

信息披露 Disclosure

（上接A21版）

法人代表:刘惠
联系人:毛林
电话:021-80133597
传真:021-80133413
客服电话:400-808-1016
公司网址:www.fundhaiyin.com
(56)乾道盈泰基金销售有限公司(北京)有限公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
办公地址:北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
法人代表:王兴吉
联系人:宋子琪
传真:010-82067741
客服电话:4000-888-080
公司网址:www.qiandaoyi.com
(57)大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路505号东方统一大厦15楼
法定代表人:袁顺明
联系人:赵明
电话:021-20324069
传真:021-20234199
客服电话:4009822266
网址:www.dtfunds.com
(58)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗珏
电话:021-20613999
联系电话:021-58870011
传真:021-68969616
客服电话:400-700-9695
公司网址:www.ehowbuy.com
(59)东方财富(北京)信息技术有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208法定代表人:吴雪
联系人:徐敏
传真:010)88312877
联系人:段京璐
电话:010)88312877
客服电话:400-001-1566
公司网址:www.yilucaifu.com
(60)珠海盈泰财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:吴煜浩
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89623066
网址:www.yingtail.com
(61)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02/03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02/03室
法人代表:陈飞
联系人:李婧
电话:021-50810687
传真:021-58300279
客服电话:400-025-6569
公司网址:wacaijijin.com
(62)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
联系人:兰敏
电话:021-52975270
联系人:凌秋艳
电话:021-52822063
客服电话:400-166-6788
公司网址:www.66zichan.com
(63)上海利得基金销售有限公司
办公地址:上海浦东新区峨山路1弄611号10号楼12楼
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
法定代表人:李兴春
联系人:陈虹
电话:86-021-50683533
传真:86-021-50683633
客服电话:400-921-7755
网址:http://www.lleadfund.com.cn/
(64)北京铁景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:李超
电话:010-56200948
传真:010-57669671
客服电话:400-893-6885
公司网址:www.qianjin.com
(65)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:4008-205-369
网址:www.jiuyifund.com.cn/
(66)武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:武汉市汉江区中央商务区泛海国际SOHO城(一期)七栋23层1号4号
办公地址:武汉市汉江区中央商务区泛海国际SOHO城(一期)七栋23层1号4号
法人代表:陶捷
联系人:陆峰
电话:027-83863742
传真:027-83862682
客服电话:400-027-9899
公司网址:www.buyifunds.cn
(67)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市余杭区同顺街18号同顺大厦
法定代表人:凌顺平
联系人:董一峰
电话:0571-88911818-8953
传真:0571-88911818-8001
客服电话:4008-773-772
公司网站:www.jljin.com
(68)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法人代表:王廷富
联系人:徐亚丹
电话:021-50712782
传真:021-5071 0161
客服电话:400-821-0203
公司官网:www.520fund.com.cn
(69)杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20F
法人代表:陈刚
联系人:张丽娟
电话:0571-85262700
传真:0571-85269200
客服电话:0571-89915761
公司网址:www.cd121.com
(70)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.com
(71)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
注册地址:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法人代表:程刚
联系人:张旭
电话:010-58160168
传真:010-58160173
客服电话:400-810-5919
公司网址:www.fengfnd.com
(72)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系人:于永健
电话:010-85097570
传真:010-85097308
客服电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
(73)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
法人代表:王伟刚
联系人:王骁骁
电话:010-56251471
传真:010-62860827
客服电话:400-619-0069
公司网址:www.hcjin.com
(74)上海大智慧基金销售有限公司
注册住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人:申健
联系人:宋楠
客服电话:021-20292031
公司网址:https://www.wg.com.cn/
(75)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼9楼
法定代表人:马刚
联系人:周晶
业务传真:021-60818280
客服热线:400-66-96156

公司网址:https://www.tonghuafund.com
(76)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道55号裕景国际B座16层
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张凯伟
联系人:吴艳秋
电话:021-2069-1831
传真:021-2069-1861
客服电话:4008202899
公司网站:www.erichfund.com
(77)北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法人代表:张冠宇
联系人:王亚超
电话:400-819-9868
传真:010-95032880
客服电话:400-819-9868
公司网址:http://www.tdyhfund.com/
(78)北京虹点基金销售有限公司
注册住所:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙楼2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心东门2层
法定代表人:郑敏栋
联系人:姜颖
电话:010- 85643600
客服电话:400-618-0707
公司网址:www.hongdianfund.com
(79)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区安达北路10号5层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
联系人:陈璇
电话:010-53509643
客服电话:4008-980-618
网址:www.htmfund.com
(80)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路3号后沙峪领安富街8号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:李静芳
电话:010-59601366/7167
客服电话:400-818-8000
公司网址:www.mylfund.com
(81)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心19、20楼
办公地址:广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人:胡伏虎
联系人:江虹虹
电话:020-8836999-5408
客服电话:96396
公司网址:www.gzs.com.cn
(82)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区 飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A栋
联系人:余耀飞
电话:021-80358749
传真:021-38509777
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(83)宏信证券有限责任公司
注册地址:中国四川成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
办公地址:中国四川成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉明
联系人:张璇
电话:010-64083792
客服电话:4008-366-366
公司网址:http://www.hx818.com
(84)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:金煜
联系人:陈程程
电话:021-68475888
客服电话:021-962889
公司网址:www.bankofshanghai.com
(85)中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人:李晓鹏
客服电话:96595
公司网址:www.cebbank.com
(86)财通证券股份有限公司
注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:陆建强
联系人:陶志华
电话:86-571-87789160
传真:0571-87818329
客服电话:96336
公司网址:www.ctsec.com
(87)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路969号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
联系人:李笑鸣
电话:021-23219275
客服电话:95553/4008888001
公司网址:www.htsec.com
(88)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山东路12号
办公地址:上海市黄浦区中山东路12号
法定代表人:高国富
联系人:刘信义
电话:86-21-63611226/86-21-61618888
传真:86-21-63203807
客服电话:96528
公司网址:www.spdb.com.cn
(89)国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市梅山路18号
办公地址:安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券
联系人:秦静
电话:0651-62257039
客服电话:96578
公司网址:http://www.gyzq.com.cn
(90)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
传真:0755-33227961
客服电话:4006-788-887
公司网址:www.zlfund.com/www.jmmw.com
(91)有鱼基金销售有限公司
注册地址:上海自由贸易试验区浦东南路2123号3层3B-2655室
办公地址:上海市徐汇区桂平路391号A座五层
法人代表:林峰
联系人:徐海鹏
电话:021-64389188
传真:021-64389188-102
客服电话:400-7676-296
公司网址:www.youyufund.com
(92)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
办公地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
法人代表:沙常明
联系人:丁倩云
电话:01086499427
客服电话:4006206968
公司网址:www.lczq.com
(93)深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
联系人:葛倩倩
座机:0411-66889809
传真:0411-66889827
客服电话:4007-903-688
公司网址:www.tundying.com
(94)沈阳腾赢投资顾问有限公司
注册地址:辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601
办公地址:上海市青浦区158号城建大厦5楼
法定代表人:朱荣晖
联系人:钱金菊
电话:021-5109-1679
传真:021-51091674
客服电话:400-003-5811
公司网址:https://www.jinjiwo.com/
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:021-5887 2936
联系人:郑奕菊
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海耀泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:021-5115 0298
传真:021-5115 0398
联系人:刘佳
经办律师:刘佳、范佳斐
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
执行事务合伙人:毛敏平
住所:上海市浦东新区东长安街1号 东方广场东塔楼安永大楼(四楼)16 层
办公地址:上海市世纪大道100 号环球金融中心50 楼
邮政编码:200120
公司电话:(021) 22288888
公司传真:(021) 22280000
签字会计师:蒋燕华、蔡玉芝

业务联系人:蒋燕华
基金名称
财通多策略福鑫定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
5.基金的类型
混合型
6.基金的投资目标
本基金将灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中的投资机会,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
7.投资范围
本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:封闭期内,本基金投资于股票资产的比例为0-100%;开放期内,投资于股票资产的比例为0-95%;开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。
8.投资策略
1、资产配置策略
本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素,通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析,对各类资产品种的未来发展趋势进行研判,根据判断结果进行资产配置及组合的构建,确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态调整各类资产之间的投资比例,在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。
2、股票投资策略
本基金在价值投资理念的基础上,建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系,并根据市场环境的变化进行针对性运用。具体投资过程中,本基金遵循自上而下的成长策略,对上市公司进行基本面研究,精选股票;通过自上而下的主题策略,研究行业轮动与市场热点,精选行业;通过动量策略进行股票操作层面的动态调整,捕捉市场动量效应驱动的投资机会;通过定向增发策略把握上市公司定向增发事件关联的投资机会,选择基本面良好安全边际优势的定增企业。通过以上多种策略的综合应用,本基金建立基金投资组合,并根据宏观经济状况、公司基本面变化等因素进行动态调整。
(1)成长策略
本基金对成长型公司的投资以新兴产业、处于周期性景气上升阶段的热点行业以及持续增长的传统行业为重点,并精选其中行业代表性高、潜在成长性好、估值具有吸引力的个股进行投资。对于新兴产业,在对产业结构演变趋势进行深入研究和分析的基础上,准确把握新兴产业的发展方向,重点投资体现行业发展方向、拥有核心技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式的公司;对于热点产业,依据对行业景气变化趋势的研究,结合投资增长率等辅助判断指标,提前发现景气度进入上升周期的行业,重点投资热点行业中景气敏感度高;对于传统产业,主要关注产业增长的持续性、企业的竞争优势、发展战略以及潜在发展空间,重点投资具有清晰商业模式、增长具有可持续性且不可复制性的公司。
(2)主题策略
本基金对主题策略实施过程中的制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘潜在的投资主题,并选择那些受惠于投资主题的公司进行投资。首先,从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发,分析经济结构、产业结构或企业商业模式变化的根本性驱动力以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素,从而前瞻性地发掘经济发展过程中的主题板块;其次,通过对投资主题的全面分析和评估,明确投资主题所对应的主题行业或主题板块,从而确定受惠于相关主题的公司,依据企业对投资主题的敏感程度、反应速度以及市场水平等指标,精选个股;再次,通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化,不断发掘和研究新的投资主题,并对主题投资方向做出适时调整,从而准确把握新旧投资主题的转换时机,充分分享不同投资主题兴起所带来的投资机会。
(3)定向增发策略
定向增发是指上市公司向特定投资者(包括大股东、机构投资者、自然人等)非公开发行的股票融资方式。本基金将对进行非公开发行的上市公司进行基本面分析,结合市场未来走势进行判断,从战略高度参考参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平,积极参与风险较低的定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后,本基金将根据对股票内在投资价值成长性判断,结合股票市场环境的分析,选择适当的时机卖出。
(4)动量策略
动量策略是指市场在一定时期内可呈现“强者恒强”的特征,通过买入过去一段时间强势股以获得超越市场平均水平收益。本基金将综合分析个股股票的市场价格动量特征,分析指标包括个股股票的价格累计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率,选择动量特征明显和价格趋势较强的个股纳入投资组合,作为本基金的辅助投资策略。
9.固定收益投资策略
固定收益投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极型投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
(1)利率预期策略
本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略,如子弹型组合、哑铃型组合或者梯型组合等。
(2)个券选择策略
个券选择层面,对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析,进行个券选择。财务分析方面,以企业财务报表为依据,对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行分析;非财务分析方面(包括管理能力、市场地位和发展前景等指标)则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。
(3)时机策略
1.价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性,建立债券的估值模型,对当日无交易的债券计算理论价值,买进价格低于价值的债券;相反,卖出价格高于价值的债券。
2.市场策略。当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对较高的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下降,进而获得资本利得收益。
3.息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。
4.利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析,对利差水平的未来走势做出判断,从而进行相应的操作。当预期利差水平缩小,买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当预期利差水平扩大时,买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。
5.权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资。权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标,选择权证的买入和卖出时机,追求在风险控制的前提下实现稳健的超额收益。
6.股指期货投资策略
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。
7.资产支持证券投资策略
资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。
九、业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
本基金选择该业绩基准,是基于以下因素:
(1)沪深300指数和上证国债指数编制方法合理、透明;
(2)沪深300指数和上证国债指数编制和发布有一定的历史,有较高的知名度和市场影响力;
(3)具有市场覆盖率,不易被操纵;
(4)本基金的股票、债券和现金比例,选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。
沪深300指数由中证指数有限公司编制和计算。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。关于指数值和成分股名单的所有知识产权归属中证指数有限公司。
上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证指数的所有版权归上海证券交易所所有。
如果今后法律法规发生变化,或者指数编制机构调整或停止上述指数的发布,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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,基金管理人可以在履行维护投资者合法权益的原则下,在与基金托管人协商一致,并报监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。
十、风险收益特征
本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金产品,属于中高风险、中高收益的基金产品。
十一、基金投资组合报告
基金管理人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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。
本报告财务数据未经审计,本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日。
1 报告期末基金资产组合情况
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
2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合
2.3 报告期末按行业分类的境外股票投资组合
2.4 报告期末按行业分类的衍生品投资情况
2.5 报告期末按行业分类的资产支持证券投资情况
2.6 报告期末按行业分类的债券投资组合
2.7 报告期末按行业分类的债券回购情况
2.8 报告期末按行业分类的货币市场基金投资情况
2.9 报告期末按行业分类的其他资产投资情况
2.10 报告期末按行业分类的现金及银行存款
2.11 报告期末按行业分类的公允价值变动损益
2.12 报告期末按行业分类的其他资产
2.13 报告期末按行业分类的其他负债
2.14 报告期末按行业分类的其他资产
2.15 报告期末按行业分类的其他负债
2.16 报告期末按行业分类的其他资产
2.17 报告期末按行业分类的其他负债
2.18 报告期末按行业分类的其他资产
2.19 报告期末按行业分类的其他负债
2.20 报告期末按行业分类的其他资产
2.21 报告期末按行业分类的其他负债
2.22 报告期末按行业分类的其他资产
2.23 报告期末按行业分类的其他负债
2.24 报告期末按行业分类的其他资产
2.25 报告期末按行业分类的其他负债
2.26 报告期末按行业分类的其他资产
2.27 报告期末按行业分类的其他负债
2.28 报告期末按行业分类的其他资产
2.29 报告期末按行业分类的其他负债
2.30 报告期末按行业分类的其他资产
2.31 报告期末按行业分类的其他负债
2.32 报告期末按行业分类的其他资产
2.33 报告期末按行业分类的其他负债
2.34 报告期末按行业分类的其他资产
2.35 报告期末按行业分类的其他负债
2.36 报告期末按行业分类的其他资产
2.37 报告期末按行业分类的其他负债
2.38 报告期末按行业分类的其他资产
2.39 报告期末按行业分类的其他负债
2.40 报告期末按行业分类的其他资产
2.41 报告期末按行业分类的其他负债
2.42 报告期末按行业分类的其他资产
2.43 报告期末按行业分类的其他负债
2.44 报告期末按行业分类的其他资产
2.45 报告期末按行业分类的其他负债
2.46 报告期末按行业分类的其他资产
2.47 报告期末按行业分类的其他负债
2.48 报告期末按行业分类的其他资产
2.49 报告期末按行业分类的其他负债
2.50 报告期末按行业分类的其他资产
2.51 报告期末按行业分类的其他负债
2.52 报告期末按行业分类的其他资产
2.53 报告期末按行业分类的其他负债
2.54 报告期末按行业分类的其他资产
2.55 报告期末按行业分类的其他负债
2.56 报告期末按行业分类的其他资产
2.57 报告期末按行业分类的其他负债
2.58 报告期末按行业分类的其他资产
2.59 报告期末按行业分类的其他负债
2.60 报告期末按行业分类的其他资产
2.61 报告期末按行业分类的其他负债
2.62 报告期末按行业分类的其他资产
2.63 报告期末按行业分类的其他负债
2.64 报告期末按行业分类的其他资产
2.65 报告期末按行业分类的其他负债
2.66 报告期末按行业分类的其他资产
2.67 报告期末按行业分类的其他负债
2.68 报告期末按行业分类的其他资产
2.69 报告期末按行业分类的其他负债
2.70 报告期末按行业分类的其他资产
2.71 报告期末按行业分类的其他负债
2.72 报告期末按行业分类的其他资产
2.73 报告期末按行业分类的其他负债
2.74 报告期末按行业分类的其他资产
2.75 报告期末按行业分类的其他负债
2.76 报告期末按行业分类的其他资产
2.77 报告期末按行业分类的其他负债
2.78 报告期末按行业分类的其他资产
2.79 报告期末按行业分类的其他负债
2.80 报告期末按行业分类的其他资产
2.81 报告期末按行业分类的其他负债
2.82 报告期末按行业分类的其他资产
2.83 报告期末按行业分类的其他负债
2.84 报告期末按行业分类的其他资产
2.85 报告期末按行业分类的其他负债
2.86 报告期末按行业分类的其他资产
2.87 报告期末按行业分类的其他负债
2.88 报告期末按行业分类的其他资产
2.89 报告期末按行业分类的其他负债
2.90 报告期末按行业分类的其他资产
2.91 报告期末按行业分类的其他负债
2.92 报告期末按行业分类的其他资产
2.93 报告期末按行业分类的其他负债
2.94 报告期末按行业分类的其他资产
2.95 报告期末按行业分类的其他负债
2.96 报告期末按行业分类的其他资产
2.97 报告期末按行业分类的其他负债
2.98 报告期末按行业分类的其他资产
2.99 报告期末按行业分类的其他负债
3 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
3.1 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
3.2 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
3.3 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
3.4 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
3.5 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名债券回购投资明细
3.6 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名货币市场基金投资明细
3.7 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.8 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.9 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.10 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.11 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.12 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.13 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.14 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.15 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.16 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.17 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.18 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.19 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.20 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.21 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.22 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.23 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.24 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.25 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.26 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.27 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.28 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.29 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.30 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.31 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.32 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.33 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.34 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.35 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.36 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.37 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.38 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.39 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.40 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.41 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.42 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.43 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.44 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.45 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.46 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.47 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.48 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.49 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.50 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.51 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.52 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.53 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.54 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.55 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.56 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.57 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.58 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.59 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.60 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.61 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.62 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.63 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.64 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.65 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.66 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.67 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.68 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.69 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.70 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.71 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.72 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.73 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.74 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.75 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.76 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.77 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.78 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.79 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.80 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.81 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.82 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.83 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.84 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.85 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.86 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.87 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.88 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.89 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.90 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.91 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.92 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.93 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.94 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.95 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.96 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.97 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.98 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.99 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.100 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.101 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.102 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.103 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.104 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.105 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.106 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.107 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.108 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.109 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.110 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.111 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.112 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.113 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.114 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.115 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.116 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.117 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.118 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.119 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.120 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.121 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.122 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.123 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.124 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.125 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.126 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.127 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.128 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.129 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.130 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.131 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.132 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他负债投资明细
3.133 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细
3.134 报告期末按公允价值公允价值基金资产净值比例大小排序的前五