

财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

(2017年第1号)



财通证券资产管理有限公司
CAITONG SECURITIES ASSET MANAGEMENT CO., LTD.

基金管理人:财通证券资产管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
二〇一七年一月

【重要提示】
财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经2016年5月27日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2016】1156号文准予募集注册。本基金的基金合同于2016年7月19日正式生效。

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。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全部取回其原本投资。

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。投资者在投资本基金前,需充分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,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持份额享受基金的收益,但同时需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险;基金管理人及基金托管人产生的基金管理人风险;由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险;交易对手违约风险;投资国债期货的特定风险;投资本基金特有的其他风险等等。本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

本基金为发起式基金,在基金募集时,基金管理人运用其固有资金认购本基金份额的金额不低于1000万元,认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不低于3年。但基金管理人对本基金的发起认购,并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证,发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿,投资者及发起资金认购人均自行承担投资风险。基金管理人认购的本基金份额持有期限自基金合同生效日起满3年后,基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有,届时基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。另外,在基金合同生效满3年之日(指自然日),如果本基金的资产规模低于2亿元,本基金将按照基金合同约定的程序进行清算并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。因此,投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

投资者有风险,投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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,并阅读《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规范性文件,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,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止至2017年1月18日,基金投资组合报告截止至2016年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:财通证券资产管理有限公司
住所:浙江省杭州市上城区白云路26号143室
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心28层
邮政编码:310007
法定代表人:马晓立
成立时间:2014年12月15日
注册资本:人民币2亿元
存续期间:持续经营
联系人:陈希
电话:(021)20568368
股东情况:财通证券股份有限公司持有公司100%的股权。
公司前身是财通证券股份有限公司资产管理部,经中国证监会监督管理委员会《关于核准财通证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》(证监许可[2014]1177号)批准,由财通证券股份有限公司出资2亿元,在原财通证券股份有限公司资产管理部的基础上正式成立。

(二)主要成员情况

1.基金管理人董事会成员

马晓立先生,董事长,1973年10月出生,中共党员,经济学硕士。历任中信证券研究所行业部经理,中信证券研究所总监、执行总经理,中合证券交易与衍生品部副总经理,财通证券股份有限公司资产管理部总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事长、总经理。

裴根财先生,董事,1966年2月出生,中共党员,国际金融硕士。历任浙江证券营业部总经理助理,浙江证券上海昆山路证券营业部总经理,方正证券机构管理部、营销中心总经理,华西证券杭州学院路证券营业部总经理,财通证券有限责任公司总经理助理兼经纪业务总部总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事、财通证券股份有限公司总经理助理兼经纪业务总部总经理。

曹勇华先生,董事,1975年9月生,经济学学士、法学学士。历任财通证券经纪有限责任公司风险管理部总经理助理,财通证券有限责任公司合规部总经理助理、副总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事、财通证券股份有限公司合规部总经理。

杨梅女士,董事,1974年9月出生,工商管理硕士。历任联合证券有限责任公司总经理助理,宝钢集团有限公司投资总监,华宝证券有限责任公司总经理助理,华宝证券有限责任公司董事长。现任财通证券资产管理有限公司董事。

赵明先生,董事,1967年9月出生,经济学硕士。历任宝钢集团投资部首席策略师,华宝证券投资部总经理,上海汇利资产管理公司副总经理,平安资产管理公司投资决策委员会主席兼宏观策略部总经理、投后投资部总经理,财通证券股份有限公司资产管理部副总经理兼首席投资官。现任财通证券资产管理有限公司董事、副总经理兼首席投资官。

2.基金管理人监事

周志远先生,监事,1983年9月出生,中国民主建国会会员,硕士研究生。历任天安保险股份有限公司资产管理部金融工程兼债券交易,中欧基金管理有限公司高级债券交易员,国联安基金管理有限公司债券研究员、基金经理,现任财通证券资产管理有限公司职工监事、总经理助理。

3.经营管理层人员

马晓立先生,总经理(简历请参见上述关于董事长的介绍)。
赵明先生,副总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。
李红芸女士,副总经理,1971年8月出生,中共党员,经济学学士,会计师。历任财通证券有限责任公司会计核算部负责人,财通证券有限责任公司计划财务部总经理助理、副总经理,财通证券股份有限公司资产管理部副总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事兼董事会秘书、副总经理兼财务总监。

钱女士,副总经理,1978年1月出生,上海财经大学经济学硕士,国际注册内部审计师/会计师。曾任东方证券股份有限公司稽核总部、合规与风险管理部高级主管,东方证券资产管理有限公司督察长兼合规与风险管理部总监。现任财通证券资产管理有限公司副总经理、首席风险官、合规总监兼公募基金管理合规负责人。

4.本基金基金经理

(1)现任基金经理
张波女士,基金经理,中南财经政法大学财政学学士。2007年8月至2013年8月期间于平安资产管理有限责任公司担任集中交易部债券交易员,2014年7月至2016年5月期间担任平安养老保险股份有限公司资产管理部债券交易员。自2016年8月起担任财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金经理至今,自担2016年10月起担任财通资管睿家货币市场基金基金经理至今。
(2)历任基金经理
吴士金先生,2016年7月至2016年9月担任财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金经理。
5.固收公募业务投资决策委员会成员
委员:马晓立(董事长、总经理)
张波(基金经理)

周庆(高级产品经理)

上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1.基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:(010)66105799
联系人:郭明

2.主要人员情况

截至2016年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工207人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3.基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者提供托管服务以及企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富、成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、ODII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、ODII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2016年12月,中国工商银行共托管证券投资基金681只。自2003年以来,本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的51项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1.直销机构:
本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上直销交易平台。
名称:财通证券资产管理有限公司
住所:浙江省杭州市上城区白云路26号143室
杭州办公地址:浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院3幢
上海办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心28层

法定代表人:马晓立

成立时间:2014年12月15日
杭州直销柜台联系人:毛卫娟、何倩倩
电话:(0571)89720012、(0571)89720022
传真:(0571)85104360
上海直销柜台联系人:吴晓晓
电话:(021)20668211、(021)20668225
传真:(021)68753502
客户服务热线:95336
网址:www.ctzg.com

个人投资者可以通过基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的认购、申购、赎回等业务,具体交易细则请参阅基金管理人网站。

2.其他销售机构

(1)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
联系人:杨菲
电话:(010)66107900
传真:(010)66107914
客服电话:95588
网址:www.icbc.com.cn
(2)财通证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716室
办公地址:浙江省杭州市上城区白云路26号143室
501,502,1103,1601-1615,1701-1716室
法定代表人:沈继宁
联系人:章力群
电话:(0571)87825100
客服电话:95336
网址:www.ctsec.com

(3)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号东方财富大厦金座
法定代表人:其实
联系人:胡润
电话:(021)54509988
传真:(021)64385308
客服电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn

(4)北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦10层1008号

法定代表人:赵荣春

联系人:崔丁人
电话:(010)57418813
传真:(010)574569671
客服电话:4008936885
公司网址:www.qianjing.com

(5)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:上海市市长宁区福泉北路518号8号楼3层
办公地址:上海市市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
联系人:兰敏
电话:(021)52822063
传真:(021)52975270
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.66zichan.com

(6)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:杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼4楼
法定代表人:凌顺平
联系人:吴强
电话:(021)52822063
传真:(021)52975270
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.5ifund.com

(7)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座2楼

法定代表人:陈柏青

联系人:韩爱彬
电话:(0571)26888888-37494
客服电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

(8)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:金煜
联系人:王奕
电话:021-68475732
客服电话:95594
网址:www.bankofshanghai.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构销售本基金,并及时公告。
(二)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)50938907
联系人:赵亦清

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:郭明

(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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:赵钰
经办注册会计师:薛炎、赵钰

四、基金的名称

财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金
五、基金的类型
债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

在有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货以及经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)。

基金的投资组合比例为:
本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%,其中基金持有的全部权证的市场价值不超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的保证金后,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%。

八、基金的投资策略
本基金将充分发挥基金管理人的投研能力,采取自上而下的方法对基金的大类资产配置,综合中长期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选,力争在严格控制风险的基础上,获取长期稳定超额收益。另外,本基金可投资于股票、权证等权益类资产,基金管理人将选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资,强化基金的获利能力,提高预期收益水平,以期达到收益增强的效果。

1.资产配置策略
本基金将采用自上而下的方法,在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主题的基础上,对市场基本利率和债券类、货币类、权益类大类资产配置率水平变化进行评估,并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,针对不同行业、不同投资品种选择投资策略,以此做出最佳资产配置及风险控制。

2.固定收益类投资策略
(1)普通债券投资策略
1)久期控制:根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险。
2)期限结构配置:在确定组合久期后,基金管理人将针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等,在长期、中期与短期债券间进行动态调整,从中、短、长期债券的相对价格变化中获利。
3)市场比较:不同债券子市场的运行规律不同,本基金在充分研究不同债券子市场风险-收益特征、流动性特性的基础上构建和调整组合(包括跨市场套利操作),以提高投资收益。
4)相对价值判断:本基金将在相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种进行投资。
5)信用风险评估:本基金将根据发债主体的经营状况与现金流等情况对其信用风险进行评定与估测,以此作为品种选择的基本依据。
(2)资产支持证券投资策略
本基金资产支持证券的投资将采用自下而上的方法,结合信用管理和流动性管理,重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况,市场流动性等,采用量化方法对资产支持证券的价值进行评估,精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目,在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。

(3)可转换债券投资策略
可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特点,具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本基金着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究,重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的转债,确定不同市场环境下可转换债券市场价值的相对价值,同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征,选择合适的投资品种,分享正股上涨带来的收益。
(4)国债期货投资策略
本基金对国债期货的投资以套期保值,回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。
(5)债券回购杠杆策略
本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果,积极参与债券回购交易,放大固定收益类资产投资比例,追求固定收益类资产的超额收益。
(6)证券公司短期公司债券投资策略
本基金证券公司短期公司债券的投资策略主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本面情况入手,包括整个证券行业的发展现状,发展趋势,具体证券公司的经营情况、资产负债情况、现金流情况,从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。
3.权益类投资策略
(1)行业配置策略
本基金将主要遵循“自下而上”的投资理念,结合当前宏观经济运行情况及发展趋势、国家政策等因素,考察行业运行周期、发展空间等,重点关注具有良好发展前景的行业。
(2)个股选择策略
本基金结合定性分析和定量分析的方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资。
定性分析主要基于研发团队对公司的案头研究和实地调研,包括所属细分行业情况、市场供求、商业模式、核心技术等内容,深入分析公司的治理结构、经营管理、竞争优势,综合考虑公司的估值水平和未来盈利空间。
定量分析主要根据相关财务指标,如营业利润率、净利率、每股收益(EPS)增长、主营业务收入增长等,分析公司经营情况、财务情况等,并综合利用市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)、折现现金流法(DCF)对公司进行合理估值。
(3)权证投资策略
本基金在权证投资中以对标的证券的基本面为基础,结合权证定价模型、隐含波动率、交易制度设计等多种因素对权证进行合理估值,谨慎投资,在风险可控的前提下实现较稳定的当期收益。本基金权证投资的原则为有利于基金资产增值、加强基金风险控制。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中债总指数(全价)收益率。
十、基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
十一、基金的投资组合报告
以下投资组合报告数据截止至2016年12月31日。本报告财务资料未经审计。
1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	36,970,564.00	5.27
	其中:股票	36,970,564.00	5.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	260,485,923.26	38.18
	其中:债券	260,485,923.26	38.18
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	270,000,430.00	39.07
	其中:买断式回购的买入返售	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	105,560,379.32	15.47
8	其他资产	10,260,726.25	1.50
9	合计	682,268,002.83	100.00

注:由于四舍五入的原因,期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

2.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境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	1,276,000.00	0.19
B	采矿业	1,547,520.00	0.23
C	制造业	22,942,020.00	3.40
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输业	2,140,360.00	0.32
G	交运仓储业、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	1,574,272.00	0.23
I	金融业	2,896,260.00	0.43
L	房地产业	-	-
M	科学研究和技术服务业	46,000.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,127,280.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,478,360.00	0.22
R	卫生和社会工作	988,500.00	0.15
S	文化、体育和娱乐业	-	-
T	综合	-	-
	合计	36,970,564.00	5.23

(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未有通过沪港通投资的股票。

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	600066	同仁堂	82,600	2,588,860.00	0.38
2	002126	晨颐股份	265,000	2,567,850.00	0.38
3	002241	聚源股份	92,000	2,439,960.00	0.36
4	000906	明电控股	146,000	2,140,360.00	0.32
5	000528	天地科技	46,000	1,841,220.00	0.27
6	002094	华谊兄弟	164,400	1,787,300.00	0.26
7	002290	亿阳信託	171,500	1,696,135.00	0.25
8	300292	润达医疗	180,000	1,571,400.00	0.23
9	002136	联电电子	90,500	1,566,560.00	0.23
10	002216	高伟科技	25,800	1,565,482.00	0.23

4.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	国债期货	29,901,000.00	4.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	181,014,923.26	26.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	信用等级	-	-
8	国债存单	49,510,000.00	7.20
9	其他	-	-
10	合计	260,485,923.26	38.68

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

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	111611447	14债国债3447	500,000	49,510,000.00	7.20
2	124231	13国债07	600,000	48,984,000.00	7.26
3	124261	13国债08	500,000	49,385,000.00	6.97
4	091629	14国债01	300,000	29,901,000.00	4.44
5	122692	14中债02	400,200	26,024,040.00	3.71

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。

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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

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。

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。

10.投资组合报告附注
(1)本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票票。

(2)本基金持有的前十名证券的发行主体本期未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、处罚的情形。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	206,316.00
2	应收证券清算款	2,626,000.00
3	应收利息	