

大成一带一路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:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日
重要提示
基金管理人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...

Table with 2 columns: 基金名称, 大成一带一路混合型; 基金代码, 000219; 基金运作方式, 契约开放式...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期利润总额 -85,441,900.29
2.本期净利润 -20,856,677.90

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人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。

Table with 5 columns: 报告期, 净值增长率①, 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

注:本基金合同约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期间,本基金的投资组合比例不符合基金合同的约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists fund managers and their terms.

注:1.任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。
2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《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,以信用市场、依法合规为投资行为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》...

今年以来,外贸出口了一些新变量在挑战传统的经济、证券分析框架。过去的一个季度,组合仓位有所调减,在行业配置、个股选择上变化不大。大成一带一路组合管理思路逐渐成型,但面对如何适应不同周期获取投资收益的目标还在持续探索和突破。在应对市场新的变化中也需要逐步调整应对策略,本基金管理人秉持基金份额持有人利益为原则,一如既往地通过可持续的、扎实的研究能力力争提升长期风险调整后的投资业绩。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
截至本报告期末本基金投资组合比例为:95.0%; 本报告基金份额净值增长率为-7.72%,业绩比较基准收益率为-0.55%。
4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

5.3 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

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日
重要提示
基金管理人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...

Table with 2 columns: 基金名称, 大成中小盘混合型(LOF); 基金代码, 000919; 基金运作方式, 契约开放式...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期利润总额 -19,852,444.34
2.本期净利润 -4,962,390.76

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人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。

Table with 5 columns: 报告期, 净值增长率①, 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

注:1.本基金于2014年4月10日起由原宏源证券投资基金转型为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF),截至本报告期末已完成建仓。
2.本基金于2015年7月24日起由大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)更名为大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《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,以信用市场、依法合规为投资行为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》...

大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析,2018年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;主动投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要;投资组合间相关资产交易不存在市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分析统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度中小板和创业板继续大幅下跌,上证指数已经企稳反弹,从板块表现上看,6个军工和油服表现突出。在技术创新驱动板块中,展望未来2-3年,可能6个行业具备一定确定性的有巨大变化的板块,在基站端-终端-应用和内容等不同的产业链环节,可能会有一些超预期的公司,军工板块持续下跌了3年多,在几乎所有行业中表现资金都会一窝蜂的背景下,军工企业的现金流反而大幅改善,是值得重视的信号。油服除了油价上涨的背景之外,又有了一部分地缘政治导致的能源安全主题。

在整个投资研究体系部分,本基金季度持续投入精力深入挖掘个股,通过模板化的方法梳理清楚优质公司的投资逻辑和一次次跟踪的变化,把握个股投资公司在研究的基础上,把风险模型构建在公司研究的过程中。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
截至本报告期末本基金份额净值为1.926元;本报告基金份额净值增长率为0.10%,业绩比较基准收益率为-6.23%。
4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

5.3 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

中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

本季度股票市场表现仍然不理想,整体呈现宽幅震荡的走势,本季度市场基准沪深300指数下跌2.05%。尽管基金指数跌幅不深,但二季度有很大回撤,但被4月份反弹抵消。市面对于国企改革成为趋势,表现优于大盘蓝筹股的中证100指数上涨1.12%,止跌企稳,起到了稳定大市的作用;而表现成长股的新能源、创业板指数分别下跌10.43%和12.16%。在行业方面,金融、钢铁、煤炭等周期板块表现较好,而受消费数据下行的影响,家电、纺织服装等行业出现大幅回调。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
截至本报告期末本基金份额净值为1.443元;本报告基金份额净值增长率为-7.08%,业绩比较基准收益率为-7.31%。
4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金在本报告期内,曾出现了连续60个工作日资产净值低于五千万元的情形,公司已根据法律法规及基金合同约定采取相关应对措施方案上报中国证监会备案。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

本季度股票市场表现仍然不理想,整体呈现宽幅震荡的走势,本季度市场基准沪深300指数下跌2.05%。尽管基金指数跌幅不深,但二季度有很大回撤,但被4月份反弹抵消。市面对于国企改革成为趋势,表现优于大盘蓝筹股的中证100指数上涨1.12%,止跌企稳,起到了稳定大市的作用;而表现成长股的新能源、创业板指数分别下跌10.43%和12.16%。在行业方面,金融、钢铁、煤炭等周期板块表现较好,而受消费数据下行的影响,家电、纺织服装等行业出现大幅回调。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
截至本报告期末本基金份额净值为1.443元;本报告基金份额净值增长率为-7.08%,业绩比较基准收益率为-7.31%。
4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金在本报告期内,曾出现了连续60个工作日资产净值低于五千万元的情形,公司已根据法律法规及基金合同约定采取相关应对措施方案上报中国证监会备案。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》...

4.3.2 异常交易行为的专项说明
公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析,2018年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;主动投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要;投资组合间相关资产交易不存在市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分析统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,宏观局势依然未趋于明朗,中美贸易摩擦是当前最为突出的矛盾,进而影响国内民生的方方面面。随着美国中期大选临近,多方利益冲突也愈发显现。作为最直观的信号,人民币对美元汇率继续走低。在国内方面,虽然近期物价经济数据尚好,但长期来看通胀压力不断,货币政策相对宽松,银行流动性较为充裕,但资产端没有大量入市的需求。

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 81,300.38
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 22,920.03
5 应收申购款 48,141.79
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 152,362.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.12 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.10.1 本期国债期货投资政策
无。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 338,233.03
2 应收证券清算款 6,362,923.87
3 应收股利 -
4 应收利息 28,375.61
5 应收申购款 178,655.42
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 6,707,092.26

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.10.1 本期国债期货投资政策
无。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名股票之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 196.70
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 131.25
5 应收申购款 -
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 327.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.10.1 本期国债期货投资政策
无。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名股票之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 17,000,000.00
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 17,000,000.00
5 应收申购款 77,917.00
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 34,077,917.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 81,300.38
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 22,920.03
5 应收申购款 48,141.79
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 152,362.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.12 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.10.1 本期国债期货投资政策
无。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 338,233.03
2 应收证券清算款 6,362,923.87
3 应收股利 -
4 应收利息 28,375.61
5 应收申购款 178,655.42
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 6,707,092.26

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.10.1 本期国债期货投资政策
无。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名股票之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 196.70
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 131.25
5 应收申购款 -
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 327.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.10.1 本期国债期货投资政策
无。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名股票之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 17,000,000.00
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 17,000,000.00
5 应收申购款 77,917.00
6 其他资产 -
7 预提费用 -
8 其他 -
9 合计 34,077,917.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 基金份额变动

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.10.1 本期国债期货投资政策
无。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名股票之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚并不会对其投资价值构成实质性负面影响。