

## 海富通风格优势股票型证券投资基金

## 【2009】第四季度报告

限制及本基金投资组合的比例范围。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理 魏基经小组 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	说明
魏基经	本基金的基金经理	2007年8月6日	-	13年	1997年9月4日

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。  
2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人及报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
公司自成立以來，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，中国证监会对公平交易制度的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较  
根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 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情况  
随着国内经济企稳回升，A股市场在2009年第四季度稳步上升，深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出，极大的活跃了中小企业股的投资热度，并使得市场形成了深沪共振的格局。中央经济工作会议明确了明年将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，并将在2009年的基础上继续扩大内需，在政策刺激下，消费、电子、化工等行业有望明显复苏，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于对国内宏观经济趋势保持乐观的判断，本基金在2009年第四季度在资产配置上采取进取的策略，中央政府的宏观调控政策将再开始结构调整，房地产、食品饮料上，表现下滑了，对房地产产业链的调整，同时调整了食品饮料的结构性调整，调入医药股的配置力度，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于对国内宏观经济趋势保持乐观的判断，本基金在2009年第四季度在资产配置上采取进取的策略，中央政府的宏观调控政策将再开始结构调整，房地产、食品饮料上，表现下滑了，对房地产产业链的调整，同时调整了食品饮料的结构性调整，调入医药股的配置力度，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
报告期内，海富通风格优势股票基金基金净值增长率为19.39%，同期业绩比较基准收益率为14.31%，基金净值跑赢业绩比较基准5.08个百分点。

展望未来，二零一零年一季度中国宏观经济将继续保持高速增长的势头，但二零零九年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期，市场对中央宏观调控政策出现超预期上调的预期而日渐增强，因而未来市场走势或将成为本基金投资决策中需要重点关注的因素，我们将继续秉承价值投资理念，保持对未来的重要预期，另外总账表明表示，应该大力发掘互联网、绿色经济、低碳经济、环保技术、生物医药、这些对改善未来环境和人类生活的一些重要领域。"我们应重点考虑由此带来的结构性机会。"

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

## § 5 投资组合报告

注：1、本基金合同于2009年4月30日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；  
2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月，建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金第十二条（二）、（六）规定的比例。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理 魏基经小组 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	说明
魏基经	本基金的基金经理	2007年4月30日	19年	1991年7月1日	中国国籍，博士，持有基金从业人员资格证书，历任香港美商集团中国区投资经理，原上海万国证券公司证券分析师，海通证券交易总部投资经理，拥有中国证券业协会基金从业资格。2003年4月至2004年2月任海富通基金管理有限公司股票分析师，策略分析师，2004年3月至2009年1月任海富通基金增长混合基金基金经理，2009年1月起任海富通股票基金基金经理，2009年4月起兼任海富通领先成长股票基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。  
2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人及报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
公司自成立以來，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，中国证监会对公平交易制度的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较  
根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 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情况  
随着国内经济企稳回升，A股市场在2009年第四季度稳步上升，深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出，极大的活跃了中小企业股的投资热度，并使得市场形成了深沪共振的格局。中央经济工作会议明确了明年将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，并将在2009年的基础上继续扩大内需，在政策刺激下，消费、电子、化工等行业有望明显复苏，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
报告期内，海富通领先成长股票基金基金净值增长率为16.43%，同期业绩比较基准收益率为15.26%，基金净值跑赢业绩比较基准1.17个百分点。

2010年第一季度中国宏观经济将继续保持高速增长的趋势，但2009年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期，市场对中央宏观调控政策出现超预期上调的预期而日渐增强，因而未来市场走势或将成为本基金投资决策中需要重点关注的因素，我们将继续秉承价值投资理念，保持对未来的重要预期，另外总账表明表示，应该大力发掘互联网、绿色经济、低碳经济、环保技术、生物医药、这些对改善未来环境和人类生活的一些重要领域。"我们应重点考虑由此带来的结构性机会。"

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

## § 5 投资组合报告

注：1、本基金合同于2009年4月30日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；  
2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月，建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金第十二条（二）、（六）规定的比例。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理 魏基经小组 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	说明
魏基经	本基金的基金经理	2007年4月30日	19年	1991年7月1日	中国国籍，博士，持有基金从业人员资格证书，历任香港美商集团中国区投资经理，原上海万国证券公司证券分析师，海通证券交易总部投资经理，拥有中国证券业协会基金从业资格。2003年4月至2004年2月任海富通基金管理有限公司股票分析师，策略分析师，2004年3月至2009年1月任海富通基金增长混合基金基金经理，2009年1月起任海富通股票基金基金经理，2009年4月起兼任海富通领先成长股票基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。  
2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人及报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
公司自成立以來，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，中国证监会对公平交易制度的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较  
根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 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情况  
随着国内经济企稳回升，A股市场在2009年第四季度稳步上升，深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出，极大的活跃了中小企业股的投资热度，并使得市场形成了深沪共振的格局。中央经济工作会议明确了明年将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，并将在2009年的基础上继续扩大内需，在政策刺激下，消费、电子、化工等行业有望明显复苏，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
报告期内，海富通中国海外精选股票基金基金净值增长率为11.24%，同期业绩比较基准收益率为9.54%，基金净值跑赢业绩比较基准1.70个百分点。

2010年第一季度中国宏观经济将继续保持高速增长的趋势，但2009年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期，市场对中央宏观调控政策出现超预期上调的预期而日渐增强，因而未来市场走势或将成为本基金投资决策中需要重点关注的因素，我们将继续秉承价值投资理念，保持对未来的重要预期，另外总账表明表示，应该大力发掘互联网、绿色经济、低碳经济、环保技术、生物医药、这些对改善未来环境和人类生活的一些重要领域。"我们应重点考虑由此带来的结构性机会。"

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

## § 5 投资组合报告

注：1、本基金合同于2009年4月30日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；  
2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月，建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金第十二条（二）、（六）规定的比例。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理 魏基经小组 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	说明
魏基经	本基金的基金经理	2008年6月27日	18年	1992年7月1日	中国国籍，博士，持有基金从业人员资格证书，曾任1987-1989年担任比利时通用银行经济分析师，1989年起担任通用银行投资管理部首席投资经理，1989年起担任通用银行经济分析师，1997年起担任Fingem Belgium首席执行官，1999年加入海富通基金，历任海富通基金增长混合基金基金经理，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金基金经理，2006年3月至9月任海富通股票基金增长混合基金基金经理，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007年2月至2007年8月任海富通海富领先成长股票基金基金经理，2007年8月至2007年8月起兼任海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。  
2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人及报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
公司自成立以來，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，中国证监会对公平交易制度的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较  
根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 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情况  
随着国内经济企稳回升，A股市场在2009年第四季度稳步上升，深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出，极大的活跃了中小企业股的投资热度，并使得市场形成了深沪共振的格局。中央经济工作会议明确了明年将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，并将在2009年的基础上继续扩大内需，在政策刺激下，消费、电子、化工等行业有望明显复苏，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
报告期内，海富通中国海外精选股票基金基金净值增长率为11.24%，同期业绩比较基准收益率为9.54%，基金净值跑赢业绩比较基准1.70个百分点。

2010年第一季度中国宏观经济将继续保持高速增长的趋势，但2009年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期，市场对中央宏观调控政策出现超预期上调的预期而日渐增强，因而未来市场走势或将成为本基金投资决策中需要重点关注的因素，我们将继续秉承价值投资理念，保持对未来的重要预期，另外总账表明表示，应该大力发掘互联网、绿色经济、低碳经济、环保技术、生物医药、这些对改善未来环境和人类生活的一些重要领域。"我们应重点考虑由此带来的结构性机会。"

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

4.6 报告期内基金的投资策略和运作情况  
随着国内经济企稳回升，A股市场在2009年第四季度稳步上升，深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出，极大的活跃了中小企业股的投资热度，并使得市场形成了深沪共振的格局。中央经济工作会议明确了明年将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，并将在2009年的基础上继续扩大内需，在政策刺激下，消费、电子、化工等行业有望明显复苏，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

4.7 报告期内基金的业绩表现  
报告期内，海富通中国海外精选股票基金基金净值增长率为11.24%，同期业绩比较基准收益率为9.54%，基金净值跑赢业绩比较基准1.70个百分点。

2010年第一季度中国宏观经济将继续保持高速增长的趋势，但2009年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期，市场对中央宏观调控政策出现超预期上调的预期而日渐增强，因而未来市场走势或将成为本基金投资决策中需要重点关注的因素，我们将继续秉承价值投资理念，保持对未来的重要预期，另外总账表明表示，应该大力发掘互联网、绿色经济、低碳经济、环保技术、生物医药、这些对改善未来环境和人类生活的一些重要领域。"我们应重点考虑由此带来的结构性机会。"

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

4.8 报告期内基金的投资策略和运作情况  
随着国内经济企稳回升，A股市场在2009年第四季度稳步上升，深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出，极大的活跃了中小企业股的投资热度，并使得市场形成了深沪共振的格局。中央经济工作会议明确了明年将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，并将在2009年的基础上继续扩大内需，在政策刺激下，消费、电子、化工等行业有望明显复苏，对于前期处于调整状态下的行业将会受到政策调控的担忧情绪得到缓解，相关行业的表现明显好于大盘。

基于上述判断，在行业选择上，我们将重点关注受益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对抗跌属性的部分上游行业；国家经济结构调整扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续成长性的消费领域；另外，我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会，并从上市公司行业中发掘业绩优良成长性更佳的投资标的。

## 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	6,727,212,122.10	91.41
2	固定收益投资	6,727,212,122.10	91.41
3	其中：债券	-	-
4	其中：股票	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	532,346,857.71	7.23
8	其他资产	99,607,614.83	1.35
9	合计	7,359,166,904.64	100.00

## 5.2 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	530,053,021.49	7.34
B	制造业	3,283,121,219.49	44.83
C	食品饮料	304,542,596.38	4.16
D	化学、医药、生物	149,891,736.06	2.02
E	信息技术	37,492,683.30	0.51
F	金融、保险	-	-
G	房地产业	623,831,746.97	8.52
H	采掘业	171,274,873.08	2.34
I	建筑业	597,810,757.98	8.16
J	机械、设备、仪器	888,488,972.55	12.13
K	有色金属	503,402,354.56	6.88
L	其他	6,012,585.36	0.08
M	电力、煤气及水的生产和供应业	55,596,768.16	0.76
N	交通运输业	177,616,832.04	2.43
O	仓储业	171,274,873.08	2.34
P	批发和零售业	756,742,619.23	10.33
Q	房地产业	140,403,872.50	1.92
R	建筑业	782,625,180.52	10.69
S	金融、保险	266,655,618.01	3.64
T	其他	172,886,601.51	2.36
U	其他	128,553,784.78	1.72
V	其他	263,382,011.66	3.60
W	其他	6,727,212,122.10	91.87

## 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	600415	小商品城	4,095,553	138,194,085.69	2.50
2	601166	华彬矿业	4,179,233	168,464,882.23	2.94
3	600143	金发科技	14,643,676	154,783,655.32	2.71
4	600000	浦发银行	9,900,000	149,661,000.00	2.60
5	600858	海康光电	3,000,000	149,580,000.00	2.60
6	600983	西山煤电	3,714,357	148,773,678.73	2.62
7	600019	宝钢股份	5,600,000	145,544,000.00	2.59
8	601318	中国平安	2,509,946	143,231,025.14	2.56
9	000012	顺发股份	6,609,708	141,447,751.20	2.53
10	000063	中兴通讯	2,999,948	134,607,666.76	2.41

## 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十名债券投资明细

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	中期票据	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	-	-

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明细  
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证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

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权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

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明细  
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权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

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  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
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明细  
本基金本报告期末未持有权证。