

嘉实新添辉定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21日
重要提示
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...

3.2.2 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
图:嘉实新添辉定期混合基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

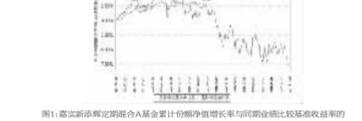


图1:嘉实新添辉定期混合基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年10月20日至2018年12月31日)

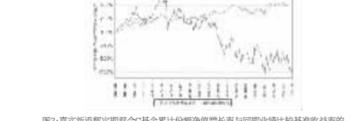


图2:嘉实新添辉定期混合基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年10月20日至2018年12月31日)

注:本基金合同的投资范围和投资限制,本基金基金合同生效日6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二)“投资组合范围”(四)“投资限制”的有关约定。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年10月31日-2018年12月31日, 报告期末2018年10月31日-2018年12月31日. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.期末可供基金份额持有人分配的利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 本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的比较
图:嘉实新添辉定期混合基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金合同的投资范围和投资限制,本基金基金合同生效日6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二)“投资组合范围”(四)“投资限制”的有关约定。

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时间 证券从业年限 说明

Table listing fund managers with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明. Includes 曲杨 and 刘宁.

注:(1)基金经理的任职日期是指本基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金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了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实新添辉定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,本基金运作

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》和公司内部公平交易制度,严格执行投资决策流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易单元内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所有投资者的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易,且同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%,合计2次,均为旗下组合与股票账户发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2018年四季度,基本面数据进一步分化,地产销售开局超预期,房地产土地购置意愿下降,叠加贸易摩擦的不确定性对国内制造业预期的影响,带动整体经济预期走弱;金融数据方面,社融大幅超预期,在稳增长预期的背景下,中长期信贷增长依然偏强。10月17日降准,货币市场流动性改善,政府债发行节奏加快,市场预期流动性宽松,国债收益率和固定收益资产的相关政策也在不断出台,但政策宽松可能仍有限制。

市场方面,四季度整体收益大幅下行,利率债下行40-60bp,曲线整体扁平化,信用债下行10-50bp,短债品种下行幅度较大,2-4年期下行幅度较大;中高等级品种信用利差基本持平,但在一系列宽信用品种央行呵护下,中短久期债种估值仍保持韧性。

权益方面,四季度指数整体下跌10%-15%左右,板块之间分化不明显,沪深300,上证50,中证100等指数分别下跌12.46%,12.03%和3.18%,主要受到全球基本面共振下行、盈利预期普遍悲观化影响,10月下旬至12月初政策发力,预期调整预期对情绪的提振下,市场确有企稳,但难以改变趋势。

转债方面,四季度转债指数下跌1.62%,转债收益率下行和信用风险溢价波动带动转债转债转股,但四季度转债市场整体表现尚可,赎回和转股率整体保持平稳。

报告期内,组合规模大幅增长,同时受到全球宏观预期以及国内流动性宽松影响,增持高景气行业水平,同时基金定投策略持续执行,并低位加仓与权益仓位,新增参与转债行情。

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布
截至本报告期末本基金投资组合资产配置情况:本报告期末基金份额净值增长率为0.63%,业绩比较基准收益率为-4.99%。

4.6 报告期内基金持有人或报告期末资产配置变动情况
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资
5.1.2 基金投资

Table showing portfolio composition with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 权益投资, 基金投资, 债券投资, 其他资产, 合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

嘉实新添瑞灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

度指导意义)和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易单元内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所有投资者的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易,且同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%,合计3次,均为旗下组合与股票账户发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,资本市场体现出风险偏好进一步下行的特点,全球经济持续加剧,中美贸易摩擦一波三折,元首通话及G20会议出现边际好转迹象;国内基本面向下行态势明显,经济数据全面下滑,土地房产购置意愿下降,房地产销售出现回落,贸易及其对民企和制造业影响不确定性因素,带动宏观经济预期恶化,政府稳增长诉求上升,降准、创设TMLF,推出风险缓释工具和稳定宏观预期,维持资金面宽松的相关政策也在不断出台,但效果有限,社会融资规模依然继续下行,三季度较为普遍的通胀担忧随着油价下跌,需求不足等因素消退。

债券市场报告期内维持强势走势,季初在降准降准资金宽松,地方债发行高峰已过的推动下收益走低,随后经济数据下行强化经济走弱预期,收益再度大幅下降,四季度政策组合拳特别是十二月份地产放松苗头出现了10bp以上级别的调整,随后由于地产放松苗头随着油价下跌,需求不足等因素消退。

转债市场报告期内维持强势走势,季初在降准降准资金宽松,地方债发行高峰已过的推动下收益走低,随后经济数据下行强化经济走弱预期,收益再度大幅下降,四季度政策组合拳特别是十二月份地产放松苗头出现了10bp以上级别的调整,随后由于地产放松苗头随着油价下跌,需求不足等因素消退。

权益市场报告期内维持强势走势,季初在降准降准资金宽松,地方债发行高峰已过的推动下收益走低,随后经济数据下行强化经济走弱预期,收益再度大幅下降,四季度政策组合拳特别是十二月份地产放松苗头出现了10bp以上级别的调整,随后由于地产放松苗头随着油价下跌,需求不足等因素消退。

报告期内,组合规模大幅增长,同时受到全球宏观预期以及国内流动性宽松影响,增持高景气行业水平,同时基金定投策略持续执行,并低位加仓与权益仓位,新增参与转债行情。

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布
截至本报告期末本基金投资组合资产配置情况:本报告期末基金份额净值增长率为2.47%,业绩比较基准收益率为-4.99%。

4.6 报告期内基金持有人或报告期末资产配置变动情况
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资
5.1.2 基金投资

Table showing portfolio composition with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 权益投资, 基金投资, 债券投资, 其他资产, 合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

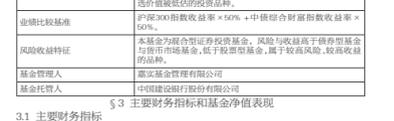
5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21日
重要提示
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...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年10月31日-2018年12月31日, 报告期末2018年10月31日-2018年12月31日. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.期末可供基金份额持有人分配的利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 本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的比较
图:嘉实新添瑞混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金合同的投资范围和投资限制,本基金基金合同生效日6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二)“投资组合范围”(四)“投资限制”的有关约定。

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时间 证券从业年限 说明

Table listing fund managers with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明. Includes 曲杨 and 刘宁.

注:(1)基金经理的任职日期是指本基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金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了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实新添瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,本基金运作

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》和公司内部公平交易制度,严格执行投资决策流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易单元内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所有投资者的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易,且同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%,合计2次,均为旗下组合与股票账户发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,资本市场体现出风险偏好进一步下行的特点,全球经济持续加剧,中美贸易摩擦一波三折,元首通话及G20会议出现边际好转迹象;国内基本面向下行态势明显,经济数据全面下滑,土地房产购置意愿下降,房地产销售出现回落,贸易及其对民企和制造业影响不确定性因素,带动宏观经济预期恶化,政府稳增长诉求上升,降准、创设TMLF,推出风险缓释工具和稳定宏观预期,维持资金面宽松的相关政策也在不断出台,但效果有限,社会融资规模依然继续下行,三季度较为普遍的通胀担忧随着油价下跌,需求不足等因素消退。

债券市场报告期内维持强势走势,季初在降准降准资金宽松,地方债发行高峰已过的推动下收益走低,随后经济数据下行强化经济走弱预期,收益再度大幅下降,四季度政策组合拳特别是十二月份地产放松苗头出现了10bp以上级别的调整,随后由于地产放松苗头随着油价下跌,需求不足等因素消退。

转债市场报告期内维持强势走势,季初在降准降准资金宽松,地方债发行高峰已过的推动下收益走低,随后经济数据下行强化经济走弱预期,收益再度大幅下降,四季度政策组合拳特别是十二月份地产放松苗头出现了10bp以上级别的调整,随后由于地产放松苗头随着油价下跌,需求不足等因素消退。

权益市场报告期内维持强势走势,季初在降准降准资金宽松,地方债发行高峰已过的推动下收益走低,随后经济数据下行强化经济走弱预期,收益再度大幅下降,四季度政策组合拳特别是十二月份地产放松苗头出现了10bp以上级别的调整,随后由于地产放松苗头随着油价下跌,需求不足等因素消退。

报告期内,组合规模大幅增长,同时受到全球宏观预期以及国内流动性宽松影响,增持高景气行业水平,同时基金定投策略持续执行,并低位加仓与权益仓位,新增参与转债行情。

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布
截至本报告期末本基金投资组合资产配置情况:本报告期末基金份额净值增长率为2.47%,业绩比较基准收益率为-4.99%。

4.6 报告期内基金持有人或报告期末资产配置变动情况
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资
5.1.2 基金投资

Table showing portfolio composition with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 权益投资, 基金投资, 债券投资, 其他资产, 合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责,无处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 其他资产, 合计.

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有股票。

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
报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。

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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。

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