

信息披露 disclosure

易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

重要提示
基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。

基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日编制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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Rows include 瑞选灵活配置混合 (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid) and 瑞选灵活配置混合(LOF) (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid LOF).

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

注:1.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,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

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。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Rows include 瑞选灵活配置混合 (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid) and 瑞选灵活配置混合(LOF) (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid LOF).

重要提示
基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。

基金管理人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日编制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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Rows include 瑞祥灵活配置混合 (Ruixiang Flexible Allocation Hybrid) and 瑞祥灵活配置混合(LOF) (Ruixiang Flexible Allocation Hybrid LOF).

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

注:1.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,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

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。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Rows include 瑞祥灵活配置混合 (Ruixiang Flexible Allocation Hybrid) and 瑞祥灵活配置混合(LOF) (Ruixiang Flexible Allocation Hybrid LOF).

重要提示
基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。

基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日编制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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Rows include 瑞选灵活配置混合 (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid) and 瑞选灵活配置混合(LOF) (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid LOF).

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

注:1.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,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

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。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Rows include 瑞选灵活配置混合 (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid) and 瑞选灵活配置混合(LOF) (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid LOF).

重要提示
基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。

基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日编制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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

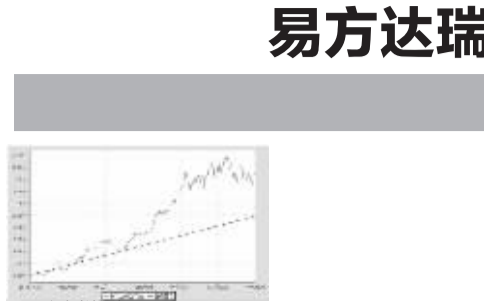
Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Rows include 瑞选灵活配置混合 (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid) and 瑞选灵活配置混合(LOF) (Ruixuan Flexible Allocation Hybrid LOF).

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期末 (Report End). Rows include 1.本期已实现收益 (Realized Income), 2.本期公允价值变动收益 (Fair Value Change), etc.

注:1.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,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

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。



易方达瑞选基金基金经理

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Rows include 基金经理 (Fund Manager) and 基金经理助理 (Fund Manager Assistant).

注:1.基金合同生效至报告期末,本基金份额净值增长率为17.62%,同类基金份额净值增长率为16.74%,同期业绩比较基准收益率为10.05%。

注:1.基金的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以持有人利益为优先,致力于基金份额持有人利益最大化,本基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构均遵守法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以持有人利益为优先,致力于基金份额持有人利益最大化。

4.3公平交易专项说明
4.3.1公平交易制度的执行情况
本基金管理人严格按照有纪律、规范化的投资和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人建立了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度,并严格执行各环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统集中公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度执行情况良好。

4.3.2异常交易的专项说明
本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的24%,其中23次为指数型投资组合交易,投资组合投资策略调整和基金组合发生的反向交易,1次为不同基金管理的基金投资组合间不同而发生的反向交易,均无基金管理人刻意操纵行为审批程序。本报告期内,本基金管理人未发现异常交易及利益输送的异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现
2018年第三季度,本基金投资策略为:在保持仓位的前提下,追求基金资产的稳健增值。

4.4.2报告期内基金业绩表现
截至报告期末,本基金基金份额净值为1.06元,本报告期份额净值增长率为0.27%,同类基金份额净值为1.00元,本报告期份额净值增长率为0.74%,同期业绩比较基准收益率为0.89%。

4.4.3报告期内基金资产组合情况
截至报告期末,本基金资产组合情况如下表所示。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1. 权益投资 (Equity Investment), 2. 固定收益投资 (Fixed Income Investment), etc.

4.4.4报告期内基金投资组合的行业分布
截至报告期末,本基金投资组合的行业分布情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.5报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.6报告期内基金投资组合的杠杆情况
截至报告期末,本基金投资组合的杠杆情况如下表所示。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1. 权益投资 (Equity Investment), 2. 固定收益投资 (Fixed Income Investment), etc.

4.4.7报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.8报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.9报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.10报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.11报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.12报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.13报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.14报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.15报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.16报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

注:1.基金的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。



易方达瑞祥基金基金经理

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Rows include 基金经理 (Fund Manager) and 基金经理助理 (Fund Manager Assistant).

注:1.基金合同生效至报告期末,本基金份额净值增长率为27.21%,同期业绩比较基准收益率为9.43%。

注:1.基金的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以持有人利益为优先,致力于基金份额持有人利益最大化,本基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构均遵守法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以持有人利益为优先,致力于基金份额持有人利益最大化。

4.3公平交易专项说明
4.3.1公平交易制度的执行情况
本基金管理人严格按照有纪律、规范化的投资和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人建立了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度,并严格执行各环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统集中公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度执行情况良好。

4.3.2异常交易的专项说明
本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的24%,其中23次为指数型投资组合交易,投资组合投资策略调整和基金组合发生的反向交易,1次为不同基金管理的基金投资组合间不同而发生的反向交易,均无基金管理人刻意操纵行为审批程序。本报告期内,本基金管理人未发现异常交易及利益输送的异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现
2018年第三季度,本基金投资策略为:在保持仓位的前提下,追求基金资产的稳健增值。

4.4.2报告期内基金业绩表现
截至报告期末,本基金基金份额净值为1.01元,本报告期份额净值增长率为2.12%,同类基金份额净值为1.05元,本报告期份额净值增长率为2.71%,同期业绩比较基准收益率为0.5%。

4.4.3报告期内基金资产组合情况
截至报告期末,本基金资产组合情况如下表所示。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1. 权益投资 (Equity Investment), 2. 固定收益投资 (Fixed Income Investment), etc.

4.4.4报告期内基金投资组合的行业分布
截至报告期末,本基金投资组合的行业分布情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.5报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.6报告期内基金投资组合的杠杆情况
截至报告期末,本基金投资组合的杠杆情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.7报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.8报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.9报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.10报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.11报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.12报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.13报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.14报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.15报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.16报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

注:1.基金的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。



易方达瑞选基金基金经理

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1. 权益投资 (Equity Investment), 2. 固定收益投资 (Fixed Income Investment), etc.

注:1.基金合同生效至报告期末,本基金份额净值增长率为17.62%,同类基金份额净值增长率为16.74%,同期业绩比较基准收益率为10.05%。

注:1.基金的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以持有人利益为优先,致力于基金份额持有人利益最大化,本基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构均遵守法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以持有人利益为优先,致力于基金份额持有人利益最大化。

4.3公平交易专项说明
4.3.1公平交易制度的执行情况
本基金管理人严格按照有纪律、规范化的投资和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人建立了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度,并严格执行各环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统集中公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度执行情况良好。

4.3.2异常交易的专项说明
本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的24%,其中23次为指数型投资组合交易,投资组合投资策略调整和基金组合发生的反向交易,1次为不同基金管理的基金投资组合间不同而发生的反向交易,均无基金管理人刻意操纵行为审批程序。本报告期内,本基金管理人未发现异常交易及利益输送的异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现
2018年第三季度,本基金投资策略为:在保持仓位的前提下,追求基金资产的稳健增值。

4.4.2报告期内基金业绩表现
截至报告期末,本基金基金份额净值为1.06元,本报告期份额净值增长率为0.27%,同类基金份额净值为1.00元,本报告期份额净值增长率为0.74%,同期业绩比较基准收益率为0.89%。

4.4.3报告期内基金资产组合情况
截至报告期末,本基金资产组合情况如下表所示。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1. 权益投资 (Equity Investment), 2. 固定收益投资 (Fixed Income Investment), etc.

4.4.4报告期内基金投资组合的行业分布
截至报告期末,本基金投资组合的行业分布情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.5报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.6报告期内基金投资组合的杠杆情况
截至报告期末,本基金投资组合的杠杆情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.7报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.8报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.9报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.10报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.11报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.12报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.13报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.14报告期内基金投资组合的境外资产
截至报告期末,本基金投资组合的境外资产情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.15报告期内基金投资组合的流动性
截至报告期末,本基金投资组合的流动性情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

4.4.16报告期内基金投资组合的衍生品投资
截至报告期末,本基金投资组合的衍生品投资情况如下表所示。

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 行业类别 (Industry Category). Rows include A. 农林牧渔 (Agriculture), B. 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

注:1.基金的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 名称 (Name). Rows include 1. 存出保证金 (Outstanding Margin), 2. 应收证券利息 (Receivable Securities Interest), etc.

5.1.1.4报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 债券代码 (Bond Code). Rows include 1. 123003 (123003), 2. 113015 (113015), etc.

注:根据《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》,大股东以外的股东减持所持持有的上市公司非公开发行股份,采取集中竞价交易方式的,应在任意连续90日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%。持有上市公司非公开发行股份的股份,通过集中竞价交易减持股份股份的,除遵守前款规定外,自股份减持期限之日起的12个月内,减持数量不得超过其持有该非公开发行的股份数量的50%。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 单位 (Unit). Rows include 报告期初基金份额总额 (Total Shares at Start), 报告期申购份额 (Shares Purchased), etc.

7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况
7.2 基金管理人运用固有资金投资