

# 海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第1号)

**基金管理人:海富通基金管理有限公司**  
**基金托管人:交通银行股份有限公司**

## 重要提示

本基金经2016年7月20日中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1647号文准予注册募集。本基金的基金合同于2016年11月11日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。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该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,应详细查阅基金合同。

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人在认购(或申购)本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件。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。

本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)的,将承担汇率风险以及境外市场的风险。

本招募说明书所载内容截止日为2017年5月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31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:海富通基金管理有限公司  
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层  
法定代表人:张文伟  
成立时间:2003年4月18日  
电话:021-38650999  
联系人:吴晨莺  
注册资本:1.5亿元人民币  
股权结构:海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理BE控股公司(原法国巴黎投资管理BE控股公司)49%。

### (二)主要人员情况

张文伟先生,董事长,硕士,高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长,海通证券办公室主任,海通证券投资银行总部副总经理,海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。2017年2月起任新总经理职务。

杨明先生,董事,管理学学士。历任中国人民银行总行科员,交通银行新余支行办公室科员,证券业务部负责人,证券业务部副主任,证券业务部主任,海通证券股份有限公司新余营业部总经理,海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记,现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴源焜先生,董事,管理学博士。历任南京大学副教授,海通证券股份有限公司研究所宏观研究部总经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及个人客户服务部副总经理、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

陶乐斯(Ligia Torres)女士,董事,法国与墨西哥双重国籍,双硕士学位,曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行,1996年加入法国巴黎银行集团工作,2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官,2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事,2013年7月至今任法国巴黎资产管理(原:法国巴黎投资管理)公司亚太区CEO。

黄金源(Alex NG Kim Guan)先生,董事,马来西亚国籍,文学学士,历任荷兰通用投资银行新加坡代表处客服主任,荷兰通用资本市场远东区城香港公司证券部经理,法国巴黎资产管理(原:法国巴黎投资管理)亚洲有限公司董事,现任法国巴黎资产管理(原:法国巴黎投资管理)亚洲有限公司亚太区投资总监。

郑国汉先生,独立董事,经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授,香港科技大学经济系教授,香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授。现任香港岭南大学校长。

巴约特(Marc Bayot)先生,独立董事,比利时籍,布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授,先锋投资(米兰及都柏林)独立副董事长, Fundconnect独立董事, Degroof资产管理(布鲁塞尔)独立董事和法国巴黎银行B Control SICAV 独立董事。

杨国平先生,独立董事,硕士,高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、书记,上海市公用事业管理局党办副主任,上海市出租汽车公司党委书记,现任大众交通(集团)股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业(集团)股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

张馨先生,独立董事,博士,教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院,历任厦门大学经济学院教授、副院长兼财政系主任、院长。现任厦门大学经济学院教授、博士生导师。

李础前先生,监事长,经济学硕士,高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员,安徽省国有资产管理局科长,海通证券计划财务部副经理、总经理和财务总监。

魏海滔(Bruno Weil)先生,监事,法国籍,博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理,法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表、南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团(中国)副董事长。

俞涛先生,监事,博士,CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理(英国)有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月至今任海富通基金管理有限公司产品与创新总监,2015年12月起兼任海富通基金管理有限公司总经理助理。

陈虹女士,监事,法学学士。历任香港的近律师事务所上海代表处律师,工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问。2014年7月至2016年1月任海富通基金管理有限公司高级法律经理,现任海富通基金管理有限公司法律部总经理。

奚万荣先生,督察长,经济学硕士,中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管,海通证券股份有限公司内部审计,2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2016年7月起,任海富通基金管理有限公司督察长兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

章明女士,副总经理,硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc公司高级财务经理,加拿大Future Electronics公司产品专家,国信证券业务经理和副高级研究员,海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长,2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。2016年12月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。

陶闻雄先生,副总经理,硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,2003年4月至2006年4月任公司财务部负责人,2006年4月起任财务总监。2013年4月起,任海富通基金管理有限公司副经理。

何树方先生,副总经理,博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长,魁北克蒙特利尔大学研究助理(兼职)、魁北克公共退休投资管理投资公司分析师、基金经理助理,富国基金管理有限公司总经理助理,2011年6月加入海富通基金管理有限公司,任总经理助理。2014年11月起,任海富通基金管理有限公司副经理。

张炳佳先生,硕士。曾任交银施罗德基金管理有限公司数量分析师,2011年7月加入海富通基金管理有限公司,任股票分析师,2015年6月起任海富通强化回报混合基金经理。2016年2月起兼任海富通多元混合(ODII)、海富通大中华回报(ODII)基金经理。2016年11月起兼任海富通沪港深混合基金经理。

高峥女士,经济学硕士,历任德勤华永会计师事务所审计部职员,光大证券股份有限公司行业研究员,中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017年3月加入海富通基金管理有限公司,任权益投资部基金经理助理。2017年4月起任海富通沪港深混合基金的基金经理助理。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会常设委员有:张文伟,董事长(代行总经理)、胡光涛,总经理助理,王智慧,总经理助理;杜晓海,多策略投资决策部总监;黄东升,机构权益投资部总监;王宗洋,研究部副总监;陈鹏璞,量化投资部总监;陈臻平,固定收益投资部副总监。投资决策委员会主席由董事长(代行总经理)担任。讨论内容涉及特定基金的,则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

(一)基金托管人概况  
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)  
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD  
法定代表人:牛锡明  
住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号  
邮政编码:200120  
注册时间:1987年3月30日  
注册资本:742.62亿元  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号  
联系人:陆志俊  
电话:95559

### 三、相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

1.直销机构  
名称:海富通基金管理有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层  
法定代表人:张文伟  
全国统一客户服务热线:40088-40099(免长途话费)  
联系人:康旭  
电话:021-38650797  
传真:021-33830160

2.其他销售机构  
(1) 交通银行股份有限公司  
地址:上海市浦东新区银城中路188号  
法定代表人:牛锡明  
客户服务电话:95559  
网址:www.bankcomm.com

(2) 上海天天基金销售有限公司  
地址:上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路88号金座26楼  
法定代表人:其实  
客户服务电话:400-1818-188  
联系人:王超  
网址:www.1234567.com.cn

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  
注册地址: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:赵办清  
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:吕红  
电话:021-31358666  
传真:021-31358600

联系人:陈颖华  
经办律师:黎明、陈颖华  
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  
法定代表人:李丹  
经办注册会计师:陈玲、都晓燕  
电话:(021) 23238888  
传真:(021) 23238800  
联系人:都晓燕

## 四、基金的名称

本基金名称:海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

基金类型:契约型、开放式

## 六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供长期稳定的投资回报。

## 七、基金的投资方向

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(包括中小创、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、证券公司发行的短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为0-95%(其中,投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的0-95%,投资于港股通标的股票比例为基金资产的0-95%);每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持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%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

## 八、基金的投资策略

### 一、投资策略

(一)大类资产配置  
本基金的投资资产配置策略以基金的投资目标为中心,将定性和定量的分析方法运用于资产配置,根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段,包括大类资产的历史回报、历史波动率等制定本基金在股票、债券、现金、衍生品等资产之间的初步配置;其次结合证券市场行情趋势判断,判断证券市场趋势的大致风险收益比,再根据基本面、资金面、估值等具体因素,持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。

(二)股票投资策略  
股票投资是充分实现基金资产增值的关键。本基金将遵循价值预算管理管理和收益最大化相結合的原则,充分挖掘上市公司股票价格与价值之间的差异,精选价值被低估、业绩具有成长性且具有高流动性特征的股票,构建分散化的股票投资组合。基金经理和分析师将不间断地对上市公司进行跟踪分析,及时更新上市公司的经营和财务数据,识别风险,对盈利预测和估价模型进行调整和修正,根据市场状况和资产配置策略的变化及时调整股票投资组合,保证组合的高流动性、稳定性和收益性。

此外,本基金将仅通过境内及香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将立足于香港股票市场的独有特征,分析香港和内地两地上市公司差异,注重上市公司在国内外的比较,重点从公司质地、增长前景、估值水平、市场因素四个方面判定上市公司的投资价值。

(1)公司质地分析包括公司治理与管理层、公司的品牌和商誉、公司的盈利能力和公司的现金流评估、公司战略等。

(2)增长前景分析包括定性分析公司的盈利增长和竞争优势的可持续性,定量分析EPS增长率、PEG等成长性指标等。

(3)估值水平分析既包括分析P/E(预期)、P/B、PCF、PPCF、相对于NAV的溢价/折价、DDM、ROE等指标,也注重该指标与历史、行业和 international 市场的比较。

(4)市场因素分析包括个股技术面分析、资金流向、国际和行业影响等,此外还包括该上市公司与A股上市公司相比的投资标的的稀缺性和独特性等。

### (三)债券投资策略

债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,在市场创新和变化中寻找投资机会,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式,确定和构造合理的债券组合。

1.久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素,确定组合的整体久期,有效控制基金资产风险。

2.收益率曲线策略是指在确定组合久期以后,根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理,确定组合期限结构的分布方式,合理配置不同期限品种的配置比例。

3.类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上,根据各种品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子资产的配置权重,即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。

4.中小企业私募债券投资策略  
与传统的信用债相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险,并寻求足够的收益补偿,增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析,从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,进而预测信用水平的变化趋势,决定投资策略。在流动性风险控制,本基金将会重点放在一级市场,并根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模,严格防范流动性风险。

(四)资产支持证券投资策略  
对于包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制风险的基础上选择投资对象,追求稳定收益。

## (五)股指期货投资策略

本基金的股指期货投资将用于套期保值。在预期市场上上涨时,可以通过买入股指期货作为股票替代,增加股票仓位,同时提高资金的利用效率;在预期市场下跌时,可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险,对投资组合的价值进行保护。

## (六)国债期货投资策略

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则,以套期保值为目的。管理人将根据相关法律法规的规定,结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行操作,获取超额收益。

## 二、投资决策和程序

1.决策依据  
(1)投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;  
(2)投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比;  
(3)投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

## 2.决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制约。具体的决策流程如下:

(1)投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规,决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策;决定投资决策程序和风险控制体系及做出必要的调整;对旗下重大投资的批准与授权等。

(2)投资总监在公司有关规章制度授权范围内,对重大投资进行审查批准;并且根据基金合同的有关规定,在组合业绩比较基准的基础上,制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3)分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析,提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4)定期不定期召开基金经理例会,基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上,确立公司对市场、资产和行业的投资观点,该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5)基金经理在投资总授权下,根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标,在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见,进行投资组合的资产及行业配置;之后,在债券分析师设定的债券池内,根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征,构建基金组合。

(6)基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7)定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8)定量分析师负责完成内部基金业绩评估,并完成有关评价报告。投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序做出调整。

## 九、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×40%+恒生指数收益率×40%+中债综合财富指数收益率×20%

采用该业绩比较基准主要基于以下考虑:沪深300指数由中证指数有限公司编制,由沪深A股中规模大、流动性好、最具代表性的300只股票组成,综合反映了沪深A股市场整体表现。恒生指数,由香港恒生银行全资附属的恒生指数服务有限公司编制,是以香港股票市场中的950家上市公司股票为成份股样本,是反映香港股市价幅动趋势最有影响的一种股价指数。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券,综合反映了债券市场整体价格和回报情况。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、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基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况在履行适当的程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整,而无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照,不决定也不必然反映本基金的投资策略。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

## 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及基金管理人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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年6月5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止至2017年3月31日(“报告期末”)。

### 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	132,618,500.69	65.32
	其中:股票	132,618,500.69	65.32
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	70,367,836.04	34.65
7	其他资产	57,066.20	0.03
8	合计	203,033,400.93	100.00

### 2.报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 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	10,983,333.78	5.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
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	信息技术、软件和信息技术服务业	--	--
J	金融业	44,675,182.00	22.06
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	国民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
	合计	65,658,515.78	27.51

### 2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
电信业务	3,877,866.72	1.92
非日常生活消费品	17,466,802.17	8.63
工业	5,761,490.76	2.85
公用事业	8,394,054.45	4.15
金融	14,138,289.83	6.99
日常消费品	9,288,933.45	4.59
信息技术	12,299,398.22	6.08
医疗保健	5,733,170.26	2.83
合计	76,963,984.91	38.04

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	601398	工商银行	1,221,900	10,269,996.00	5.08
2	601939	建设银行	1,706,300	10,129,482.00	5.01
3	601318	中国平安	248,000	10,103,730.00	4.99
4	601169	北京银行	1,049,200	10,062,812.00	4.96
5	00700	腾讯控股	42,600	8,426,263.47	4.17
6	01289	农业银行	2,108,000	6,699,831.63	3.31
7	600104	上汽集团	248,087	6,296,701.86	3.11
8	00175	吉利汽车	475,000	5,018,232.86	2.48
9	02807	上海医药	227,100	5,006,234.49	2.47
10	000725	京东方A	1,362,383	4,686,631.52	2.32

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。

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。

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股指期货交易情况说明

9.1.报告期末本基金投资的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。

9.2.本基金投资股指期货的投资政策  
本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上上涨时,可以通过买入股指期货作为股票替代,增加股票仓位,同时提高资金的利用效率;在预期市场下跌时,可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险,对投资组合的价值进行保护。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1.本期国债期货投资政策  
本基金的国债期货投资以风险管理为原则,以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定,结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行操作,获取超额收益。

10.2.报告期末本基金投资的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。