

B94 信息披露 | Disclosure

(上接B093版)

客服电话: 400-166-1188
公司网站: http://83.jrj.com.cn
(67) 和讯信息科技有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
办公地址: 上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼
法人代表: 王莉
联系人: 于杨
客服电话: 400-920-0022
公司网站: licaikehexun.com
(68) 上海搜利基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号3号楼5层01_02_03室
办公地址: 上海浦东陆家嘴金融世纪广场3号楼5F
法人代表: 冷飞
联系人: 李娟
客服电话: 021-50810673
公司网站: http://www.wacaijin.com/
(69) 互理基金销售(上海)有限公司
注册地址: 上海市黄浦区北京东路666号11区(东座)6楼A31室
办公地址: 上海市黄浦区北京东路666号11区(东座)6楼A31室
法人代表: 唐惠琴
联系人: 杨一新
客服电话: 021-50206003
公司网站: www.msftec.com
(70) 北京百度盈益基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
办公地址: 北京市海淀区上地信息路甲9号科利大厦
法人代表: 张旭阳
联系人: 孙博超
客服电话: 95056-4
公司网站: www.baiyingfund.com
(71) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼
法人代表: 汪静波
联系人: 张姚杰
客服电话: 400-821-5399
公司网站: www.nuobay-fund.com
(72) 深圳众基金销售股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元
法人代表: 薛峰
联系人: 汤素媛
客服电话: 4006-788-887
公司网站: www.zlfund.cn
(73) 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号26楼
法人代表: 其实
联系人: 潘世友
客服电话: 400-1818-188
公司网站: www.1234567.com.cn
(74) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东新区1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法人代表: 杨文斌
联系人: 张茹
客服电话: 4007-009-888
公司网站: www.howbuy.com
(75) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1楼202室
办公地址: 上海市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法人代表: 陈柏青
联系人: 张裕
客服电话: 4000-766-123
公司网站: www.fund123.cn
(76) 上海长量基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法人代表: 张驭秋
联系人: 沈雯斌
客服电话: 400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com
(77) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址: 杭州市文二西路1号903室
办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法人代表: 凌顺平
联系人: 吴强
客服电话: 4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com
(78) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址: 北京市朝阳区德胜门外华严北里2号院2号楼6层
法人代表: 闫振杰
联系人: 宋丽甫
客服电话: 4008-886-661
公司网站: www.mylfund.com
(79) 上海利得基金销售有限公司
注册地址: 上海市宝山区蕪川路475号1033室
办公地址: 上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法人代表: 沈继伟
联系人: 曹晨峰
客服电话: 400-067-6266
公司网站: http://aleadfund.com.cn
(80) 嘉实财富管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表: 赵学军
联系人: 张倩
客服电话: 400-021-8888
公司网站: www.harvestwm.cn
(81) 北京创金启富基金销售有限公司
注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法人代表: 梁蓉
联系人: 张旭
客服电话: 400-6262-818
公司网站: www.sicr.com.cn
(82) 南京苏宁基金销售有限公司
注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
法人代表: 钱昊飞
联系人: 王峰
客服电话: 95177
公司网站: www.snjijin.com
(83) 北京路上信基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法人代表: 李俊奇
联系人: 张林
客服电话: 400-066-8866
公司网站: https://www.igasesafe.com/
(84) 上海恒天明泽基金销售有限公司
注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路20号乐城中心A座23层
法人代表: 周晟
联系人: 马鹏程
客服电话: 400-706-8968
公司网站: www.chtwm.com
(85) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
法人代表: 王伟刚
联系人: 丁向博
客服电话: 400-619-9059
公司网站: www.hcjijin.com
(86) 深圳盈信基金销售有限公司
注册地址: 深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-(111-112)
办公地址: 辽宁省大连市中山区海军广场街道人民东路52号民生金融中心222盈信基金
法人代表: 苗东升
联系人: 葛倩倩
客服电话: 4007-903-688
公司网站: www.fundying.com
(87) 上海大智慧基金销售有限公司
注册地址: 上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼
办公地址: 上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1108室
法人代表: 申健
联系人: 邵明
客服电话: 021-20292031
公司网站: https://8.gw.com.cn/
(88) 上海新派金鑫基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室
办公地址: 北京市海淀区北四环西路68号理想国际大厦906室、海淀北二街10号泰融大厦12层
法人代表: 张琪
联系人: 付文红
客服电话: 010-66275689
公司网站: www.xincui.com
(89) 济安财富(北京)资本管理有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法人代表: 杨健
联系人: 李海鑫
客服电话: 400-673-7010
公司网站: www.jianfortune.com
(90) 上海联泰基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址: 上海市市长宁区福泉北路518号8座3楼
法人代表: 燕斌
联系人: 袁秋洁
客服电话: 400-046-6788
公司网站: www.66zichan.com
(91) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址: 上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室 上海泰和经济发

(94) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法人代表: 肖雯
联系人: 黄敏娥
客服电话: 020-89629066
公司网站: www.yingmi.cn
(95) 奕丰基金销售有限公司
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市
办公地址: 深圳市福田区海德三路海岸大厦座座 1115、1116、1307 室
法人代表: TEO WEE HOWE
联系人: 项晶晶
客服电话: 400-684-0500
公司网站: http://www.ifastps.com.cn
(96) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-4层
办公地址: 北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法人代表: 彭延华
联系人: 陈珍珍
客服电话: 400-8909-998
公司网站: www.jnlc.com
(97) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层
法人代表: 江卉
联系人: 徐伯宇
客服电话: 95118
公司网站: http://fund.jd.com/
(98) 大连网金基金销售有限公司
注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
法人代表: 樊怀东
联系人: 贾伟刚
客服电话: 4000-899-100
公司网站: www.yibaijin.com
(99) 深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
办公地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
法人代表: 赖任军
联系人: 刘昕薇
客服电话: 400-930-0660
公司网站: www.jfzinv.com
(100) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层
办公地址: 北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507
法人代表: 钟斐斐
联系人: 戚晓强
客服电话: 400-156-9288
公司网站: danjuanapp.com
(101) 上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法人代表: 李一梅
联系人: 仲秋月
客服电话: 400-817-5666
公司网站: www.amcfortune.com
(102) 法元保险代理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
法人代表: 马永清
联系人: 卢亚博
客服电话: 400-080-8208
公司网站: www.liaimofang.cn
(三) 场内销售机构
具有基金代销资格的深圳证券交易所场内会员单位。
(四) 其他
基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并在基金管理人网站公示。
一、基金登记机构
名称: 中国证券登记结算有限责任公司
住所: 北京市西城区太平桥大街17号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人: 周明
电话: (010) 50938782
传真: (010) 50938991
联系人: 赵亦清
二、出具法律意见书的律师事务所
名称: 上海源泰律师事务所
住所: 上海浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址: 上海浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人: 廖海
电话: (021) 51150288
传真: (021) 51150388
联系人: 廖海
经办律师: 廖海、黎明
四、审计基金财产的会计师事务所
名称: 安永华明会计师事务所
住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼16层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人: 葛明
电话: 021-22288888
传真: 021-22280000
联系人: 徐海
经办注册会计师: 徐海、蒋燕华
第四部分 基金名称
第五部分 基金类型
富国天丰强化收益债券型证券投资基金
债券型
本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上, 力争为基金份额持有人创造较高的当期收益。
第七部分 基金投资方向
本基金的基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它固定收益类证券品种。
本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从事二级市场买入股票、权证等权益类资产, 但可以参与一级市场新股申购或增发新股, 并可能因持有可转换债券所形成的股票、因所持债券所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等; 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他非固定收益类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产, 本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为: 本基金在封闭期间, 投资于固定收益类资产的比例为基金资产的80%—100%; 投资于非固定收益类资产的比例为基金资产的0%—20%; 在开放期间, 投资于固定收益类资产的比例为基金资产的90%—96%; 投资于非固定收益类资产的比例为基金资产的0%—10%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%; 其中现金不包括结算备付金。
第八部分 基金投资策略
1. 资产配置策略
本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类资产配置。一方面根据投资资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中隐蔽的投资机会, 发掘价格被低估且符合流动性要求的合适投资品种; 另一方面通过风险预算管理, 平均剩余期限和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险, 从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。
(1) 股票资产配置策略
通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况、以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析, 在整体资产之间进行动态配置, 确定资产的风险配置比例和相应的风险水平。
(2) 类属资产配置策略
在整体资产配置策略的指导下, 根据资产的风险来源、收益水平、利息税务处理以及市场流动性等因素, 将市场细分为普通债券(含国债、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等)、附权债券(含可转换公司债券、分离交易可转债等)、资产证券化产品、金融创新(各类金融衍生工具等)和新股申购五个子市场, 采取积极投资策略, 定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整, 确定类属资产的最优权重。
(3) 可转债资产配置策略
在可转债资产配置上, 首先根据可转债的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合; 其次, 根据个别债券的收益率(倒叙收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比, 对组合的收益要求决定是否纳入组合; 最后, 根据个别债券的流动性指标发行总量、流通量、上市时间, 决定投资总量。
2. 普通债券投资策略
本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济动态跟踪, 采用久期控制下的主动性投资策略, 主要包括: 久期控制、期限结构配置、信用风险配置、市场利率和相对价值判断等管理手段, 对债券市场、债券收益率曲线以及各品种债券价格的变化进行预测, 相机而动, 积极调整。
(1) 久期控制是通过对宏观经济状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期, 有效规避利率波动带来的利率风险。
(2) 期限结构配置是在确定组合久期后, 针对收益率曲线形状特征确定合理的组合期限结构, 包括采用集中策略、两端策略和梯型策略等; 在长期、中期和短期债券间进行动态调整, 从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。
(3) 信用风险配置是管理人充分利用现有行业与公司研究力量, 根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用进行评, 以此作为品种选择的基本依据。
(4) 跨市场跨后不同债券市场间的流动性风险和利率风险, 构建和调整债券投资组合, 提高投资收益, 实现跨市场套利。
(5) 相对价值判断是依据对同类债券的相对价值判断, 选择合适的交易时机, 增持相对低估、价格将上升的债券, 减持相对高估、价格将下降的债券。
3. 积极债券投资策略
附权债券指对债券发行主体授予某种期权, 或者赋予债券投资者某种期权, 从而使债券发行主体或投资者有了某种灵活的选择余地, 从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性, 也增强对各类投资者的吸引力。当前附权债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转换公司债券以及含赎回或回售选择权的债券等。
(1) 可转换公司债券投资策略
可转换公司债券不同于一般的企业(公司)债券, 其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利, 因此其理论价值应当充分作为普通债券的基础价值加上可转换公司债券内含期权价值, 是一种既具有债性, 又具有股性的混合债券产品, 具有抵御价格下行风险, 分享股票价格上涨收益的特点。
(2) 可转换公司债券投资策略
(a) 可转换公司债券最大的优点在于, 可以用较小的本金损失, 博取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布, 买入低转换价格的债券, 并持有的投资策略, 只要在可转换公司债券的存续期间内, 发行转债公司股票价格上升, 则投资就可以获得超额收益。
(b) 可转换公司债券可以按照协议价格转换为上市公司的股票, 因而在日常交易过程中可能会出现可转换公司债券市场与股票市场之间的套利机会。本基金持有的可转换公司债券可以转换成股票。基金管理人会在日常交易过程中, 密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系, 恰当的择机时点进行套利。
(c) 其它附权债券投资策略
本基金利用债券收益率曲线、期限、信用利差、标的资产的价格、提前赎回率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上, 对资产证券化产品的交易结构、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析, 采取积极收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动策略等积极主动的投资策略, 投资于资产证券化产品。
5. 新股申购策略
为保证新股发行成功, 新股发行一级市场价格通常相对二级市场价格存在一定的溢价。在中国证券市场发展历程中, 参与新股申购是一种风险低、收益稳定的投资行为, 为投

资人带来较高的投资回报。本基金根据新股发行人的基本情况, 以及对认购中签率和新股上市表现的预期, 谨慎参与新股申购, 获取股票一级市场与二级市场的价差收益, 申购所得的股票在可上市交易后30个交易日内全部卖出。
对固定收益类资产的投资来说, 主动性投资策略的制定与贯彻的过程, 也是管理人对于风险进行动态评估与风险的过程。对风险定价失效机会的把握通过控制了主动性投资策略的特点。在系统化的风险控制体系下, 通过对管理指标的设定与监控, 管理人不但可以有效控制整体资产的风险水平, 而且可以在寻求风险结构优化的过程中不断提高基金的收益水平。
第九部分 基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
本基金为债券型基金, 主要投资于固定收益类金融工具, 强调基金资产的稳定增值, 为此, 本基金选取中债综合指数作为本基金的业绩比较基准。
若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准, 基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略, 调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的调整须经基金管理人和基金托管人协商一致, 并在更新的招募说明书中列示, 报中国证监会备案。
第十部分 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金, 属于证券投资基金中的低风险品种, 其预期风险与收益高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金。
第十一部分 投资组合报告
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 3,038,368.56 0.51
其中: 股票 3,038,368.56 0.51
2 固定收益投资 540,497,058.93 91.41
其中: 债券 540,497,058.93 91.41
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 -- --
其中: 买断式回购的买入返售金融资产 -- --
6 银行存款和结算备付金合计 41,204,899.33 6.97
7 其他资产 6,566,842.40 1.11
8 合计 591,307,168.21 100.00
二、报告期末按行业分类的股票投资组合
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 3,038,368.56 0.56
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 -- --
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 信息传输、软件和信息技术服务业 -- --
J 金融业 -- --
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 卫生和社会工作 -- --
R 文化、体育和娱乐业 -- --
S 综合 -- --
合计 3,038,368.56 0.56
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 002271 东方雨虹 89,285.00 3,038,368.56 0.56
四、报告期末按券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 国家债券 -- --
2 央行票据 -- --
3 金融债券 198,062,172.50 26.29
其中: 政策性金融债 167,600,172.50 20.71
4 企业债券 105,722,963.00 19.37
5 企业短期融资券 50,108,000.00 9.18
6 中期票据 9,267,600.00 1.70
7 可转债(可交换债) 177,336,333.43 32.49
8 同业存单 -- --
9 其他 -- --
10 合计 540,497,058.93 99.02
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 190210 19国开10 600,000.00 62,562,000.00 11.46
2 160206 16国开06 400,000.00 40,400,000.00 7.40
3 132653 16国债03 250,000.00 25,165,000.00 4.61
4 180206 18国债06 200,000.00 22,374,000.00 4.10
5 190214 19国开14 200,000.00 20,268,000.00 3.73
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投资明细
七、本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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贵金属投资明细
注: 本基金本报告期末未持有贵金属投资。
九、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
注: 本基金本报告期末未持有权证。
十、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(一) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
股指期货投资本期收益(元) -- --
股指期货投资本期公允价值变动(元) -- --
(二) 本基金本报告期末未投资股指期货。
(三) 本基金股指期货投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资股指期货。
十一、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(一) 本期国债期货投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资国债期货。
(二) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
国债期货投资本期收益(元) -- --
国债期货投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资国债期货。
(四) 本期国债期货投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资国债期货。
十二、报告期末本基金投资的期权交易情况说明
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
十三、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
十四、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
十五、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
十六、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
十七、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
十八、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
十九、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十一、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十二、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十三、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十四、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十五、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十六、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十七、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十八、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
二十九、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十一、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十二、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十三、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十四、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十五、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十六、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十七、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十八、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
三十九、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十一、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十二、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十三、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十四、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十五、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十六、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十七、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十八、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
四十九、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十一、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十二、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十三、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十四、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十五、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十六、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二) 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
公允价值变动损益合计(元) -- --
期权投资本期收益(元) -- --
期权投资本期公允价值变动(元) -- --
(三) 本基金本报告期末未投资期权。
(四) 本期期权投资的投资政策
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资期权。
五十七、报告期末基金资产组合情况
(一) 说明本基金投资的期权名称
(二)