

# 万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016年第1号)

**基金管理人: 万家基金管理有限公司**  
**基金托管人: 上海银行股份有限公司**  
**二零一六年二月**

## 重要提示

万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年6月4日经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1147号文注册募集,基金合同生效日为2015年7月23日。

基金管理人保证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。

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,投资人在投资本基金前,应仔细阅读基金合同、本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)本基金的风险、时机、数量等投资行为作出独立、谨慎决策。投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金在投资运作过程中可能面临各种风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格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,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。本基金是混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品种。投资人应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金基金合同。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年1月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据未经审计)。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称: 万家基金管理有限公司  
 住所: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)  
 办公地址: 上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9层  
 法定代表人: 方一天  
 成立日期: 2002年8月23日  
 批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字【2002】44号  
 经营范围: 基金募集;基金销售;资产管理和中国证监会许可的其他业务  
 组织形式: 有限责任公司  
 注册资本: 壹亿元人民币  
 存续期间: 持续经营  
 联系人: 兰剑  
 电话: 021-38909626 传真: 021-38909627  
 二、主要人员情况  
 1、基金管理人董事会成员  
 董事长方一天先生,大学本科,学士学位,先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职,2014年10月加入万家基金管理有限公司,2014年12月起任公司董事,2015年2月起任公司总经理,2015年7月起任公司董事长。  
 董事马永春先生,政治经济学硕士学位,曾任新疆自治区党委政策研究室科长,新疆通宝投资有限公司总经理,新疆对外经贸集团总经理,新疆天山股份有限公司董事,现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。  
 董事袁西存先生,中共党员,研究生,工商管理学硕士,曾任莱钢集团财务部部长、副部长,齐鲁证券有限责任公司计划财务部总经理,现任中泰证券股份有限公司财务总监。  
 独立董事陈增敬先生,中国民主建国会成员,博士研究生,教授,曾任山东大学数学学院讲师兼副教授,法国国家信息与自动化研究所博士后,加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授,山东大学金融研究院(现更名为山东大学中泰证券金融研究院)常务副院长兼教授,现任山东大学中泰证券金融研究院院长兼数学学院副院长、教授。  
 独立董事骆玉鼎先生,中共党员,研究生,经济学博士,副教授,曾任上海财经大学金融学院银行系讲师,上海财经大学证券期货学院副教授、副院长,美国国际管理研究生院(雷鸟)访问研究员,上海财经大学证券期货学院副院长兼副教授,新疆财经大学金融系专任教师,上海财经大学金融学院副院长、常务副院长,上海财经大学金融学院副教授,现任上海财经大学金融学院院长。

独立董事黄磊先生,中国民主建国会成员,经济学博士,教授,曾任贵州财经学院财政金融系教师、山东财经大学金融学院院长、山东省政协常委,现任山东财经大学资本市场研究中心主任、山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员、教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。  
 2、基金管理人监事会成员  
 监事会主席李涌起先生,硕士学位,经济师。曾任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部门经理,新疆国际实业股份有限公司证券事务代表,现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。  
 监事张浩先生,中共党员,管理学博士,先后任职于山东东银投资管理有限公司,山东省国有资产控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司综合部(党委办公室)部长(主任)。  
 监事李丽女士,中共党员,硕士,中级讲师,先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起加入本公司,现任公司综合管理部总监。  
 监事蔡鹏鹏女士,本科,先后任职于北京幸福之光商贸有限公司、北方之星数码技术(北京)有限公司、路通资讯香港有限公司,2007年4月起加入本公司,现任公司机构理财部总监。

监事陈广益先生,中共党员,硕士学位,先后任职于苏州市对外贸易公司、兴业全球基金管理有限公司,2005年3月起任职于万家基金管理有限公司,现任公司运营部总监。  
 3、基金管理人高级管理人员  
 董事长:方一天先生(简介请参见基金管理人董事会成员)  
 总经理:方一天先生(简介请参见基金管理人董事会成员)  
 副总经理:李杰先生,硕士研究生,1994年至2003年任职于国泰君安证券,从事行政管理、机构客户开发等工作;2003年至2007年任职于兴安证券,从事营销管理工作;2007年至2011年任职于齐鲁证券,任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入本公司,曾任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理,2013年4月起任公司副总经理,2014年10月至2015年2月任代任公司总经理。  
 督察长:兰剑先生,法学硕士,律师,注册会计师,曾在江苏安业知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作,2005年10月进入万家基金管理有限公司工作,2015年4月起任公司督察长。

### 4、本基金基金经理简历

莫海波, 投资研究部总监, MBA, 2010年进入财富证券责任有限公司,任分析师、投资经理助理;2011年进入中银国际证券有限责任公司基金,任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理。2015年3月加入本公司,现任投资研究部总监、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金基金经理,万家品质生活股票型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴产业优选混合型证券投资基金、万家品质生活股票型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。  
 历任基金经理:  
 高翰昆,本基金成立时起至2015年12月任本基金基金经理。  
 5、投资决策委员会成员  
 委员会主任:方一天  
 委员会副主任:黄海、陈工文  
 委员:罗毅、张军、莫海波、白宇、下勇  
 方一天先生,万家基金管理有限公司董事长兼总经理  
 黄海先生,公司投资总监。  
 陈工文先生,公司总经理助理、专户投资经理。  
 罗毅先生,公司总经理助理。  
 张军先生,公司总经理助理。  
 莫海波先生,投资研究部总监、万家和谐增长混合型证券投资基金基金经理、万家精选股票型证券投资基金基金经理、万家行业优选股票型证券投资基金基金经理、万家品质生活股票型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称: 上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)  
 住所: 上海市浦东新区银城中路168号  
 办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号  
 法定代表人: 金煜  
 成立时间: 1995年12月29日  
 组织形式: 股份有限公司  
 注册资本: 人民币54.04亿元  
 存续期间: 持续经营  
 基金托管业务批准文号: 中国证监会 证监许可[2009]814号  
 托管部门联系人: 叶叶红  
 电话: 021-68475888  
 传真: 021-68476936  
 2、主要人员情况  
 上海银行总行下设资产托管理部,从事资产托管业务的职能部门,内设产品管理部、托管运作部(下设托管运作团队和运行保障团队)、稽核监督部,平均年龄30岁左右,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。

3、基金托管业务经营情况  
 上海银行于2009年8月18日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务,批准文号:中国证监会证监许可[2009]814号。  
 截至2015年底,上海银行已托管17只证券投资基金,分别为天治成长精选混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)、中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利债券型证券投资基金、浦银安盛季添利定期开放债券型证券投资基金、鹏华双债保利债券型证券投资基金、鹏华丰信分级债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵珑配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、华安添颐养老混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金,博时裕荣纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金,托管基金的资产净值合计153.7亿元。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为万家基金管理有限公司以及该公司的网上交易平台。  
 住所、办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)

法定代表人: 方一天  
 联系人: 李忆莎  
 电话: (021)38909771  
 传真: (021)38909778  
 客户服务热线: 400-888-0800; 95538转6  
 投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅基金管理人的网站公告。网上交易网址: https://trade.wjasset.com/  
 2、代销机构  
 (1) 上海银行股份有限公司  
 住所: 上海市浦东新区银城中路168号  
 办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号  
 法定代表人: 金煜  
 客户服务热线: 95594  
 网址: www.bankofshanghai.com  
 (2) 浙江同花顺基金销售有限公司  
 客服电话: 4008-773-772  
 网址: http://fund.10jqka.com.cn  
 (3) 上海天天基金销售有限公司  
 客服电话: 400-1818-188  
 网址: www.1234567.com.cn  
 (4) 北京乐融多源投资管理有限公司  
 客户服务电话: 400-068-1176  
 网址: www.jimubox.com  
 (5) 国金证券股份有限公司  
 客户服务电话: 400-660-0109  
 网址: www.gjzq.com.cn  
 (6) 上海好买基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-700-9665  
 网址: www.ehowbuy.com  
 (7) 大泰金石投资管理有限公司  
 客户服务电话: 021-22267982  
 网址: www.dtfortune.com  
 (8) 上海利得基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-067-6266  
 网址: http://mleadfund.com.cn  
 http://admin.leadfund.com.cn  
 (9) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
 客户服务电话: 400-821-5399  
 网址: www.noah-fund.com  
 (10) 盈米财富管理有限公司  
 客户服务电话: 020-89629066  
 网址: www.yingmi.cn  
 (11) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
 客户服务电话: 400-166-1188  
 网址: http://8jrj.com.cn/  
 (12) 杭州数米基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-076-6123  
 网址: www.fund123.cn  
 二、基金登记机构  
 名称: 中国证券登记结算有限责任公司  
 注册资本: 6亿元  
 注册地址: 北京市西城区太平桥大街17号  
 组织形式: 有限责任公司  
 营业期限: 长期  
 电话: (010)58598839  
 传真: (010)58598834  
 三、出具法律意见书的律师事务所  
 名称: 北京大成(上海)律师事务所  
 住所: 上海市世纪大道100号上海环球金融中心24层(200120)  
 经办律师: 夏火钊、华涛  
 电话: (021)3872 2416  
 传真: (021)5878 6866  
 联系人: 华涛  
 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(特殊普通合伙)  
 住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室(邮编: 100738)

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼(邮编: 200120)  
 联系电话: (021)22288888  
 传真: (021)22280000  
 联系人: 汤骏  
 经办注册会计师: 汤骏

## 第四部分 基金的投资目标

本基金投资于具有成长潜力的上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。

## 第五部分 基金的投资范围

本基金的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

的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(含

中小企业私募债、证券公司短期公司债券)、货币市场工具、权证、股指期货、资

产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符

合中国证监会相关规定)。

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。

股票投资占基金资产的0%-95%。其中,基金持有单只股票的市值不超过

基金资产净值的3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交

易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内

的政府债券;股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管

机构的规定。

## 第六部分 基金的投资策略

### 一、资产配置策略

基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动的投资管理策略,通过定性定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。

### 二、股票投资策略

本基金主要投资于具有较高成长性且估值有吸引力的公司股票。本基金从定性和定量两个方面来把握投资对象的特征:

(1) 定性方面  
 具有良好的公司治理结构,信息透明,注重公众股东利益和投资人关系;具有优秀、较为稳定的管理层,管理规范进取,能适应不断发展的公司规模;财务透明、清晰,资产质量及财务状况较好;在生产、技术、市场、政策环境等经营层面具有一方面或几方面竞争优势;有清晰的增长战略,并与其现有的竞争优势相契合。

(2) 定量方面  
 已具备历史成长性,历史每股主营业务收入、EPS等财务指标已具有成长性;未来成长性持续,预期每股主营业务收入增长率和预期EPS增长率等指标高于行业平均水平;

为达精选之目的,本基金结合定量分析和定性分析,构建过滤模型来动态建立和维护核心股票库,从而精选出具有较高成长性且估值有吸引力的公司股票进行投资布局;同时将风险管理意识贯穿于股票投资过程中,对投资标的进行持续严格的跟踪和评估。

### 三、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险,追求稳定的风险调整后收益。

### 四、普通债券投资策略

在债券投资部分,本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上,对影响个别债券定价的主要因素,包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、赋税、含权等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

### 五、中小企业私募债券债券投资策略

本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价等策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别注重中小企业私募债券的信用风险和流动性管理,本着风险调整后收益最大化的原则,确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例,保证本金相对安全和资产流动性,以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中,将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响,分散投资,确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性;同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素,并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券进行深入研究,由债券研究员根据公司内部《信用评级库管理办法》对中小企业私募债券的信用评级和投资价值进行分析并给予内部信用评级和投资评级。本基金可投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券;对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券,禁止进行投资。

### 六、资产支持证券投资策略

本基金将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

### 七、证券公司短期公司债券投资策略

本基金在对证券公司短期公司债券特点和发行债券公司基本面上进行深入研究分析的基础上,通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其投资价值;采用多种定价模型以及研究人员对证券公司基本等不同变量的研究确定其投资价值。投资综合实力较强的证券公司发行的短期公司债券,获取稳健的投资回报。

### 八、股指期货投资策略

在股指期货投资上,本基金以避险保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中,将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究股指期货市场的发展趋势,运用定价模型对其进行合理估值,谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调整投资组合仓位,以降低组合风险、提高组合的运作效率。

### 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率\*50% + 中证全债指数收

益率\*50%

沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性和市场流动性。沪深300指数与市场整体表现具有较高的相关性,且指数历史表现强于市场平均收益水平,具有良好的投资价值。该指数由中证指数公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护,编制方法的透明度高,具有独立性。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,具有很高的权威性。综合考虑本基金资产配置与市场指数代表性等因素。

本基金选用沪深300指数和中证全债指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

### 第十部分 基金的风险收益特征

本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票

型基金,属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

### 第十一部分 基金的投资组合报告

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。  
 基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年2月22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2015年12月31日,本报告中列示财务数据未经审计。

#### 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	34,125,275.05	46.83
	其中:股票	34,125,275.05	46.83
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	36,231,117.45	49.72
8	其他资产	2,513,562.66	3.45
9	合计	72,869,955.16	100.00

#### 2.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	1,373,376.00	1.92
C	制造业	9,100,117.28	12.69
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	--	--
E	建筑业	7,666,838.93	10.69
F	批发和零售业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	3,116,042.52	4.36
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	--	--
J	金融业	--	--
K	房地产业	11,179,185.52	15.50
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	1,690,714.80	2.36
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	--	--
O	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
	合计	34,125,275.05	47.60

#### 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	600048	保利地产	417,400	4,441,136.00	6.20
2	000488	晨鸣纸业	419,025	3,737,703.00	5.21
3	000402	金融街	287,900	3,319,487.00	4.63
4	001979	招商蛇口	117,282	2,446,502.52	3.41
5	000828	中国国际	103,013	1,822,289.97	2.54
6	300294	苏交科	77,985	1,690,714.80	2.36
7	601669	中国电建	208,300	1,672,649.00	2.33
8	600418	江淮汽车	112,764	1,645,226.76	2.29
9	600497	驰宏锌铟	124,400	1,373,376.00	1.92
10	600068	贵州兴	160,300	1,261,561.00	1.76

#### 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五名债券投

### 资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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十名资产支持证券投资

### 投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投

### 资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
 本基金本报告期末未持有股指期货。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
 本基金本报告期末未持有国债期货交易。

### 10、投资组合报告附注

(1) 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 报告期末的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票

### 库之外的股票。

### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	100,581.48
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	7,583.34
5	应收申购款	2,405,387.84
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	2,513,562.66

(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处于转股期的可转换债券。

(5) 基金投资前十名股票中存在流通受限情况的说明  
 本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

## 第十二部分 基金的业绩