

海富通货币市场证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

重要提示
基金管理人的董事会及董事承诺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2019年4月19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,更没有任何保本或变相保本担保的承诺。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

| 基金名称 | 海富通货币 |
|------------|--------------------|
| 基金代码 | 519003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年11月16日 |
| 报告期末基金份额总额 | 16,301,107,149.89份 |

投资目标
在符合法律法规的前提下,追求超过业绩比较基准的长期投资回报。

投资策略
根据宏观经济指标(主要包括:利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、政府收支状况、国际收支状况、人民币汇率和利率政策)和(长/中/短)债的分布,根据债券资产的内部收益率(主要包括:平均久期、交易成本、流动性、信用评级)等因素,进行资产配置,调整债券资产的行业配置,并选择流动性好、信用评级高、期限结构合理的债券品种。

业绩比较基准
报告期内业绩比较基准为:一年期定期存款利率+0.35%。

风险收益特征
本基金为货币市场基金,属于低风险、低收益的证券投资基金品种。

基金管理人 海富通基金管理有限公司
基金托管人 中国银行股份有限公司

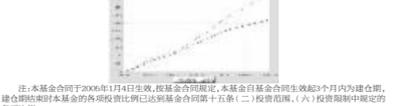
5.3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | 报告期(2019年1月1日至2019年3月31日) | 本报告期末 | 上年度末 |
|---------------|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 1.本期已实现收益 | 1,726,465.69 | 156,864,884.20 | 156,864,884.20 |
| 2.本期利润 | 1,726,465.69 | 156,864,884.20 | 156,864,884.20 |
| 3.本期基金份额净值增长率 | 246.1202,1044% | 16,066,567,620.01% | 16,066,567,620.01% |

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

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准收益率 | ①-③ | ②-④ |
|-------|---------|---------|-----------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6359% | 0.0006% | 0.0787% | 0.0006% | 0.0006% |

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
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年11月16日至2019年3月31日)



注:本基金合同于2009年11月16日生效,按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

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 |
|----|------|-------------|--------|--|
| 姜祥 | 基金经理 | 2017-11-15 | 16年 | 硕士,持有基金从业资格,曾任招商证券研究员,从事证券投资研究工作,2017年11月加入海富通基金管理有限公司,担任基金经理职务。 |

4.2 基金经理(或基金经理小组)变更情况说明
报告期内,未发现本基金基金经理存在不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

4.3 公平交易制度的执行情况
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》的具体要求,持续完善公平交易业务制度和公平交易机制。制度和流程覆盖了境内、境外、沪港、深港、债券、期货、期权、权证、股指期货、大宗商品等投资品种,并建立了公平交易监测系统,对投资交易行为进行实时监控,确保在获得投资收益、投资建议和买卖决策等方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易和利益输送的异常交易。

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 2,689,930,392.13 | 15.71 |
| 3 | 银行存款 | 2,689,930,392.13 | 15.71 |
| 4 | 其他资产 | 3,744,000,576.02 | 21.86 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 农林牧渔 | - | - |
| 2 | 医药生物 | - | - |
| 3 | 信息技术 | - | - |
| 4 | 金融 | - | - |
| 5 | 其他 | - | - |

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

| 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 | 110049 | 海尔电器 | 170,020 | 21,075,479.20 | 2.06 |
| 2 | 113011 | 光大银行 | 174,560 | 20,611,707.20 | 1.96 |
| 3 | 010107 | 21世纪网 | 146,410 | 15,003,403.00 | 1.47 |
| 4 | 108044 | 招商公路 | 98,860 | 9,997,711.80 | 0.98 |
| 5 | 113023 | 中恒集团 | 1,820 | 1,96,389.00 | 0.02 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 190008 | 国家债券 | 15,003,403.00 | 1.47 |
| 2 | 190108 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 190009 | 金融债 | 9,997,711.80 | 0.98 |
| 4 | 190010 | 企业债 | 9,997,711.80 | 0.98 |
| 5 | 190011 | 可转债 | - | - |
| 6 | 190012 | 其他债 | - | - |
| 7 | 190013 | 其他债 | - | - |
| 8 | 190014 | 其他债 | - | - |
| 9 | 190015 | 其他债 | - | - |
| 10 | 190016 | 其他债 | - | - |

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货币投资明细

| 序号 | 货币品种 | 数量(元) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 活期存款 | 170,020 | 21,075,479.20 | 2.06 |
| 2 | 定期存款 | 174,560 | 20,611,707.20 | 1.96 |
| 3 | 通知存款 | 146,410 | 15,003,403.00 | 1.47 |
| 4 | 协议存款 | 98,860 | 9,997,711.80 | 0.98 |
| 5 | 其他存款 | 1,820 | 1,96,389.00 | 0.02 |

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

| 序号 | 代码 | 名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | | |
|----|--------|------|---------|--------------|--------|---|
| 1 | 110011 | 招商证券 | 41,976 | 187,206 | 18.28% | 否 |
| 2 | 103412 | 光大银行 | 62,636 | 317,412 | 17.33% | 否 |
| 3 | 106006 | 招商银行 | 99,284 | 91,946 | 16.01% | 否 |
| 4 | 110038 | 光大银行 | 73,343 | 96,660 | 9.50% | 否 |
| 5 | 400002 | 招商银行 | 76,836 | 96,218 | 9.34% | 否 |
| 6 | 612100 | 招商银行 | 45,829 | 72,316 | 7.65% | 否 |
| 7 | 106716 | 招商银行 | 36,338 | 67,062 | 5.57% | 否 |
| 8 | 481001 | 招商银行 | 22,228 | 28,943 | 3.31% | 否 |
| 9 | 116808 | 招商银行 | 23,519 | 23,680 | 2.37% | 否 |
| 10 | 116829 | 招商银行 | 13,926 | 14,030 | 1.46% | 否 |

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十名权证投资明细

| 序号 | 代码 | 名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | | |
|----|--------|------|---------|--------------|--------|---|
| 1 | 110011 | 招商证券 | 41,976 | 187,206 | 18.28% | 否 |
| 2 | 103412 | 光大银行 | 62,636 | 317,412 | 17.33% | 否 |
| 3 | 106006 | 招商银行 | 99,284 | 91,946 | 16.01% | 否 |
| 4 | 110038 | 光大银行 | 73,343 | 96,660 | 9.50% | 否 |
| 5 | 400002 | 招商银行 | 76,836 | 96,218 | 9.34% | 否 |
| 6 | 612100 | 招商银行 | 45,829 | 72,316 | 7.65% | 否 |
| 7 | 106716 | 招商银行 | 36,338 | 67,062 | 5.57% | 否 |
| 8 | 481001 | 招商银行 | 22,228 | 28,943 | 3.31% | 否 |
| 9 | 116808 | 招商银行 | 23,519 | 23,680 | 2.37% | 否 |
| 10 | 116829 | 招商银行 | 13,926 | 14,030 | 1.46% | 否 |

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股指期货投资明细

| 序号 | 代码 | 名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | | |
|----|--------|------|---------|--------------|--------|---|
| 1 | 110011 | 招商证券 | 41,976 | 187,206 | 18.28% | 否 |
| 2 | 103412 | 光大银行 | 62,636 | 317,412 | 17.33% | 否 |
| 3 | 106006 | 招商银行 | 99,284 | 91,946 | 16.01% | 否 |
| 4 | 110038 | 光大银行 | 73,343 | 96,660 | 9.50% | 否 |
| 5 | 400002 | 招商银行 | 76,836 | 96,218 | 9.34% | 否 |

5.9 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国债期货投资明细

| 序号 | 代码 | 名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | | |
|----|--------|------|---------|--------------|--------|---|
| 1 | 110011 | 招商证券 | 41,976 | 187,206 | 18.28% | 否 |
| 2 | 103412 | 光大银行 | 62,636 | 317,412 | 17.33% | 否 |
| 3 | 106006 | 招商银行 | 99,284 | 91,946 | 16.01% | 否 |
| 4 | 110038 | 光大银行 | 73,343 | 96,660 | 9.50% | 否 |
| 5 | 400002 | 招商银行 | 76,836 | 96,218 | 9.34% | 否 |

5.10 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权证投资明细

| 序号 | 代码 | 名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | | |
|----|--------|------|---------|--------------|--------|---|
| 1 | 110011 | 招商证券 | 41,976 | 187,206 | 18.28% | 否 |
| 2 | 103412 | 光大银行 | 62,636 | 317,412 | 17.33% | 否 |
| 3 | 106006 | 招商银行 | 99,284 | 91,946 | 16.01% | 否 |
| 4 | 110038 | 光大银行 | 73,343 | 96,660 | 9.50% | 否 |
| 5 | 400002 | 招商银行 | 76,836 | 96,218 | 9.34% | 否 |