

兴全精选混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22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,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。
基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。
本报告自2018年10月1日起至12月31日止。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, etc. and 基金管理人, 基金托管人.

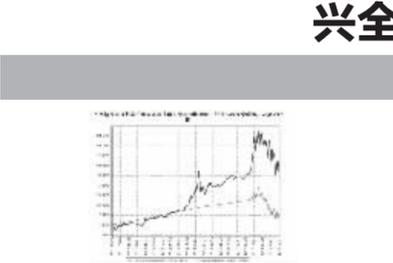
注:兴全精选混合型证券投资基金自兴全保本混合型证券投资基金第一个保本周期期满后转入而来,由于兴全保本在第二个保本周期期满后不再符合保本基金条件,根据《兴全保本混合型证券投资基金合同》的约定,自2017年9月6日起兴全保本转型为非保本的混合型基金,名称相应变更为“兴全精选混合型证券投资基金”。《兴全精选混合型证券投资基金基金合同》及《兴全精选混合型证券投资基金托管协议》自该日起生效。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期:2018年10月1日至2018年12月31日. Includes 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

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认购或交易的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平低于所列数字。
3.2基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.

注:1.本基金自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。



注:1.净值表现数据截至到2018年12月31日。
2.本基金由兴全保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转入而来,按照《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,建仓期为2011年8月3日至2012年2月2日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.由于兴全保本在第二个保本周期期满后不再符合保本基金条件,根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,自2017年9月6日起兴全保本转型为非保本的混合型基金,名称相应变更为“兴全精选混合型证券投资基金”,业绩比较基准自该日起变更为80%×沪深300指数收益率+20%×中证国债指数收益率。
3.3 其他指标
无。

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明.

注:1.职务指截止报告期末的职务(报告期末仍在任的)或离任前的职务(报告期内离任的)。
2.任职日期指基金合同生效之日(基金成立时担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理);离任日期指公司作出解聘决定之日。
3.“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规的情况说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全精选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,取信于市场,取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金管理人投资运作符合法律法规及基金合同的规定,无违法违规,未履行合同承诺或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
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不问投资组合的整体收益差异进行统计,从不同的角度分析差异的来源,考察是否存在非公平的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易或成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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
5.1.3 债券投资
5.1.4 其他资产

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

Table with 5 columns: 代码, 行业名称, 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投资股票投资组合
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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.7 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

兴全可转债混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22日

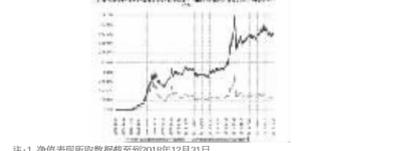
重要提示
基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2018年10月1日起至12月31日止。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, etc. and 基金管理人, 基金托管人.

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认购或交易的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平低于所列数字。
3.2基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.

注:1.本基金自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。



注:1.净值表现数据截至到2018年12月31日。

2.按照《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2004年5月11日至2004年11月10日。建仓期结束时本基金各项资产配置符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.

注:1.本基金自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。

4.2 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规的情况说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不问投资组合的整体收益差异进行统计,从不同的角度分析差异的来源,考察是否存在非公平的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易或成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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
5.1.3 债券投资
5.1.4 其他资产

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

Table with 5 columns: 代码, 行业名称, 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投资股票投资组合
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

Table with 5 columns: 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(%)

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.6 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.6 报告期末前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.7 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.2 本基金股指期货投资的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
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 本报告期末国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资的投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
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未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)

2018年第四季度报告

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22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,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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。
本报告自2018年10月1日起至12月31日止。

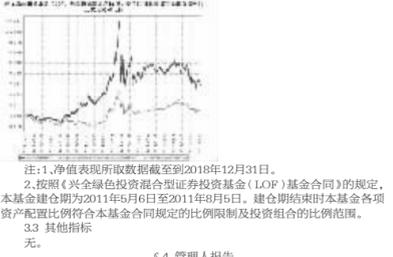
Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, etc. and 基金管理人, 基金托管人.

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认购或交易的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平低于所列数字。
3.2基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.

注:1.本基金自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。

4.2 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规的情况说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责,取信于市场,取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金管理人投资运作符合法律法规及基金合同的规定,无违法违规,未履行合同承诺或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
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不问投资组合的整体收益差异进行统计,从不同的角度分析差异的来源,考察是否存在非公平的情况。



注:1.净值表现数据截至到2018年12月31日。
2.按照《兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2011年6月6日至2011年8月5日。建仓期结束时本基金各项资产配置符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.3 其他指标
无。
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 证券从业年限 说明

注:1.职务指截止报告期末的职务(报告期末仍在任的)或离任前的职务(报告期内离任的)。
2.任职日期指基金合同生效之日(基金成立时担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理);离任日期指公司作出解聘决定之日。
3.“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规的情况说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责,取信于市场,取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金管理人投资运作符合法律法规及基金合同的规定,无违法违规,未履行合同承诺或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
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不问投资组合的整体收益差异进行统计,从不同的角度分析差异的来源,考察是否存在非公平的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易或成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
今年4季度,A股整体震荡下行,跌势趋弱,期间WIND全A及创业板跌幅均超过10%,市场情绪逐渐为逆周期调整具有相对收益。
回顾4季度的操作,本基金从国家宏观及产业政策、经济周期趋势、企业长期价值、个股调整结构,增持了部分行业向好以及近期行业趋势,维持部分长期空间确定性竞争优势稳定仓位,期间净值表现良好。在此基础上扎实研究产业发展和企业业绩,逐步形成一些核心投资标的,相信这些标的会在2019年给基金贡献扎实业绩。

4.5 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.2477元;本报告期基金份额净值增长率为-5.10%,业绩比较基准收益率为-9.35%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
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
5.1.3 债券投资
5.1.4 其他资产

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

Table with 5 columns: 代码, 行业名称, 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投资股票投资组合
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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.7 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.2 本基金股指期货投资的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
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 本报告期末国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资的投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
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未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

5.11.5 报告期末前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.6 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.7 本基金投资的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.11.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.11.8.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。

5.11.8.2 本基金股指期货投资的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.9.1 本报告期末国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货。

5.11.9.3 本期国债期货投资的投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10 投资组合报告附注
5.11.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

5.11.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.10.6 本基金投资的前十名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11.10.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.11.10.7.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。

5.11.10.7.2 本基金股指期货投资的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.10.8.1 本报告期末国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.8.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货。

5.11.10.8.3 本期国债期货投资的投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9 投资组合报告附注
5.11.10.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.10.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.10.9.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.10.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

5.11.10.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.10.9.6 本基金投资的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11.10.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.11.10.9.7.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。

5.11.10.9.7.2 本基金股指期货投资的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.10.9.8.1 本报告期末国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.8.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货。

5.11.10.9.8.3 本期国债期货投资的投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.9 投资组合报告附注
5.11.10.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.10.9.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.10.9.9.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.10.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

5.11.10.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.10.9.9.6 本基金投资的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11.10.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.11.10.9.9.7.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。

5.11.10.9.9.7.2 本基金股指期货投资的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.10.9.9.8.1 本报告期末国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.9.8.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货。

5.11.10.9.9.8.3 本期国债期货投资的投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.9.9 投资组合报告附注
5.11.10.9.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.10.9.9.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.10.9.9.9.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.10.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

5.11.10.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.10.9.9.9.6 本基金投资的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11.10.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.11.10.9.9.9.7.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。

5.11.10.9.9.9.7.2 本基金股指期货投资的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.10.9.9.9.8.1 本报告期末国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.9.9.8.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货。

5.11.10.9.9.9.8.3 本期国债期货投资的投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
5.11.10.9.9.9.9 投资组合报告附注
5.11.10.9.9.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.10.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.10.9.9.9.9.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.10.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券如下:

Table with 5 columns: 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(%)

5.11.10.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.10.9.9.9.9.6 本基金投资的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11.10.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.11.10.9.9.9.9.7.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有股指期货。