

南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)

2018年第三季度报告

基金管理人：南方基金管份有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月26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。

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。

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。

§2 基金产品概况

基金简称	南方聚利1年定期开放债券 (LOF)
场内简称	南方聚利
基金代码	160131
场内代码	160131
交易代码	160131
基金运作方式	上市契约开放式
基金合同生效日	2013年11月29日
报告期末基金份额总额	83,946,150.03份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持基金资产长期稳定的基础上，力求获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策及收益率曲线分析，采用自上而下的策略进行资产配置。
业绩比较基准	1年期银行定期存款利率(税后)+1.2%
风险收益特征	本基金为债券基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。
基金管理人	南方基金管份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属证券投资基金	南方聚利A、南方聚利C
下属证券投资基金简称	南方聚利A
下属证券投资基金代码	160131 160134
报告期末下属基金的投资组合	见基金投资组合报告

3.2 自基金合同生效以来基金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



4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期 限	在职日期	离任日期	说明
李伟	本基金 基金经 理	2016年12 月30日	-	-	美国加州大学圣地亚哥分校工读生，注册金融分析师 (CFA)，具有基金从业资格，2012年12月加入南方基金，任中欧稳健成长债券基金经理，2015年5月20日至2016年8月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理，2016年11月至2017年11月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理，2017年11月至今，任南方聚利1年定期开放债券基金经理。

姓名	职务	任本基金的基金经理期 限	在职日期	离任日期	说明
何颀	本基 基金经 理	2017年9月 14日	-	-	西南财经大学金融学硕士，具有基金从业资格。曾任就职于中国证劵期货交易所，任债券部、固定收益部、衍生品部、资产管理部、宏观策略部、投资管理部、基金经理。2013年11月至2014年6月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理；2014年4月至2016年8月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理；2016年8月至2017年11月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理；2017年11月至今，任南方聚利1年定期开放债券基金经理。2017年12月至2018年12月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理；2018年12月至今，任南方聚利1年定期开放债券基金经理。

注：1、本基金历任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告 (生效) 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的范围的相关规定；

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规，中国证监会和中国证券业协会的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的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5%的交易次数为0次，是由于投资组合接受投资者申购后被动增减仓位以及投资组合的投资策略所致。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的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5%的交易次数为0次，是由于投资组合接受投资者申购后被动增减仓位以及投资组合的投资策略所致。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：南方基金管份有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月26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。

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。

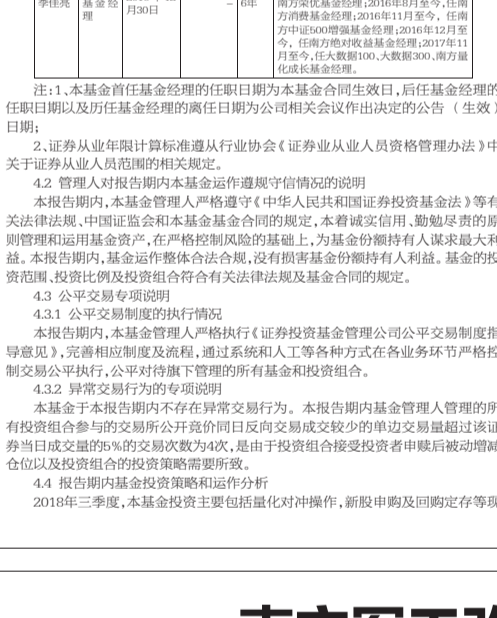
本报告中财务资料未经审计。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方绝对收益定期开放混合 (LOF)
场内简称	南方绝对
基金代码	000844
场内代码	000844
交易代码	000844
基金运作方式	契约封闭式
基金合同生效日	2014年12月11日
报告期末基金份额总额	388,926,821.19份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争实现长期稳定的增值收益。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合的方式在股票、债券、货币市场工具、现金以及衍生品市场进行资产配置。
业绩比较基准	中证500指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其风险和预期收益高于债券基金、货币市场基金。
基金管理人	南方基金管份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属证券投资基金	南方绝对收益定期开放混合 (LOF)

3.2 自基金合同生效以来基金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



4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期 限	在职日期	离任日期	说明
李伟	本基金 基金经 理	2016年12 月30日	-	-	美国加州大学圣地亚哥分校工读生，注册金融分析师 (CFA)，具有基金从业资格，2012年12月加入南方基金，任中欧稳健成长债券基金经理，2015年5月20日至2016年8月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理，2016年11月至2017年11月，任南方聚利1年定期开放债券基金经理，2017年11月至今，任南方聚利1年定期开放债券基金经理。

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	11,416,377.00	2.59
B	采矿业	51,291,280.00	11.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,659,650.00	0.38
E	建筑业	3,548,503.00	0.81
F	批发和零售业	3,848,480.00	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	2,447,566.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,044,759.00	4.09
J	金融业	28,015,403.32	6.56
K	房地产业	11,320,922.66	2.67
L	租赁和商务服务业	1,303,104.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	248,510.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	286.20	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,008,880.00	1.14
S	综合	-	-
合计	-	138,611,132.10	31.67

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告 (生效) 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的范围的相关规定；

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规，中国证监会和中国证券业协会的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的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5%的交易次数为4次，是由于投资组合接受投资者申购后被动增减仓位以及投资组合的投资策略所致。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

南方军工改革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：南方基金管份有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月26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。

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。

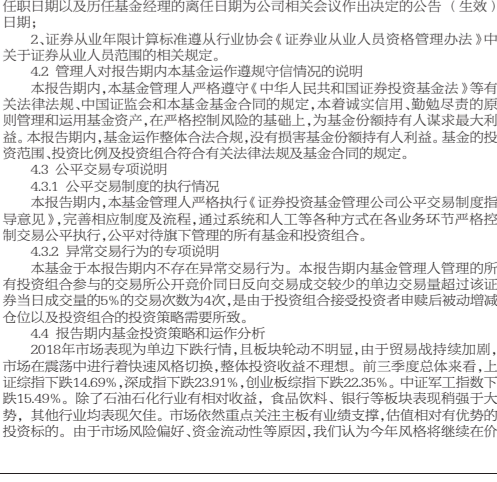
本报告中财务资料未经审计。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方军工改革混合
基金代码	004224
交易代码	004224
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2017年7月16日
报告期末基金份额总额	588,434,815.76份
投资目标	在严格控制风险并保持较好流动性的前提下，通过仓位优化操作，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定性定量相结合的方法动态调整经济周期、行业轮动、主题投资、市场估值、海外配置等投资逻辑，在严格控制风险的前提下，把握市场机会，进行主动投资。
业绩比较基准	中证军工指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其风险和预期收益高于债券基金、货币市场基金。
基金管理人	南方基金管份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属证券投资基金	南方军工改革混合

3.2 自基金合同生效以来基金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、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告 (生效) 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的范围的相关规定；

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规，中国证监会和中国证券业协会的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

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	332,874,446.78	60.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,338,880.01	3.63
J	金融业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	354,213,326.79	60.30

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告 (生效) 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的范围的相关规定；

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规，中国证监会和中国证券业协会的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的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5%的交易次数为4次，是由于投资组合接受投资者申购后被动增减仓位以及投资组合的投资策略所致。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
2	其中：股票	-	-
3	固定收益投资	138,533,942.45	94.86
4	其中：债券	138,533,942.45	94.86
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他	-	-
10	合计	142,883,334.89	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 权益投资

5.1.2 固定收益投资

5.1.3 资产支持证券

5.1.4 贵金属投资

5.1.5 金融衍生品投资

5.1.6 买入返售金融资产

5.1.7 其他

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.3 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	180206	国电南瑞	240,000	25,101,600.00	28.44
2	180204	国电南瑞	100,000	10,291,000.00	11.66
3	130226	华鲁恒升	83,000	8,263,480.00	9.36
4	130225	华鲁恒升	80,000	7,989,600.00	9.06
5	10160000	华夏安投	70,000	7,028,700.00	7.96

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五名债券投资

5.3.1 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

5.3.2 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

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

5.3.4 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

5.3.5 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

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	600043	爱迪生	244,900	3,238,620.00	0.76
2	601717	晋煤科技	470,200	3,306,500.00	0.76
3	300316	顺鑫农业	763,400	3,263,084.00	0.74
4	601128	常熟银行	504,700	3,199,798.00	0.73
5	000953	贵州茅台	241,900	3,078,980.00	0.72
6	002416	爱施德	513,220	2,981,882.00	0.67
7	600546	康得新材	383,200	2,960,640.00	0.68
8	300026	红日药业	838,500	2,934,750.00	0.67
9	601937	鹏辉能源	228,510	2,889,297.30	0.65
10	300079	汇川技术	979,300	2,877,060.00	0.65

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.4.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.4.2 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

5.4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

5.4.4 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

5.4.5 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

5.5 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股票投资

5.5.1 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股票投资

5.5.2 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股票投资

5.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.5.4 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股票投资

5.5.5 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股票投资

5.6 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资产支持证券投资

5.6.1 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资产支持证券投资

5.6.2 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资产支持证券投资

5.6.3 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资产支持证券投资

5.6.4 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资产支持证券投资

5.6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

代码	名称	持仓量 (买/沽/期权) (万手)	公允价值 (元)	公允价值变动 (元)	风险指标
IF1810	IF1810	-61	-48,900.00	-1,406.00	--
IF1810	IF1810	-63	-60,000.00	-299.00	--
IF1810	IF1810	-63	-60,000.00	-3,944.00	--
IF1810	IF1810	-1	-1,020.00	-81,720.00	--
IF1810	IF1810	-1	-620.00	-81,720.00	--

5.6.6 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资产支持证券投资

5.6.7 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资产支持证券投资

5.6.8 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资产支持证券投资

5.6.9 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资产支持证券投资

5.6.10 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资产支持证券投资

5.7 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贵金属投资

5.7.1 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贵金属投资

5.7.2 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贵金属投资

5.7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.7.4 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贵金属投资

5.8 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权证投资

5.8.1 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权证投资

5.8.2 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权证投资

5.8.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

5.8.4 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权证投资

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.3 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.4 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.4 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明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。如是，还应对其在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的主体

5.11.2 声明本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。如是，还应对其超出基金合同规定的备选股票库的情况

5.11.3 声明本基金投资的前十名债券是否超出基金合同规定的备选债券库。如是，还应对其超出基金合同规定的备选债券库的情况

5.11.4 声明本基金投资的前十名资产支持证券是否超出基金合同规定的备选