国际广场10楼1001-1002号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.wksc.com.cn
26	大通证券股份有限公司	注册地址:大连市中山区大连湾12号大通国际金融中心A-10层 办公地址:大连市中山区大连湾12号大通国际金融中心A-10层 联系人:王静 联系电话:0411-26666666 客服电话:4006-188-488 网址:www.dntong.com.cn
27	天南证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区德胜门内大街19号天南大厦1001-1002号 办公地址:北京市西城区德胜门内大街19号天南大厦1001-1002号 联系人:王静 联系电话:010-68006666 客服电话:4006-188-488 网址:www.tnsec.com.cn
28	联讯证券股份有限公司	注册地址:广东省深圳市福田区莲花三路100号广博电视新闻中心二楼 办公地址:广东省深圳市福田区莲花三路100号广博电视新闻中心二楼 法定代表人:李海峰 联系人:王静 联系电话:0755-22110000 客服电话:4006-188-488 网址:www.lxsec.com.cn
29	东吴证券股份有限公司	注册地址:苏州工业园区星阳街5号 办公地址:苏州工业园区星阳街5号 联系人:王静 联系电话:0512-62939999 客服电话:4006-188-488 网址:www.dwzq.com.cn
30	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
31	中银国际证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦30楼 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦30楼 联系人:王静 联系电话:021-68604666 客服电话:4006-188-488 网址:www.bocib.com.cn
32	太平洋证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路2028号太平洋世纪大厦11楼 办公地址:深圳市福田区金田路2028号太平洋世纪大厦11楼 联系人:王静 联系电话:0755-22110000 客服电话:4006-188-488 网址:www.tpyzq.com.cn
33	安信证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路4038号安信大厦11楼 办公地址:深圳市福田区金田路4038号安信大厦11楼 联系人:王静 联系电话:0755-22110000 客服电话:4006-188-488 网址:www.axxzq.com.cn
34	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
35	民生证券股份有限公司	注册地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号民生大厦11楼 办公地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号民生大厦11楼 联系人:王静 联系电话:010-65056666 客服电话:4006-188-488 网址:www.msyzq.com.cn
36	民生证券股份有限公司	注册地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号民生大厦11楼 办公地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号民生大厦11楼 联系人:王静 联系电话:010-65056666 客服电话:4006-188-488 网址:www.msyzq.com.cn
37	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
38	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
39	川财证券有限责任公司	注册地址:四川省成都市高新区天府大道中段121号川财大厦11楼 办公地址:四川省成都市高新区天府大道中段121号川财大厦11楼 联系人:王静 联系电话:028-85066666 客服电话:4006-188-488 网址:www.cfzq.com.cn
40	中国银河证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街19号 办公地址:北京市西城区金融大街19号 联系人:王静 联系电话:010-66566666 客服电话:4006-188-488 网址:www.chinayh.com.cn

312	北京凯基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区月坛南街100号1001-1002号 办公地址:北京市西城区月坛南街100号1001-1002号 联系人:王静 联系电话:010-68006666 客服电话:4006-188-488 网址:www.kjj.com.cn
313	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
314	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
315	北京凯基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区月坛南街100号1001-1002号 办公地址:北京市西城区月坛南街100号1001-1002号 联系人:王静 联系电话:010-68006666 客服电话:4006-188-488 网址:www.kjj.com.cn
316	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
317	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
318	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
319	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
320	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
321	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
322	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
323	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
324	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
325	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
326	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
327	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
328	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
329	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn
330	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路118号 联系人:王静 联系电话:0755-83007388 客服电话:4006-188-488 网址:www.zhaoshun.com.cn

上海源泰律师事务所  
注册地址:上海市浦东新区256号华夏银行大厦14楼  
负责人:李海  
电话:(021)51150298  
传真:(021)51150398  
经办律师:黎明、田卫红  
3.4 审计基金财产的会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展行大厦6楼  
办公地址:上海市湖北路202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:李海  
联系电话:(021)23238988  
传真:(021)23238800  
联系人:陈嘉  
经办注册会计师:薛亮、陈嘉

4 基金名称  
南方隆元产业主题混合型证券投资基金  
5 基金的类型  
混合型证券投资基金  
6 基金的投资目标  
本基金为混合型基金,在准确把握产业发展趋势和市场运行态势的基础上,集中精选具备国民经济三大产业主题的优势行业和上市公司进行投资,有效控制投资组合风险,追求较高的超额收益与长期资本增值。  
7 基金的投资范围  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开发行的、上市的股票和债券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金投资组合为:股票占基金资产的60%-95%,其中对具备国民经济三大产业主题的优势行业和上市公司的投资不低于股票投资比例的90%;债券、货币市场工具及其他金融工具占基金资产的0-35%;权证占基金资产的0-3%;资产支持证券占基金资产的0-20%;基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。  
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。

8 基金的投资策略  
8.1 投资策略  
本基金在投资策略上采取“自上而下”积极进行资产配置、行业轮动配置和“自下而上”精选个股相结合的方法。  
(一)资产配置策略  
在资产配置上,基金管理人将根据对国际国内宏观、微观经济运行状态、证券市场走势和估值水平、政府财政政策、货币政策、产业政策等方面的研究,提出关于资产配置的研究报告和关于资产配置的建议,投资决策委员会将根据研究部门的建议确定股票、债券、现金三大类资产的配置比例。  
(二)行业配置和轮动策略  
1、三大产业主题  
在新一轮产业结构调整和产业升级中,发展先进制造业、提高现代服务业比重和加强基础产业基础设施建设,是国家产业结构调整的重要任务。因此,关于先进制造业、现代服务业和基础产业的投资主题是本基金所指的三大“产业”主题。  
先进制造业:制造业是国民经济的物质基础,是国家安全的重要保障,国民经济高速增长的发动机及国家竞争力的主要体现。作为制造业赖以生存和发展的先进制造业,将在中国走新型工业化道路,全面建设小康社会、迈向制造强国的进程中起关键性作用。本基金所指的先进制造业主要包括采用先进的技术设备和现代化的管理手段,具有较高科技含量的上市公司。  
现代服务业:服务业是国民经济的重要组成部分,其发展尤其是现代服务业的发展是衡量经济、社会现代化水平的重要标志。大力发展现代服务业是加快工业化、现代化的必然要求,对于促进国民经济协调发展、提高经济效益、扩大就业、加快城镇化进程、改善人民生活都有着重大作用。本基金所指的现代服务业主要包括运用现代经营方式和信息技术手段,代表服务业发展方向的上市公司。  
基础产业:基础产业在国民经济发展中处于基础地位,是支撑社会经济运行的基础,它决定和反映着国民经济活动的发展方向与运行速度,是其他产业赖以存在和发展的前提。本基金所指的基础产业主要包括能源、交通、原材料等国民经济基础行业中的上市公司。

2、行业配置策略  
在上述三大产业的基础上,本基金采取“自上而下”的方式进行行业配置,即基于行业竞争优势和市场结构等进行基本分析,结合行业的历史表现、收益预期、行业经济政策面等,进行综合的相对吸引度评分,然后在市场基准比例的基础上进行行业的轮动配置,选择符合国家产业发展政策,在国民经济三大产业中占据行业优势地位,超额收益率或预测超额收益率水平较高的行业重点投资。  
本基金采用的行业分类是以摩根斯坦利和标准普尔公司联合发布的全球行业分类标准(GICS)为基础,参照中国证监会发布的上市公司行业分类指引对原南方基金行业分类体系进行了调整,形成“南方基金行业投资价值评估体系”。该体系引入“行业评价配置打分表”:首先对各行各业评价综合性的相对吸引度分数,然后在各行业在市场中所占比例为基础,依据吸引度分数进行配置比例的调整。  
吸引度分数的评估体系主要有以下几方面:

(1)研究基金基本信息,例如:行业竞争优势、市场结构、行业的价格收益比、行业成长性、行业内大部分上市公司经营是否健康等;  
(2)行业的历史表现,是否经过大幅概念炒作,分析对收益的预期;  
(3)宏观经济、政策面,例如:政府的行业收支及行业政策;  
(4)可用同行分析法对历史资料进行分析,以判断各因素对预测超额收益率的有效性,确定各因素的关键;  
(5)对各行各业进行综合的吸引度评分。由于各个因素的有效性会随时间变化,各行业的吸引度分数也须经常调整。  
最后,以各行业板块在市场中所占比例为基础,再依据吸引度分数进行配置比例的调整。

本基金对优势行业配置、再配置的过程同时也是对优势行业动态调整的过程。经济的发展是一个动态的过程,在不同的历史时期、不同的宏观背景、不同的产业政策下,国民经济三大产业中各行业板块的发展态势有所不同,本基金将捕捉国民经济产业中各行业发展不同态势,从而选取优势行业进行投资,并随其变化适时调整,以更好把握优势行业。  
本基金将按照“行业评价配置打分表”的内容定期或不定期对各行各业进行评分,剔除评级下降的行业,同时积极投资于评级明显上升的行业。  
3、个股选择策略  
在资产配置、行业配置完成后,本基金管理人主要从以下几个方面评估行业内的上市公司:  
(1)公司的商业模式;  
(2)产品市场前景分析,包括产品本身市场前景、主要竞争对手、上下游产品关联性及定价能力、替代产品分析等;  
(3)公司的核心竞争力分析,包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等;  
(4)公司财务状况及财务管理能力,包括财务安全性指标,反映行业特性的主要财务指标,公司风险与偿债能力与成本分析、公司再投资收益率分析等;  
(5)公司潜在风险及应对措施。

在深入分析公司基本面后,精选优质上市公司组成本基金股票池,进一步采用P/E、P/B、EV/EBITDA、PEG等估值指标,选取行业内估值水平相对较低的股票进行投资。  
(三)债券投资策略  
本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债(包括可转换债)等。本基金将在对利率预期的基础上,做出最佳的资产配置及风险控制。在投资债券品种时,本基金重点分析债券发行人的偿债品质,包括发行机构以及保证机构的偿债能力、财务结构与安全性,并针对不同期限品种的研究,构造收益率曲线,采用久期模型构造最佳债券期限组合,降低利率风险;对可转债的投资,结合对股票走势的判断,发现其套利机会。  
(四)权证投资策略  
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。  
本公司将充分考量权证资产收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

8.2 投资决策依据和决策程序  
(一)决策依据  
1.国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提。  
2.宏观经济形势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础。  
3.投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金维护投资者利益的重要保障。  
4.团队投资方式。本基金在投资决策委员会领导下,通过投资研究全体人员的共同努力与分工协作,由基金经理具体执行投资计划,争取良好投资业绩。

3.2 登记机构  
南方基金管理股份有限公司  
住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路6号免税商务大厦31-33层  
法定代表人:张永成  
电话:(0755)82763849  
传真:(0755)82763849  
联系人:王利群  
3.3 出具法律意见书的律师事务所

(二)决策程序  
1. 决定主要投资策略:投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资策略,确立基金的投资方针及投资方向,审定基金的资产及行业配置方案。  
2. 团队投资与投资决策制定:在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下,通过投资研究全体人员的团队投资、分工协作,由基金经理具体执行投资计划;1、依据团队投资研究团队对宏观经济、股市政策、市场趋势的判断,结合基金合同、投资制度的要求提出本基金资产及行业配置建议,在投资决策委员会授权及批准的范围内,最终决定基金的资产及行业配置方案;2、依据团队投资研究团队对各行各业的具体分析与股票备选名单,结合基金合同、投资制度的要求,在投资决策委员会授权及批准的范围内,制定基金的个股投资方案。  
3. 进行风险评估:风险管理部对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估,并出具风险监控报告。  
4. 评估和调整决策程序:基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。  
9 基金业绩比较基准  
本基金业绩比较基准:  
85%×沪深300指数+15%×上证国债指数  
本基金为混合型基金,在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个指数指数的编制方法和历史情况后,我们选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准。沪深300指数成份股选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A股市场代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势。沪深300指数的指数股发布和调整均由交易所完成,具有较好的公正性与权威性。债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的上证国债指数。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数,反映我国债券市场整体变动状况,具有较强的市场代表性。  
如今后法律法规发生变化,或者有更权威、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业绩比较基准的股票指数时,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。

10 基金的风险收益特征  
本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。  
11 基金投资组合报告  
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。  
基金管理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。  
基金管理人承诺: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,投资者在做出投资决策前,应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本投资组合报告所载数据截至2018年3月31日(未经审计)。

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	1,189,079,293.23	69.73
2	银行存款	1,189,079,293.23	69.73
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	现金	133,516,773.39	7.69
2	银行存款	133,516,773.39	7.69
3	债券投资	133,516,773.39	7.69
4	资产支持证券	133,516,773.39	7.69
5	基金投资	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	149,168,261.51	8.41
9	其他资产	60,079,451.11	3.41
10	合计	2,189,123,618.56	100.00

2018年1月1日-2018年3月31日	-1.20%	1.10%	-226%	1.00%	1.20%	0.10%
自基金转型生效起至今	-15.20%	1.43%	-10.25%	1.50%	-4.95%	-6.01%

§ 13 基金的费用概览

### 13.1 与基金运作有关的费用