

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况(%)
1	300007	美年健康	8,916,148.00	3.94	无重大事项

6. 投资组合报告附注的其他文本描述部分
由于计入中登公司人账的其他本报告所述之和与合计项之间可能存在尾差。
十二、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金过往业绩并不预示其未来表现。投资者有风险,投资者应做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金合同生效日为 2018年 6 月 13 日,基金合同生效以来某基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率	业绩比较基准	超额收益	波动率	跟踪误差	①-③	②-④
2018年6月13日至2018年12月31日	-10.50%	0.06%	-21.14%	1.18%	12.64%	-0.23%	
2019年1月1日至2019年3月31日	20.09%	15.1%	18.40%	1.15%	12.51%	0.30%	
2019年1月1日至2019年3月31日	17.23%	1.17%	-18.94%	1.19%	26.17%	-0.02%	

十四、基金的费用
（一）与基金运作有关的费用
1. 基金费用的种类
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
（4）《基金合同》生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的相关账户的开户及维护费用；
（7）基金的投资、期货等交易费用；
（8）银行的银行汇划费用；
（9）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
上述“（一）基金费用的种类”中第3－9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
3. 不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
（3）《基金合同》生效前的相关费用;
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
（二）与基金销售有关的费用
1. 申购费用
本基金的首次申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
本基金的申购费率为如下:

（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第3－9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
3. 不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
（3）《基金合同》生效前的相关费用;
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
（二）与基金销售有关的费用
1. 申购费用
本基金的首次申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
本基金的申购费率为如下:

（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第3－9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
3. 不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
（3）《基金合同》生效前的相关费用;
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
（二）与基金销售有关的费用
1. 申购费用
本基金的首次申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
本基金的申购费率为如下:

（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（三）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
（四）基金合同生效后与基金运作相关支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;
（五）基金份额持有人大会费用;
（六）基金的相关账户的开户及维护费用;
（七）基金的投资、期货等交易费用;
（八）银行的银行汇划费用;
（九）按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提基础和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

（2）投资决策
本基金的投资决策委员会依据上述研究报告,定期(月)或遇重大事件时召开投资决策会议,决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资组合的日常决策。

（3）组合构建
在投资决策委员会制定的投资策略和资产配置原则下,基金经理根据研究人员和行业数量小组的投资建议,结合自身对证券市场的分析判断,制定大类资产配置行业配置及个股投资建议,结合医疗保健主题的投资特点,在严格贯彻投资流程和投资建议的基础上,严格控制风险构建投资组合,进行投资组合的构建和日常管理,并定期进行组合优化。

（4）交易执行
基金经理直接向交易部下达交易指令,中央交易室依据基金经理的指令,制定交易策略,统一执行投资组合计划,进行具体品种的买卖,并将执行结果反馈基金经理确认。执行执行结束后,交易员填写交易回执,经基金经理确认后交给基金经理行政人员存档。

（5）业绩评估
数量小组风险控制小组用公开开发的业绩评估系统,对投资组合中整体资产配置、投资组合、个股选择、个股选择、买卖成本等因素对整体业绩的贡献进行分析。该评估结果将为基金经理进行积极投资风险的控制和调整提供依据。
（6）组合监控
基金经理将根据市场状况,结合行业、个股的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整。

十、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中证医药卫生指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%

中证医药卫生指数为中证行业指数之一,为反映沪深A股不同行业公司股票的价格,为投资者提供分析工具,中证行业指数数据源自行业分类标准并符合我国上市公司特点,将中证800指数的800只样本股分为能源、原材料、工业、可选消费、主要消费、医药卫生、金融地产、信息技术、电信业务和公用事业等10个行业并形成行业指数的成份股。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围全面,具有广泛的代表性,属于市场上最具流动性的品种,交易所市场、银行间市场和银行间债券市场、企业债、中期票据、短期融资券,能够很好地反映中国债券市场整体的价格水平和变动趋势,适合作为本基金业绩比较基准的业绩比较基准。
如今后证券市场中有其他更适合、或者数据编制单位上编制指数数据,或者更客观权威的业绩比较基准适用于本基金时,基金经理人可以依据循基金合同并经托管人同意后,根据实际情况按照监管部门要求履行相应的程序并提前召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照,并不决定也必然反映本基金的投资收益特征。

十一、风险收益特征
本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

十二、投资组合报告
本基金管理人的董事会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。
本基金的托管人——招商银行股份有限公司对本基金合同生效日,于2019年6月26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。
本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日,本报告所列财务数据未经审计。

（一）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	204,088,010.02	84.02
1.1	其中:股票	204,088,010.02	84.02
2	固定收益投资	5,018,500.00	2.07
2.1	其中:债券	5,018,500.00	2.07
3	资产支持证券	--	--
3.1	资产支持证券	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
4.1	股指期货投资	--	--
4.2	国债期货投资	--	--
4.3	其他衍生品投资	--	--
5	银行存款和结算备付金合计	27,767,963.89	11.43
6	其他各项资产	6,021,064.17	2.46
8	合计	242,876,538.08	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	--	--
B	医药生物	--	--
C	制造业	143,267,227.91	63.26
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	--	--
E	建筑业	718,000.00	0.32
F	批发和零售业	14,391,393.68	6.28
G	交运仓储、仓储和邮政业	2,794,000.00	1.24
H	信息技术业	10,784,504.14	4.77
J	金融保险	134,294,000.00	60.09
K	房地产业	1,567,500.00	0.69
L	轻工和纺织服装业	--	--
M	科学研究和技术服务业	7,036,643.21	3.11
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	国防军工、管理和信息服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	新闻和社会工作	23,973,863.16	10.42
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	合计	204,088,010.02	90.24

2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通投资股票。
（三）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	600072	宁德时代	387,042	12,286,623.64	5.43
2	300047	华兰生物	174,163	11,647,000.00	5.11
3	300725	药石科技	106,319	9,391,263.83	4.09
4	300009	安图医疗	621,118	8,196,148.98	3.54
5	300085	英诺生物	136,641	7,636,751.16	3.33
6	300760	迈瑞医疗	53,586	7,238,889.80	3.20
7	000061	民生银行	21,200	6,666,790.00	2.94
8	600196	复星医药	194,163	5,792,290.24	2.54
9	000027	华能国际	115,476	5,696,244.00	2.43
10	000520	山东药业	200,000	5,100,000.00	2.26

（四）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	国债投资	--	--
2	金融债	--	--
3	国债逆回购	5,000,500.00	2.21
4	央行票据	--	--
5	中期票据	--	--
6	企业短期融资券	--	--
7	可转换债(可分离债)	38,000.00	0.01
8	其他债券	--	--
10	合计	5,018,500.00	2.22

（五）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	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018006	国债付701	50,000	5,000,500.00	2.21
2	115329	烟台转债	190	18,000.00	0.01

（六）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明细

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	018006	国债付701	50,000	5,000,500.00	2.21
2	115329	烟台转债	190	18,000.00	0.01

（七）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

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	018006	国债付701	50,000	5,000,500.00	2.21
2	115329	烟台转债	190	18,000.00	0.01

（八）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	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	018006	国债付701	50,000	5,000,500.00	2.21
2	115329	烟台转债	190	18,000.00	0.01

（九）报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明
1. 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持有股指期货。
2. 本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对冲证券市场和期货市场运行趋势,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

（十）本基金投资国债期货的投资政策
国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平,基金管理人将按照相关法律法规的规定,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

（十一）报告期末本基金持有的场外期权投资情况
1. 报告期末本基金投资的场外期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未参与场外期权投资。
2. 本基金投资场外期权的投资政策
场外期权作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平,基金管理人将按照相关法律法规的规定,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对场外期权和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

（十二）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
1. 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参与国债期货投资。
2. 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未参与国债期货投资,无相关投资评价。
（十三）股指期货投资情况附注
1、 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
2、 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	669,447.02
2	股指期货合约	--
3	应收保证金	