

# 汇丰晋信双核策略混合型基金更新招募说明书摘要

(2016年第1号)

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司  
基金托管人：交通银行股份有限公司  
【重要提示】  
汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2014年10月8日证监许可[2014]1020号文注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺恪尽职守,诚实守信,谨慎勤勉地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。基金的投资业绩并不预示其未来表现。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持份额享受基金收益,但同时也承担着相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券市场产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金资产管理过程中产生的基金管理风险,某一基金的特定风险等。本基金为混合型基金,预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高风险收益特征的基础品种。投资有风险,投资人认购(申购)本基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年11月26日,有关财务数据和非财务数据截止日为2015年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况  
名称:汇丰晋信基金管理有限公司  
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼  
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼  
法定代表人:杨小勇  
成立日期:2005年11月16日  
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2005]1172号  
组织形式:有限责任公司  
注册资本:2亿元人民币  
存续期间:持续经营  
联系人:周慧  
联系电话:021-20376789  
股权结构:山西信托股份有限公司(以下简称“山西信托”)持有51%的股权,HSBC Global Asset Management (UK) Limited(汇丰环球投资管理(英国)有限公司)持有49%的股权。

网址: <http://bank.pingan.com/>  
山西证券股份有限公司  
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼  
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼  
法定代表人:侯巍  
联系人:张涵  
联系电话:0351-8686703  
传真:0351-8686619

客服电话:400-666-1618  
网址: [www.qlr.com.cn](http://www.qlr.com.cn)  
北方宏源证券有限公司  
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层  
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层  
法定代表人:李梅  
联系人:黄莹  
电话:021-33388888  
传真:021-33388224  
兴业证券股份有限公司  
注册地址:福州市湖东路268号  
办公地址:福州市湖东路268号  
法定代表人:兰荣  
联系人:杨盛芳  
电话:0591-87613888  
传真:0591-87646068  
客户服务电话:400-8888-123  
网址: [www.qlr.com.cn](http://www.qlr.com.cn)

中信证券股份有限公司  
注册地址:广东省深圳市福田区长沙路2008号招商银行大厦第8层  
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦  
法定代表人:王东明  
联系人:陈忠  
电话:010-84693903  
传真:010-84968660  
客服电话:010-94588888  
网址: [www.cscitec.com](http://www.cscitec.com)  
中信证券(山东)有限责任公司  
注册地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层  
办公地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层  
基金业务联系人:吴昊超  
电话:0631-86022326  
传真:0631-86022605  
客户服务电话:95564  
公司网址: [www.citicscf.com](http://www.citicscf.com)

深圳众成基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元  
法定代表人:胡皓  
客户服务电话:4006-788-887  
联系人:张玉琦  
电话:021-51160298  
网址: [www.zfund.com](http://www.zfund.com)及 [www.jmmw.com](http://www.jmmw.com)  
杭州数米基金销售有限公司  
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈柏青  
联系人:周煜雯  
客户服务电话:4000766123  
网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)  
渤海银行股份有限公司  
注册地址:天津市河西区马场道201-205号  
办公地址:天津市河西区马场道201-205号  
法定代表人:李伙安  
联系人:王宏  
电话:022-58316966  
传真:022-58316569  
客服电话:95541  
公司网址: [www.cbhb.com](http://www.cbhb.com)

上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区南京东路500号  
办公地址:上海市中山东二路12号  
法定代表人:高国琦  
电话:(021)61618888  
传真:(01)63604199  
联系人:汤康惠、盛云杏  
客户服务热线:95528  
公司网址: [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

东方证券股份有限公司  
注册地址:上海市中山北路318号2号楼21-29楼  
办公地址:上海市中山北路318号2号楼21-29楼  
法定代表人:潘鑫军  
联系人:吴宇、沈茜  
电话:021-63326889  
传真:021-63321177  
客服电话:95503  
公司网址: [www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)  
国金证券股份有限公司  
注册地址:成都市东城根上街95号  
办公地址:成都市东城根上街95号-16、17楼  
法定代表人:雷波  
联系人:金洁  
客户服务电话:400-660-0109  
公司网址: [www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)  
中信建投证券股份有限公司  
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址:北京市朝阳门内大街188号  
法定代表人:张佑君  
电话:4008888108  
传真:010-65818261  
联系人:权恒  
网址: <http://www.csc108.com>

上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区银城中路80号15-22楼、22-27楼  
办公地址:上海市银城中路80号中融碧玉天地大厦16层  
法定代表人:胡平西  
联系人:牛珊珊  
电话:021-38576666  
传真:021-60105124  
客服电话:021-9625299  
公司网址: <http://www.arch.com>  
长江证券股份有限公司  
注册地址:武汉市新华路特号长江证券大厦  
办公地址:武汉市新华路特号长江证券大厦  
法定代表人:胡圣杰  
电话:021-68751929  
联系人:李晨  
客户服务电话:95579  
网址: <http://www.95579.com>  
国泰君安证券股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区商城路618号  
办公地址:上海市浦东新区商城路618号上海银行大厦20楼  
法定代表人:胡平西  
联系人:芮敏琦  
电话:021-38676161  
传真:021-38676161  
客服电话:400-0898-666  
网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

中国银行股份有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街25号  
办公地址:北京市西城区南口大街1号院1号楼  
客户服务电话:95533  
传真:010-66218888  
网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)  
招商证券股份有限公司  
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层  
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层  
法定代表人:宫少林  
联系人:林生迎  
电话:0755-82943666  
传真:0755-82943636  
客服电话:400-8888-111,95565  
网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)  
光大证券股份有限公司  
注册地址:上海市静安区新闸路1508号  
办公地址:上海市静安区新闸路1508号  
法定代表人:徐浩明  
联系人:刘鹏、李芳芳  
电话:021-22168900  
传真:021-22169134  
客户服务电话:95525,10108998  
网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)  
汇丰银行(中国)有限公司  
注册地址:上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层  
办公地址:上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层  
法定代表人:黄碧娟  
公司网址: [www.hsbc.com](http://www.hsbc.com)  
客服电话:卓越理财客户 800-820-8828(限中国内地陆线)  
(+86)-(21)-3888 8828(适用于境外或移动电话)  
运筹理财客户 800-820-8878(限中国内地陆线)  
(+86)-(21)-3888 8878(适用于境外或移动电话)  
非中文个人客户 800-010-430-2880(限中国内地陆线)  
(+86)-(21)-3888 3015(适用于境外或移动电话)  
平安银行股份有限公司  
注册地址:深圳市福南中路1009号平安银行大厦  
法定代表人:孙建一  
客户服务电话:95511-3  
公司网址: [www.pstcs.com.cn](http://www.pstcs.com.cn)

上海天天基金销售有限公司  
注册地址:上海浦东新区峨山路613号66幢5-12室  
法定代表人:其实  
联系人:宋姝  
客户服务电话:400-1818-188  
网址: [www.123467.com.cn](http://www.123467.com.cn)  
上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室  
法定代表人:杨文斌  
联系人:薛彤  
客户服务电话:400-700-9665  
网址: [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

诺亚正行(上海)基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室  
法定代表人:杨文斌  
联系人:薛彤  
客户服务电话:400-700-9665  
网址: [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)  
中国国际金融股份有限公司  
注册地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
法定代表人:李钢  
联系人:姚思琦  
公司网址: [www.cicc.com](http://www.cicc.com)  
客户服务热线:400-821-5399  
和讯信息科技有限公司  
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
法定代表人:王莉  
联系人:周旋  
公司网站: [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)  
客服电话:4009-200-022  
中国国际金融股份有限公司  
注册地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
法定代表人:李钢  
联系人:姚思琦  
客服电话:400 910 1166  
公司网址: [www.cicco.com](http://www.cicco.com)

东兴证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层  
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层  
法定代表人:魏庆华  
联系人:陈琳  
电话:010-66555117  
传真:010-66555134  
客户服务电话:4008888993  
网址: [www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)  
申万宏源证券股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区高东路1277号  
办公地址:上海市浦东新区高东路1277号  
法定代表人:李季  
联系人:唐凯  
电话:010-88082528  
传真:010-88013605

(二)注册登记机构  
名称:汇丰晋信基金管理有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼  
法定代表人:杨小勇  
联系人:赵琳  
联系电话:021-20376892  
(三)出具法律意见书律师事务所  
名称:上海市锦泰律师事务所  
地址:上海市浦东新区南汇路266号华夏银行大厦14层  
负责人:陈海  
电话:021-51150028  
传真:021-51160398  
联系人:刘佳  
经办律师:廖海、刘佳  
(四)审计基金财产的会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中11楼  
法定代表人:杨劲松  
联系电话:021-2323 8888  
传真电话:021-2323 8900  
经办注册会计师:薛薇、赵钰  
联系人:赵钰

四、基金的名称  
汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金

五、基金的类型  
混合型证券投资基金  
六、基金的投资目标  
本基金致力于挖掘股票、债券市场中阶段性的投资机会,对于股票投资部分,基于汇丰“profitability-valuation”选股逻辑,筛选出低估值、高盈利股票;在债券投资上,遵循稳健投资的原则,以追求超越业绩基准的长期投资收益。

七、基金的投资方向  
本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家法律法规允许基金品种的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。股票投资比例为:股票资产比例范围为基金资产的30%-95%,除股票以外的其他资产投资比例为5%-70%,权证投资比例范围为基金资产的0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金依据法律法规的规定,本着谨慎和风险可控的原则,可参与创业板上市证券的投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略  
1. 大类资产配置策略  
本基金借鉴汇丰银行的投资理念和流程,基于多因素分析,对权益类资产、固定收益类及现金类资产比例进行动态调整。具体而言,本基金将通过分析宏观经济、资金流动性、上市公司整体盈利水平、市场估值水平、基于技术分析及成交量趋势分析、市场情绪、政策面、海外市场等因素进行跟踪,全面评估上述因素的关键指标及其变动趋势,以最终确定大类资产的配置权重,实现资产合理配置。

2. 股票投资策略  
本基金充分借鉴汇丰集团的投资理念和流程,依据中国资本市场的具体特征,引入集团在海外市场成功运用的“Profitability-Valuation”投资策略。通过基础研究,我们认为:  
(1)中国市场是一个弱有效的市场。效率低下是由于缺乏投资者,以及其发展中国性质和受限的原因。  
(2)我们相信中国市场是成长型的,它会受到股市收益的推动,但目前存在估值定价的泡沫。  
(3)目前市场上的管理者拥有丰富的经验,能够有力地把握定价错误,提高可持续性投资回报的可能性。本基金运用的“Profitability-Valuation”是一个通用的概念(PB、PE、EV为典型的估值维度与EBIT、ROE为典型的盈利维度),其分别反映公司的盈利(估值维度)和反映公司盈利能力(盈利维度)。基金管理人力求通过遵循严格的投资纪律,这两个维度中选出高盈利且有低估值优势的股票的构成投资组合。该核心组合的具体构建流程如下:  
1)以本基金全市场股票作为初始投资组合;  
2)对初始池中个股进行流动性测算,并剔除市值过小,流动性较差的股票,形成一级备选库;  
3)利用公司内部及海外研究员数据,对一级备选库中股票未来估值指标及盈利指标进行测算,并构建“估值-盈利”二维模型;  
4)依据二维模型,对所选个股进行回归分析,并根据二维指标进行综合排名,挑选出综合排名靠前的股票作为二级备选库;

5)公开调研团队将纳入二级备选库的个股基本面进行重新审核。通过对上市公司的行业特性、盈利模式、经营管理体系及公司治理状况等因素进行综合分析,考察上市公司的高管能力及持续成长能力,剔除上市公司在公司治理、企业经营及财务报告等方面存在潜在问题的上市公司,形成核心备选库。  
(6)核心备选库中个股与行业的权重以该股票在比较基准中的权重做参考,可有一定范围的浮动。在极端情况下,若核心备选库某一行业个股数或个股权重不足,可将该行业二维综合排名最高的相关个股纳入核心备选库,以满足行业分散及个股分散的目的。

本基金将持续优化“Profitability-Valuation”投资策略,针对上述策略的具体指标和权重,本基金可根据市场环境进行适度优化和挑战,以谋求超越业绩比较基准的稳定回报。  
3. 债券投资策略  
本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时,充分利用固定收益类资产的投资机会,提高基金投资收益,并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上,将采用自上而下的投资策略,通过对未来利率形势、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析,积极投资,获取超额收益:  
(1)利率趋势预测  
准确预测未来利率趋势将为债券投资带来超额收益。本基金将密切关注宏观经济运行状况,全面分析货币政策、财政政策和汇率政策变化情况,把握未来利率走势,在预期利率下降时加大债券投资久期,在预期利率上升时适度缩短久期,规避利率风险,增加投资收益。  
(2)收益曲线变动策略  
收益曲线反映了债券期限回报率之间的关系。投资研究部门通过预期收益率曲线形状的变化,调整债券投资组合长期期限结构,以获取预期超额收益。  
(3)收益利差分析  
在跟踪和分析同一市场不同板块之间(比如国债与金融债)、不同市场同一品种、不同市场的不一样板块之间的收益率利差基础上,投资部门采取积极策略选择合适品种进行交易所获投资收益。在正常情况下它们之间的收益率利差是稳定的,但是在某种情况下,比如某个行业在经济周期的某一期而信用风险改变或市场预期供求发生变化时,这种稳定关系会被打破,若能提前预测并进行交易,就可进行套利或减少损失。

(4)公司基本面分析  
公司基本面分析是公司债信可转换投资决策的重要决定因素。研究部门对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理效率、所处行业运营状况等因素进行“质”和“量”的综合分析,并结合实际调研结果,准确评价该公司债券的信用风险程度,作出价值判断。对于可转换,通过判断正股的价格走势及其与可转换债券市价的联动关系,从而取得转债溢价率的价格优势进行套利。  
4. 权证投资策略  
本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下,对权证进行主动投资。基金的权证投资策略主要包括以下几个方面:  
(1)综合衡量权证标的股票的综合内在价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动和无效风险收益等要素,运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。  
(2)根据权证的综合内在价值与其市场价格间的差距即“估值溢价”以及权证合同内在价值对定价参数的敏感性,结合标的股票综合内在价值的考量,决策买入、持有或卖出权证。  
(3)通过权证与证券的组合投资,利用权证衍生工具的特性,来达到改善组合风险收益特征的目的。  
(4)支持证券价格策略  
本基金将严格遵守相关法律法规和基金合同的约束,秉持稳健投资原则,综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等策略,在严格控制风险的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得基金资产的长期稳健回报。

九、基金的风险收益特征  
业绩比较基准 = 中证300指数\*60%+中债综合指数\*40%  
本基金是一只混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高风险收益特征的基金品种。

十、基金的投资组合报告  
本基金的董事会及董事保证基金投资组合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。  
本基金的投资人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10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。  
本投资组合报告的报告期为2015年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。  
10.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	309,327,273.11	62.07
2	固定收益投资	309,327,273.11	62.07
3	银行存款	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	其他资产	161,404,893.71	32.16
7	其他负债	879,398.24	0.18
8	合计	618,654,517.22	100.00

10.2报告期末按行业分类的股票投资组合  
本基金本报告期末未持有股票。

10.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

10.4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。

10.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细  
本基金本报告期末未持有债券。

10.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

10.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

10.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
10.10.1本报告期内股指期货投资政策  
本基金本报告期末未持有股指期货。  
10.10.2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。  
10.10.3股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.10.4报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.10.5本报告期内国债期货交易政策  
本基金本报告期末未持有国债期货。  
10.10.6报告期内国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。  
10.10.7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。  
10.10.8股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除华泰证券股份有限公司(601868)外,没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
根据华泰证券股份有限公司(以下简称“华泰证券”)于2015年8月26日发布的《关于收到中国证监会调查通知书的公告》,华泰证券于2015年8月24日收到中国证监会《调查通知书》(编号:沪证调查字20150044号),因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。根据华泰证券于2015年9月12日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书公告》,公司于2015年8月10日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]172号),拟对公司采取责令改正、给予警告,没收违法所得18,226,275.00元,并处154,705,825.00元罚款。本公司会紧密跟踪并及时调整相应投资决策,截至目前,本基金对华泰证券的投资决策流程符合本公司规定。

10.11.2 本报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。  
10.11.3 本报告期内,本基金投资的前十名证券构成

10.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有可转换债券。  
10.11.5 报告期末持有的资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
10.11.6 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。  
10.11.7 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.8 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。  
10.11.9 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.10 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。  
10.11.11 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.12 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。  
10.11.13 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.14 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。  
10.11.15 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.16 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。  
10.11.17 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.18 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。  
10.11.19 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.20 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。  
10.11.21 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.22 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。  
10.11.23 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.24 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。  
10.11.25 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.26 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。  
10.11.27 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.28 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。  
10.11.29 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.30 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。  
10.11.31 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.32 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。  
10.11.33 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.34 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。  
10.11.35 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.36 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。  
10.11.37 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.38 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。  
10.11.39 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.40 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。  
10.11.41 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.42 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。  
10.11.43 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.44 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。  
10.11.45 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.46 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。  
10.11.47 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.48 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。  
10.11.49 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.50 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。  
10.11.51 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.52 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。  
10.11.53 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.54 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。  
10.11.55 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.56 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。  
10.11.57 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.58 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。  
10.11.59 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.60 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。  
10.11.61 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.62 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。  
10.11.63 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.64 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。  
10.11.65 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.66 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。  
10.11.67 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.68 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。  
10.11.69 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.70 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。  
10.11.71 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.72 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。  
10.11.73 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.74 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。  
10.11.75 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.76 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。  
10.11.77 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.78 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。  
10.11.79 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.80 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。  
10.11.81 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.82 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。  
10.11.83 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.84 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。  
10.11.85 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.86 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。  
10.11.87 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.88 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。  
10.11.89 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.90 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。  
10.11.91 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.92 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。  
10.11.93 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.94 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。  
10.11.95 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.96 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。  
10.11.97 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.98 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。  
10.11.99 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.100 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。  
10.11.101 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.102 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。  
10.11.103 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.104 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。  
10.11.105 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.106 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。  
10.11.107 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.11.108 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。  
10.11.109 股指期货投资评价  
本基金本报告期末未持有股指期货。