

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.46%	1.40%	-0.87%	0.73%	-3.59%	0.67%

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

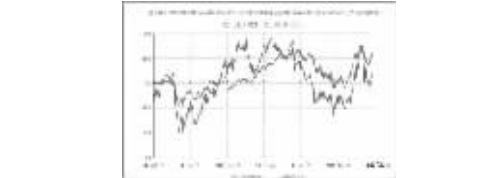


图1：本基金自合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
陈玉珊	本基金基金经理、投资一部总监	2015-01-05 - 至今	15年	陈玉珊先生,中国国籍,经济学硕士,2003年6月加入招商证券有限责任公司,从事行业研究及资产管理,2006年11月加入南方证券股份有限公司,2008年3月加入招商证券,2010年11月加入创金合信基金管理有限公司,历任研究员、基金经理,现任创金合信基金基金经理,自2015年4月10日起担任本基金基金经理,2016年4月加入创金合信基金管理有限公司,现任创金合信基金基金经理。
郑海松	本基金基金经理	2017-12-12 - 至今	6年	郑海松先生,中国国籍,江西财经大学金融学硕士,2013年加入招商证券,从事行业研究及资产管理,2015年加入创金合信基金管理有限公司,现任创金合信基金基金经理。

注:1.本基金前任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,离任日期、后任基金经理的任职日期由公司公告作出决定的日期;
2.证券从业年限的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,未发生损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比

例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合,切实防范利益输送。本报告期,公平交易制度总体执行情况良好。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2019年一季度快速上涨后,二季度市场呈现回调震荡走势。2019年上半年,中证2000、创业板指、沪深300、上证50等代表性中小市值风格涨幅区间19%-28%,较一季度差距有所收敛,但行业涨幅结构性分化加剧。上半年白酒和消费指数涨幅最大分别达到7%和57%,保险、证券指数涨幅也分别达到46%和38%,而周期类板块涨幅滞后,如钢铁、煤炭板块涨幅仅9%和17%。

基金组合二季度维持了低市净率、低市值、国企股风格配置,组合弹性与市场平均水平基本一致,但风格略偏周期。未来组合策略上采取大/小市值、高低贝塔结合的哑铃策略,个股方面坚持“三低”选股策略,重点关注国家关于国企改革、碳中和等政策导向下国企改革、市场化基本而反转型机会。同时采取采取深跌个股的超额收益轮动策略,适度提升涨幅较大的个股置换为持股中涨幅较小并接近市场热点行业或风格的超跌个股,提升组合弹性和控制回撤风险。
4.5 报告期内基金的投资表现
截至报告期末创金沪港深精选混合基金份额净值为1.029元,本报告期内,基金份额净值增长率为-4.46%,同期业绩比较基准收益率为-0.07%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本基金本报告期末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 投资组合报告
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 262,398,326.32 81.43
其中:股票 262,398,326.32 81.43
2 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
资产支持证券 -- --
3 贵金属投资 -- --
4 金融衍生品投资 -- --
5 买入返售金融资产 -- --
6 银行存款和结算备付金合计 67,522,809.69 18.52
7 其他资产 155,427.80 0.06
8 其他负债 310,677,066.72 100.00

注:本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为1,966,743.83元,占净值比0.63%。
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
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业 -- --
B 采矿业 205,896.46 0.07
C 制造业 137,744,342.30 44.43
D 电力、热力、燃气及生产服务业 -- --
E 建筑业 -- --
F 批发和零售业 47,384,398.70 15.28
G 交通运输、仓储和邮政业 20,667,413.36 6.67
H 住宿和餐饮业 -- --
I 信息技术、软件和信息技术服务业 39,603.76 0.01
J 金融业 27,531,133.04 8.88
K 房地产业 -- --
L 租赁和商务服务业 -- --
M 科学研究和技术服务业 -- --
N 水利、环境和公共设施管理业 -- --
O 居民服务、修理和其他服务业 -- --
P 教育 -- --
Q 文化、体育和娱乐业 17,450,810.89 5.63
R 综合 -- --
合计 261,031,584.50 80.06

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
行业类别 公允价值(人民币) 占基金资产净值比例(%)
能源 717,626.63 0.23
金融 1,061,221.62 0.34
工业 1,077,858.28 0.34
合计 2,856,706.53 0.85

注:1.以上分类采用全球行业分类标准(GICS);
2.由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。
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

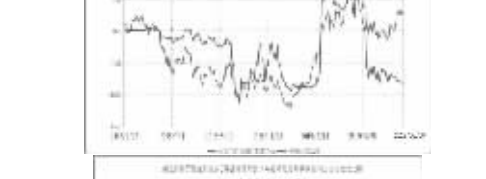
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000731	湖南黄金	4,062,726	28,976,980.00	9.36
2	600767	长江传媒	2,660,300	17,436,704.29	5.62
3	600889	王府井	1,123,480	17,066,061.20	5.50
4	600661	北京城乡	1,989,871	16,909,403.60	5.46
5	600089	特变电工	2,233,032	16,196,045.60	5.12
6	603222	广联达	3,527,765	11,382,373.88	3.67
7	603982	瑞联新材	1,589,556	11,380,320.48	3.66
8	603028	兰太实业	1,360,800	11,144,862.00	3.59
9	600796	钱江水利	1,988,582	10,568,474.52	3.33
10	600519	中信重工	1,400,000	10,822,000.00	3.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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
本基金本报告期末未持有债券。
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

创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	-11.66%	1.20%	-0.09%	-1.01%	0.29%



注:1.本基金前任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,离任日期、后任基金经理的任职日期由公司公告作出决定的日期;
2.证券从业年限的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,未发生损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比

注:本基金自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
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合,切实防范利益输送。本报告期,公平交易制度总体执行情况良好。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2019年一季度快速上涨后,二季度市场呈现回调震荡走势。2019年上半年,中证2000、创业板指、沪深300、上证50等代表性中小市值风格涨幅区间19%-28%,较一季度差距有所收敛,但行业涨幅结构性分化加剧。上半年白酒和消费指数涨幅最大分别达到7%和57%,保险、证券指数涨幅也分别达到46%和38%,而周期类板块涨幅滞后,如钢铁、煤炭板块涨幅仅9%和17%。

基金组合二季度维持了低市净率、低市值、国企股风格配置,组合弹性与市场平均水平基本一致,但风格略偏周期。未来组合策略上采取大/小市值、高低贝塔结合的哑铃策略,个股方面坚持“三低”选股策略,重点关注国家关于国企改革、碳中和等政策导向下国企改革、市场化基本而反转型机会。同时采取采取深跌个股的超额收益轮动策略,适度提升涨幅较大的个股置换为持股中涨幅较小并接近市场热点行业或风格的超跌个股,提升组合弹性和控制回撤风险。
4.5 报告期内基金的投资表现
截至报告期末创金价值红利混合A基金份额净值为0.9193元,本报告期内,基金份额净值增长率为-11.56%,同期业绩比较基准收益率为-0.05%;截至报告期末创金价值红利混合C基金份额净值为0.9065元,本报告期内,该基金份额净值增长率为-11.79%,同期业绩比较基准收益率为-0.05%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
截至本财务报表批准报出日,本基金已连续80个工作日基金资产净值低于五千万元,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案,已启动基金财产清算程序。

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
陈玉珊	本基金基金经理、投资一部总监	2015-01-05 - 至今	15年	陈玉珊先生,中国国籍,经济学硕士,2003年6月加入招商证券有限责任公司,从事行业研究及资产管理,2006年11月加入南方证券股份有限公司,2008年3月加入招商证券,2010年11月加入创金合信基金管理有限公司,历任研究员、基金经理,现任创金合信基金基金经理,自2015年4月10日起担任本基金基金经理,2016年4月加入创金合信基金管理有限公司,现任创金合信基金基金经理。
曹春林	本基金基金经理	2018-09-07 - 至今	14年	曹春林先生,中国国籍,厦门大学金融学硕士,1998年7月加入招商证券,从事行业研究及资产管理,2004年3月加入南方证券,2006年11月加入创金合信基金管理有限公司,历任研究员、基金经理,现任创金合信基金基金经理,自2018年9月7日起担任本基金基金经理。

注:1.本基金前任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,离任日期、后任基金经理的任职日期由公司公告作出决定的日期;
2.证券从业年限的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,未发生损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合,切实防范利益输送。本报告期,公平交易制度总体执行情况良好。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2019年一季度快速上涨后,二季度市场呈现回调震荡走势。2019年上半年,中证2000、创业板指、沪深300、上证50等代表性中小市值风格涨幅区间19%-28%,较一季度差距有所收敛,但行业涨幅结构性分化加剧。上半年白酒和消费指数涨幅最大分别达到7%和57%,保险、证券指数涨幅也分别达到46%和38%,而周期类板块涨幅滞后,如钢铁、煤炭板块涨幅仅9%和17%。

基金组合二季度维持了低市净率、低市值、国企股风格配置,组合弹性与市场平均水平基本一致,但风格略偏周期。未来组合策略上采取大/小市值、高低贝塔结合的哑铃策略,个股方面坚持“三低”选股策略,重点关注国家关于国企改革、碳中和等政策导向下国企改革、市场化基本而反转型机会。同时采取采取深跌个股的超额收益轮动策略,适度提升涨幅较大的个股置换为持股中涨幅较小并接近市场热点行业或风格的超跌个股,提升组合弹性和控制回撤风险。
4.5 报告期内基金的投资表现
截至报告期末创金合信金融地产精选股票A基金份额净值为0.9726元,本报告期内,基金份额净值增长率为1.06%,同期业绩比较基准收益率为-0.07%;截至报告期末创金合信金融地产精选股票C基金份额净值为0.9655元,本报告期内,该基金份额净值增长率为0.90%,同期业绩比较基准收益率为-0.07%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
截至本财务报表批准报出日,本基金已连续80个工作日基金资产净值低于五千万元,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案,已启动基金财产清算程序。

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 9,397,691.07 89.45
其中:股票 9,397,691.07 89.45
2 固定收益投资 478,298,000.00 4.56
其中:债券 478,298,000.00 4.56
资产支持证券 -- --
3 贵金属投资 -- --
4 金融衍生品投资 -- --
5 买入返售金融资产 -- --
6 银行存款和结算备付金合计 146,397.86 1.39
7 其他资产 463,430.83 4.40
8 其他负债 10,505,806.26 100.00

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
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业 -- --
B 采矿业 -- --
C 制造业 203,227.07 2.03
D 电力、热力、燃气及生产服务业 -- --
E 建筑业 -- --
F 批发和零售业 -- --
G 交通运输、仓储和邮政业 -- --
H 住宿和餐饮业 -- --
I 信息技术、软件和信息技术服务业 269,561.00 2.69
J 金融业 8,109,132.00 80.85
K 房地产业 819,741.00 8.04
L 租赁和商务服务业 -- --
M 科学研究和技术服务业 -- --
合计 9,397,691.07 92.69

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
能源 -- --
金融 -- --
工业 -- --
合计 -- --

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

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	601318	中国平安	11,300	1,001,283.00	9.88
2	600036	招商银行	28,300	946,274.00	9.43
3	600001	浦发银行	62,800	805,394.00	7.93
4	602342	平安银行	35,200	853,280.00	8.51
5	600837	海南机场	56,400	823,344.00	8.01
6	600330	中信证券	22,000	701,500.00	6.93
7	601098	华鲁能源	33,400	746,480.00	7.43
8	600340	华鲁能源	13,100	426,697.00	4.26
9	601128	常熟银行	52,200	402,984.00	4.02
10	601336	新华保险	6,300	346,680.00	3.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 -- --
2 央行票据 -- --
3 金融债券 478,298.00 4.77
其中:政策性金融债 478,298.00 4.77
4 企业债券 -- --
5 企业短期融资券 -- --
6 中期票据 -- --
7 可转换债(可交换债) -- --
8 同业存单 -- --
9 其他 -- --
10 合计 478,298.00 4.77

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

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(%)
1 108903 国开1804 4,780 478,298.00 4.77

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。
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

本基金本报告期末未持有权证。
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股票投资

本基金本报告期末未持有股票。
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

本基金本报告期末未持有权证。
5.11 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.12 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.13 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.14 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.15 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.16 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.17 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.18 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.19 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.20 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.21 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.22 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.23 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.24 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.25 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.26 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.27 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.28 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.29 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.30 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.31 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.32 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.33 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.34 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.35 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.36 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.37 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.38 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.39 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.40 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.41 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.42 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.43 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.44 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.45 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.46 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.47 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.48 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.49 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.50 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.51 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.52 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.53 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.54 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.55 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.56 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.57 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.58 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.59 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.60 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.61 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.62 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.63 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.64 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.65 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.66 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.67 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.68 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.69 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.70 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。
5.71 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权证投资