

万家瑞隆混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第1号)

基金管理人：万家基金管理有限公司
 基金托管人：华夏银行股份有限公司
 二零一八年七月
 重要提示
 万家瑞隆混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金转型而来，万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金于2015年8月25日经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1997号文注册募集，于2016年11月8日获中国证监会机构部函[2016]2728号文延期募集备案的回函，并于2016年11月30日生效。2018年4月17日，以通讯方式召开的万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于修改万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金合同有关事项的议案》，内容包括万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金变更名称、修改基金投资范围、修改投资比例限制、修改基金费率、修订基金合同等事项。自万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效之日起，《万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且《万家瑞隆混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。
 本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值或收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
 本基金成立运作期间，单一投资者持有基金份额比例不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%除外。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应仔细阅读基金合同、本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立、谨慎决策。投资人根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括：整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人及其基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。本基金的投资范围包括股指期货、国债期货、股票期权、权证等金融衍生品，可能给本基金带来额外风险。本基金的投资范围包括中小企业私募债券，由于该类债券采取非公开方式发行和交易，并不公开各类材料（包括招募说明书、审计报告等），外部评级机构一般不对该类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响到该类债券的市场流动性。另一方面，由于中小企业私募债券的债券发行主体资产规模较小、经营的波动性较大，且各类材料不公开发布，也大大提高了分析和跟踪发债主体信用基本面的难度。本基金是混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品种，投资人应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。
 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金本金一定盈利，也不保证最低收益。
 本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年5月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日，财务数据未经审计。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况
 名称：万家基金管理有限公司
 住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号陆家嘴投资大厦9层
 法定代表人：方一天
 成立日期：2002年8月23日
 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】144号
 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司
 注册资本：壹亿元人民币
 存续期间：持续经营
 联系人：兰剑
 电话：021-38909626 传真：021-38909627

二、主要人员情况
 1.基金管理人董事会成员
 董事长方一天先生，大学本科，学士学位，先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职，2014年10月加入万家基金管理有限公司，2014年12月起任公司董事，2015年2月至2016年7月任公司总经理，2016年7月起任公司董事长。

董事马永春先生，政治经济学硕士学位，曾任新疆自治区党委政策研究室科长，新疆通宝投资有限公司总经理，新疆对外经贸集团总经理，新疆天山股份有限公司董事，新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。现为新疆国际实业股份有限公司高级顾问。

董事钱西存先生，中共党员，研究生，工商管理学硕士，曾任莱钢集团财务部部长、副部长，齐鲁证券有限责任公司计划财务部总经理，现任中泰证券股份有限公司财务总监。

董事经晓云女士，中国民主建国会会员，研究生，工商管理学硕士，曾任上海财政证券公司市场管理部经理，上海证券有限责任公司经纪管理总部副总经理、总经理，上投摩根基金管理有限责任公司副总经理。2016年7月加入万家基金管理有限公司，任公司董事、总经理。

独立董事王小能先生，中共党员，哲学博士，教授。曾任华东理工大学商学院讲师、中央财经大学中国金融发展研究院硕士生导师、副教授、博士生导师，上海财经大学金融学院副教授、博士生导师，现任上海财经大学金融学院教授、博士生导师。

2.基金管理人监事会成员
 监事会主席李润起先生，硕士学位，经济师。曾任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部项目经理，新疆国际实业股份有限公司证券事务代表、副总经理，现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书。

监事张浩先生，中共党员，管理学博士，先后任职于山东东证投资管理有限公司、山东省国有资产控股有限公司、巨能资本管理有限公司，现任巨能资本管理有限公司董事长。

监事陈广益先生，中共党员，硕士学位，先后任职于苏州市对外贸易公司、兴业全球基金管理有限公司，2005年3月起任职于万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、运营部总经理。

监事李海女士，中共党员，硕士，中级讲师。先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起加入本公司，现任公司综合管理部总监。

监事尹丽雯女士，中共党员，硕士，先后任职于申银万国期货有限公司、东海期货有限责任公司，现任其资产管理部负责人。2017年4月起加入本公司，现任公司综合管理部副总监。

3.基金管理人高级管理人员
 董事长：方一天先生（简介请参见基金管理人董事会成员）
 总经理：经晓云女士（简介请参见基金管理人董事会成员）
 副总经理：李杰先生，硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券，从事行政管理、机构客户开发等工作；2003年至2007年任职于兴安证券，从事营销管理工作；2007年至2011年任职于齐鲁证券，任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入本公司，曾任综合管理部总监、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理。

副总经理：黄海先生，硕士研究生，先后在上海德福投资管理有限责任公司、上海申银万国证券研究所有限公司、华宝信托有限责任公司、中国国际证券有限责任公司工作，历任项目经理、研究员、投资经理、投资总监等职务。2015年4月进入万家基金管理有限公司任投资总监职务，负责公司投资管理工。2017年4月起任公司副总经理。

督察长：兰剑先生，法学硕士，律师，注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利德律师事务所从事律师工作，2005年10月进入万家基金管理有限公司工作，2015年4月起任公司督察长。

4.本基金基金经理简历
 李文宾，2010年7月至2014年4月在中银国际证券有限责任公司工作，担任研究员职务。2014年6月至2015年11月在华泰资产管理有限责任公司工作，担任研究员职务。2015年11月加入我公司工作，现任万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家双利灵活配置型基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家增强收益混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金参与融资融券业务。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
 股票投资占基金资产的60%—95%，其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券、股指期货、国债期货、股票期权、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

第八部分 基金的投资策略

1.资产配置策略
 基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动的投资管理策略，通过定性及定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利机会。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。

2.股票投资策略
 本基金主要投资于具有较强核心竞争力且估值相对成长性有较高吸引力的公司股票。本基金从定性和定量两个方面来把握投资对象的特征：

（1）定性方面
 公司治理透明，注重公众股东利益和投资者关系；具有优秀、较为稳定的管理层，管理规范进取，能适应不断发展市场情况；公司业务透明、清晰，资产质量及财务状况较好；在生产、技术、市场、政策环境等经营层面具有较强的竞争优势；有清晰的公司战略执行力，并与其现有的竞争优势相契合。

（2）定量方面
 已具备历史成长性，历史每股主营业务收入、EPS等财务指标已具有增长性；未来成长性持续，预期每股主营业务收入增长率和预期EPS增长率等指标高于行业平均水平；为法精选之目的，本基金结合定量分析定性分析，构建选股模型动态建立和维护核心股票库，从而筛选出具有较高成长性且估值有吸引力的公司股票进行投资布局；在具体买卖股票时点上，综合考虑市场风格、风险偏好、市场情绪、资金面、政策面等因素，将风险管理意识贯穿于股票投资过程中，对投资标的进行持续价格的跟踪和评估。

3.权证投资策略
 本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的投资回报后收益。

4.普通债券投资策略
 在债券投资策略上，本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上，对影响个别债券定价的主要因素，包括流动性、市场供求、信用评级、票息及财务风险、赎回、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

5.中小企业私募债券投资策略
 本基金将综合运用信用评级、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行中小企业私募债券的投资。

本基金特别关注重大中小企业私募债券的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定中小企业私募债券券类资产的合理配置比例，保证本金相对安全和资产流动性，以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中，将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性；同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素，并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券发行深入研究，由债券研究员根据公司内部《信用评级库管理办法》对中小企业私募债券的信用风险和投资价值进行评价并给出内部信用评级和投资评级。本基金可投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券；对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券，禁止进行投资。

6.资产支持证券投资策略
 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

7.股指期货投资策略
 在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

8.国债期货投资策略
 本基金将基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

9.股票期权投资策略
 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关规定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

10.融资融券策略
 本基金可通过融资融券的杠杆作用，在符合融资交易各项法规要求及风险控制要求的前提下，放大投资收益。
 未来，随着市场的发展和基金管理人运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

第九部分 基金的投资限制

1.组合限制
 基金的投资组合应遵循以下限制：
 （1）本基金股票投资占基金资产的60%—95%；
 （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；
 （3）本基金参与融资融券业务，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；
 （4）本基金持有一家上市公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；
 （5）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，不得超过该证券的10%；
 （6）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%；
 （7）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%；
 （8）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
 （9）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，不得超过该基金资产净值的10%；
 （10）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%；
 （11）本基金持有的同一相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%；
 （12）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%；
 （13）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；
 （14）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
 （15）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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
 （16）本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；
 （17）本基金参与股指期货、国债期货交易，应当符合下列投资限制：

在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；
 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；
 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；
 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；
 基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；
 基金在任何交易日日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

本基金在无任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；
 基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；
 基金在任何交易日日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（18）本基金参与股票期权交易，应当符合下列要求：基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或约定规模的证券；可以开仓认购期权的现金或证券市值；未平仓的期权合约价值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；
 （19）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%；
 （20）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；
 （21）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%，因证券停牌、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
 （22）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
 （23）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。

除上述第（2）、（13）、（21）、（22）项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使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，但中国证监会规定的特殊情形除外。
 基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在此期间，基金的投资范围和投资策略应符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

以上限制中，如为法律法规或监管部门强制性要求，法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
 为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；
 （2）违反规定向他人贷款或提供担保；
 （3）从事承担无限责任的投资；
 （4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理部门另有规定的除外；
 （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
 （6）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；
 （7）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。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

第十部分 基金的业绩比较基准
 本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数，覆盖了沪深两市大中市值的具有良好流动性的市场代表性和市场流动性。沪深300指数与市场整体表现具有较高的相关性，且指数历史表现强于市场平均收益水平，具有良好的投资价值。该指数由中证指数公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护，编制方法的透明度高，具有独立性。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有很高的代表性。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素。

本基金选用沪深300指数和中证全债指数加权作为本基金的业绩比较基准。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场上出现更合适适用于本基金的业绩基准时，本基金管理人可以在报经与基金托管人协商一致后，在与基金托管人协商一致并提前报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

第十一部分 基金的风险收益特征
 本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金。

第十二部分 基金的投资报告内容不在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏、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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2018年4月17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2018年3月31日，本报告中列示财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	8,878,961.00	80.80
	其中:股票	8,878,961.00	80.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	499,860.00	4.53
	其中:债券	499,860.00	4.53
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和拆借资金	1,272,261.34	11.63
8	其他资产	391,366.31	3.56
9	合计	11,022,517.68	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,226,746.00	46.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	389,286.00	3.53
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	946,570.00	8.52
H	信息和通信技术	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,172,540.00	10.54
J	金融业	688,360.00	6.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	487,542.00	4.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	8,578,961.00	77.28
	合计	-	-

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
 本基金报告期末未持有沪港通股票投资组合

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	603977	雅迪股份	40,100	508,800.00	4.76
2	600028	南方航空	48,100	500,721.00	4.67
3	000643	万润股份	41,400	462,024.00	4.21
4	002242	纽元传媒	11,100	467,542.00	4.27
5	600115	东方航空	67,700	444,872.00	4.16
6	300613	蓝晓科技	2,500	427,550.00	4.04
7	600688	中国石化	19,000	432,630.00	4.04
8	300048	机器人	20,700	432,420.00	4.04
9	300037	新研股份	20,300	431,172.00	4.02
10	600673	东阿阿胶	41,600	423,904.00	3.86

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	-
2	地方政府债	-	-
3	金融债	499,860.00	4.53
4	企业债	499,860.00	4.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	499,860.00	4.53
10	合计	-	-

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
----	------	------	-------	---------