

天治财富增长证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人：天治基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：2017年4月21日

§1 重要提示

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月18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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	天治财富增长混合
交易代码	390001
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2004年6月20日
报告期末基金份额总额	74,267,118.92份
投资目标	在严格控制风险的前提下本基金建立动态资产配置的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金建立动态资产配置策略，以“核心+卫星”策略为基本模式，以投资组合保险机制（VahI（Value at Risk）技术为核心，工具为风险中性定价模型，以资产配置模型为工具，对投资组合进行动态调整，并综合考虑市场、行业、个股、基金等各类资产实施全面的风险管理，力争基金资产净值高于动态资产配置模型，在风险可控的前提下，本基金追求长期增值，追求长期实现超额收益基金资产增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证全指指数收益率×60%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险较低、收益稳健的基金品种。
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期（2017年1月1日～2017年3月31日）
1.本期已实现收益	906,397.02
2.本期利润	4,222,678.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0607
4.期末基金净值	72,764,818.05
5.期末基金份额净值	0.9798

§3.1 主要财务指标	
序号	项目
1	本期已实现收益
2	本期利润
3	加权平均基金份额本期利润
4	期末基金净值
5	期末基金份额净值

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.40%	0.72%	1.56%	0.21%	4.84%	0.51%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告	
姓名	职务
吴昊	基金基金经理
任本基金的基金经理期限	任本基金的基金经理期限
任本基金的基金经理期限	任本基金的基金经理期限
任本基金的基金经理期限	任本基金的基金经理期限

注：1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对于报告期内本基金基金净值增长情况的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治财富增长证券投资基金合同》、《天治财富增长证券投资基金招募说明书》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，为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善公司治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，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

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的全过程，并建立透明、公平、公正的决策程序，建立一套研究投资管理公平交易程序，定期对不同投资组合收益差异、交易价差、成交事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

报告期内，本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形，未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度，上证指数上涨3.83%，创业板指下跌2.79%。供给侧改革叠加近几年行业的产能出清致使钢铁价格持续走高，中游上游行业持续回暖，OPEC初步达成减产协议，国际原油价格高位震荡。钢铁、石油为主的上游行业表现较为突出。全球市场波动逐步收敛，美国加息预期增强，年后国内流动性持续宽松，加之管理股对并购重组审核机制收紧，使得A股市场风格逐步从“成长”向“价值”转变。以家电、食品饮料等行业为主导的行情，消费板块在二季度表现优秀。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

报告期末，本基金的投资组合为：股票资产占基金资产净值的比例为64.00%，业绩比较基准收益率为1.56%，高于同期业绩比较基准收益率为0.94%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况	
序号	项目
1	权益投资
2	基金投资
3	固定收益投资
4	其他资产
5	其他负债
6	其他资产
7	银行存款和结算备付金合计
8	其他资产
9	合计

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
C	制造业	43,024,170.83	59.13
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	6,367,881.00	8.74
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	金融业	690,380.00	0.91
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	居民服务、修理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	50,042,351.83	68.77

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资组合。

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	002466	欧陆光	188,000	7,004,100.00	9.63
2	300136	信维通信	200,000	6,870,000.00	9.44
3	002475	立讯精密	140,000	3,542,000.00	4.87
4	300115	长盈精密	120,000	3,487,200.00	4.79
5	002241	歌尔股份	90,000	3,063,600.00	4.21
6	002635	爱洁科技	50,000	2,345,000.00	3.22
7	000101	神州长城	220,000	2,261,000.00	3.11
8	000223	启明信息	60,000	1,980,000.00	2.75
9	002210	东方园林	120,000	1,906,200.00	2.74
10	600088	绿庭网络	150,000	1,765,500.00	2.43

5.4 报告期末按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	国债债券	11,840,300.00	16.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,986,500.00	6.85
4	企业债券	4,986,500.00	6.85
5	中期票据	-	-
6	可转债（可交换债）	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
10	合计	16,826,800.00	23.13

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

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	160419	16浦发19	50,000	4,986,500.00	6.85
2	010303	03国债(3)	40,000	3,986,800.00	5.49
3	010107	21国债(7)	37,000	3,846,800.00	5.29
4	011638	16国债(1)	25,000	2,498,500.00	3.43
5	011646	16国债(1)	15,000	1,498,200.00	2.06

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.12 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.19 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.20 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.21 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.22 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.23 其他资产构成

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.29 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.30 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.31 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.32 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.33 其他资产构成

5.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.36 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.37 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。

5.38 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。

5.39 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.40 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.41 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.42 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.43 其他资产构成

5.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.46 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.47 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。

5.48 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。

5.49 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.50 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.51 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.52 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.53 其他资产构成

5.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.55 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.56 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.57 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。

5.58 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。

5.59 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.60 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.61 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.62 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.63 其他资产构成

5.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.65 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.66 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.67 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。

5.68 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。

5.69 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.70 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.71 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.72 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.73 其他资产构成

5.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.75 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.76 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.77 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。

5.78 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。

5.79 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.80 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.81 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.82 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.83 其他资产构成

5.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.85 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.86 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.87 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。

5.88 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。

5.89 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.90 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.91 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.92 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.93 其他资产构成

5.94 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.95 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.96 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.97 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。

5.98 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。

5.99 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.100 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.101 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.102 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.103 其他资产构成

5.104 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.105 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.106 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.107 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。

5.108 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。

5.109 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.110 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.111 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.112 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.113 其他资产构成

5.114 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.115 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.116 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.117 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。

5.118 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。

5.119 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.120 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.121 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.122 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.123 其他资产构成

5.124 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.125 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.126 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.127 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。

5.128 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。

5.129 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.130 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.131 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.132 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.133 其他资产构成

5.134 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.135 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.136 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.137 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。

5.138 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。

5.139 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.140 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.141 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.142 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.143 其他资产构成

5.144 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.145 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.146 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.147 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。

5.148 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。

5.149 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.150 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.151 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.152 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.153 其他资产构成

5.154 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.155 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.156 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.157 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。

5.158 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。

5.159 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.160 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.161 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.162 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.163 其他资产构成

5.164 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.165 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.166 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.167 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。

5.168 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。

5.169 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.170 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.171 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.172 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.173 其他资产构成

5.174 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.175 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.176 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.177 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。

5.178 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。

5.179 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.180 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.181 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.182 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.183 其他资产构成

5.184 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.185 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.186 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.187 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。

5.188 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。

5.189 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.190 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.191 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权。

5.192 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.193 其他资产构成

5.194 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.195 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.196 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.197 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。

5.198 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。

5.199 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.200 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.201 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有期权