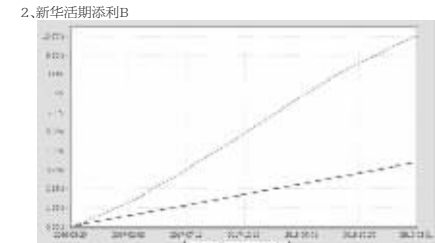
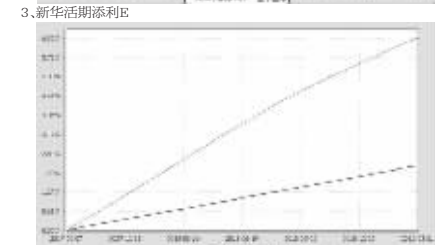


新华活期添利货币市场基金

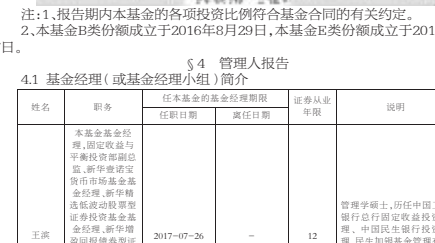
2019年第一季度报告



2、新华活期添利B



3、新华活期添利B



注: 1、报告期内本基金的各项资产净值比例符合基金合同的约定。

2、本基金B类份额成立于2016年8月29日,本基金A类份额成立于2017年9月7日。

注: 1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。2、证券从业的含义遵从行业协会《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
 本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华活期添利货币市场基金的管理人,按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华活期添利货币市场基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易原则的执行情况
 根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》,制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理制度,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且自动交易系统公平交易模块,根据合同制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部报投资总监、督察长、金融工程部监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会会议,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易、投资组合经理以该投资组合的名义向交易所下达投资指令、交易部向银行间市场或交易所对手询价、成交确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平交易的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
 本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与收益分配并开竞价同日反向交易成交较少的单边成交数量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
 2019年一季度经济基本面的悲观预期有所修复,金融条件全面改善,债市行情由去年收益曲线下行开始步入大幅反弹。国内方面,基本面下行趋势延续,但经济数据企稳,减税、促消费等一系列“稳增长”政策合力不断显现,市场对信用债的预期增强。国外方面,欧美等主要经济体都出现不同程度的下滑,美联储加息暂停,外债利率压力减少,人民币汇率稳中趋升,宽松政策掣肘减少。货币政策上,央行继续保持流动性充裕水平,资金利率低位运行,中美贸易问题经过多次谈判有所缓和,市场风险偏好显著提升,债市避险情绪逐步缓解。1年期国债在2.31%至2.50%区间震荡,10年期国债在3.06%至3.21%的区间震荡。信用债方面,违约事件继续呈点状爆发,市场需求集中在高等级债种,AAA评级中短久期信用债维持历史低位。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
 本基金本报告期A类(000603)基金份额净值收益率为0.7143%,同期业绩比较基准收益率为0.5321%,B类(000284)基金份额净值收益率为0.741%,同期业绩比较基准收益率为0.3334%,E类(005148)基金份额净值收益率为0.7641%,同期业绩比较基准收益率为0.3334%。

展望二季度,宏观经济维持低位盘整,但大幅上行下行风险相对较低,但经济数据企稳,减税、促消费等一系列“稳增长”政策合力不断显现,市场对信用债的预期增强。国外方面,欧美等主要经济体都出现不同程度的下滑,美联储加息暂停,外债利率压力减少,人民币汇率稳中趋升,宽松政策掣肘减少。货币政策上,央行继续保持流动性充裕水平,资金利率低位运行,中美贸易问题经过多次谈判有所缓和,市场风险偏好显著提升,债市避险情绪逐步缓解。1年期国债在2.31%至2.50%区间震荡,10年期国债在3.06%至3.21%的区间震荡。信用债方面,违约事件继续呈点状爆发,市场需求集中在高等级债种,AAA评级中短久期信用债维持历史低位。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 展望二季度,宏观经济维持低位盘整,但大幅上行下行风险相对较低,但经济数据企稳,减税、促消费等一系列“稳增长”政策合力不断显现,市场对信用债的预期增强。国外方面,欧美等主要经济体都出现不同程度的下滑,美联储加息暂停,外债利率压力减少,人民币汇率稳中趋升,宽松政策掣肘减少。货币政策上,央行继续保持流动性充裕水平,资金利率低位运行,中美贸易问题经过多次谈判有所缓和,市场风险偏好显著提升,债市避险情绪逐步缓解。1年期国债在2.31%至2.50%区间震荡,10年期国债在3.06%至3.21%的区间震荡。信用债方面,违约事件继续呈点状爆发,市场需求集中在高等级债种,AAA评级中短久期信用债维持历史低位。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
 本基金报告期末未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况
 序号 项目 金额(元) 占基金总资产比例(%)
 1 权益投资 - -
 2 固定收益投资 6,573,884,201.78 62.48
 3 货币资金 6,573,884,201.78 62.48
 4 资产支持证券 - -
 5 买入返售金融资产 919,158,685.08 8.74
 6 其他资产 - -
 7 银行存款和结算备付金合计 3,264,108,764.46 31.17
 8 其他金融资产 64,093,662.35 0.62
 9 合计 10,521,770,622.75 100.00

5.2 报告期末债券回购融资情况
 序号 项目 占基金资产净值比例(%)
 1 报告期内债券回购融资余额 8.28
 2 其中:买断式回购融资 - -
 序号 项目 金额 占基金资产净值比例(%)
 1 报告期末债券回购融资余额 627,499,364.25 6.35
 2 其中:买断式回购融资 - -

5.3 投资组合报告
 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 10176062 17号北新 50,000 5,246,500.00 7.87
 2 10145203 14号东材 50,000 5,102,000.00 7.68
 3 10180343 18号东材 50,000 5,029,500.00 7.55
 4 10180315 18号东材 50,000 5,028,500.00 7.54
 5 10180174 18号东材 50,000 5,028,500.00 7.54

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十名债券投资明细
 序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
 1 0016819 恒利转债 9,760 2,824,703.00 9.86
 2 000651 格力转债 111,500 2,520,915.00 8.67
 3 000208 格力转债 32,000 4,509,400.00 9.57
 4 000048 格力转债 3,000 4,080,000.00 4.74
 5 000005 格力转债 134,000 3,950,000.00 4.83
 6 001318 中国交建 31,500 3,970,650.00 4.73
 7 000776 中国交建 174,000 3,506,100.00 4.17
 8 000058 三德转债 34,300 3,258,500.00 3.88
 9 000687 三德转债 110,000 3,202,100.00 3.81
 合计 79,676,273.61 94.87

5.3.3 其他资产构成
 序号 项目 金额(元)
 1 存出保证金 -
 2 应收证券清算款 -
 3 应收利息 464,278.41
 4 应收股利 -
 5 应收申购款 992.51
 6 其他应收款 -
 7 待摊费用 -
 8 其他 -
 9 合计 464,109.38

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十名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

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贵金属投资明细
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.7 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.8 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.11 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.12 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.13 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.14 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.15 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.16 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.17 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.18 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.19 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.20 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.21 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.22 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.23 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.24 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.25 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.26 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.27 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.28 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.29 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.30 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.31 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.32 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.33 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.34 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.35 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.36 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.37 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.38 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.39 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.40 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.41 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.42 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.43 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.44 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.45 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.46 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.47 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.48 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.49 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.50 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.51 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.52 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.53 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.54 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.55 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.56 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.57 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.58 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.59 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.60 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.61 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.62 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.63 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.64 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.65 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.66 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.67 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.68 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.69 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.70 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.71 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.72 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.73 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.74 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.75 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.76 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.77 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.78 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.79 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.80 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.81 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.82 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.83 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.84 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.85 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.86 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.87 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.88 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.89 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.90 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.91 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.92 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.93 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.94 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.95 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.96 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.97 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.98 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.99 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.100 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.101 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.102 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.103 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.104 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.105 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.106 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.107 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.108 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.109 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.110 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.111 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.112 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.3.113 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商品期货投资明细
 本基金本报告期末未持有商品期货。

5.3.114 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资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.115 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
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.116 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指期货投资明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.117 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国债期货投资明细
 本基金本报告期末未持有国债期货。