

信息披露

（上接B087版）

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层
法定代表人：彭运华
联系人：孙爱
电话：010-59330519
传真：010-59330510
客户服务电话：4008909088
网址：www.jiuc.com

(92) 郑州传基金销售有限公司
注册地址：郑州市郑东新区心怡路西广路南升龙广场2号楼701
办公地址：郑州市郑东新区心怡路西广路南升龙广场2号楼701
法定代表人：李海晨
联系人：孙小龙
电话：0371-56213196
传真：0371-56213297
客户服务电话：400-666-671
网址：www.hgcrp.com

(93) 北京钱景基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
法定代表人：张俊春
联系人：陈海峰
电话：010-57491813
传真：010-57668857
客户服务电话：400-893-6885
网址：www.qianjing.com

(94) 聚丰金融服务有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海岸大厦1115、1116、1307室
法定代表人：TAM YIK KUAN
联系人：陈广浩
电话：0755-8946 0500
传真：0755-2167 4453
客户服务电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn

(95) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝业路6号106室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：钟琛
电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-68620066
网址：www.yingmi.cn

(96) 北京展锐天下投资管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区九渡河铺黄村735号03室
办公地址：北京市朝阳区望京大街甲6号万通中心D座21及28层
法定代表人：陈强
联系人：高爽
电话：010-58170911
传真：010-58170800
客户服务电话：400 818 8866
网址：http://fund.shengshiview.com/

(97) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路嘉园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海杨浦区昆明路18号A1002室
法定代表人：王刚
联系人：基煜
电话：021-65370077-220
传真：021-55085991
客户服务电话：021-65370077
网址：www.jiayutund.com

(98) 深圳前海新西鼎基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区深南中路1号招商大厦A座201室
办公地址：深圳市福田区深南中路1号招商大厦A座1606
法定代表人：吴永宏
联系人：梁中
电话：15920063836
客户服务电话：400-800-8668
网址：www.xind.com.cn

(99) 南京途牛金融信息服务有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人：宋阳
联系人：张捷
电话：18651612276
传真：025-86883960
客户服务电话：4007-999-999转3
网址：http://j.tuniu.com/

(100) 北京大成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王树刚
联系人：李瑞真
电话：010-56282140
传真：010-62860827
客户服务电话：400-619-9059
网址：www.fundzone.cn

(101) 北京格上信信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09号
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09号
法定代表人：李俊成
联系人：曹庆庆
电话：010-85924360
传真：010-66963333
客户服务电话：400-066-8856
网址：www.igesale.com

(102) 北京广源达信基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号中民大厦B座605室
办公地址：北京市西城区车公庄大街19号中民大厦19层
法定代表人：王奕俊
联系人：李奕俊
电话：010-57209334
传真：010-82056890
客户服务电话：400-623-6000
网址：www.niuniuni.com

(103) 上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号8楼法定代表人：王廷富
联系人：沈杰
电话：021-5132 7185
传真：021-5071 6181
客户服务电话：400-821-0203

(104) 北京天泽财富基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号3层1122室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号SOHO嘉盛中心303室
法定代表人：李悦
联系人：张晖
电话：010-56642600
传真：010-56642823
客户服务电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com

(105) 天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公D座2层202-12室
办公地址：北京市朝阳区霄云路36号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁华芳
联系人：李奕俊
电话：010-59287061
传真：010-59287825
客户服务电话：400-111-0899
网址：www.gomefund.com

(106) 泰诚财富基金销售有限公司（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：杨晓峰
联系人：杨晓峰
电话：0411-88801212
传真：0411-84396636
客户服务电话：400-0411-001
网址：www.taichengcaifu.com

(107) 金泰保险代理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街19号1号楼1层南座
办公地址：北京市西城区金融大街19号丰联广场A座1009
法定代表人：夏子柱
联系人：胡胡胡
电话：15810201340
传真：020-62852827
客户服务电话：400-8557333
网址：www.jhfund.com

(108) 北京新晨鑫在基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块
法定代表人：李海晨
联系人：梁爽
电话：010-60619607
传真：0810-62618822
客户服务电话：400-62676369
网址：www.xincin.com

(109) 浙商银行股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市庆春路288号
办公地址：浙江省杭州市庆春路288号
法定代表人：沈立
联系人：王盈盛
电话：0571-88257825
传真：0571-87659544
客户服务电话：96527
网址：www.zcbank.com

(110) 徽商银行股份有限公司
注册地址：合肥安庆路70号天徽大厦A座
办公地址：合肥安庆路70号天徽大厦A座
法定代表人：李海晨
联系人：叶中伟
电话：0551-62676335
传真：0551-62676384
客户服务电话：96588
网址：www.hsbank.com.cn

(111) 天津银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区友谊道15号
办公地址：天津市河西区友谊道15号
法定代表人：袁庆华
联系人：李岩
电话：022-28406684
传真：022-28406631
客户服务电话：4006000216
网址：http://www.zjcbank.com.cn

(112) 云南信义基金销售有限公司
注册地址：云南省玉溪市东风南路2号
办公地址：云南省玉溪市东风南路2号
法定代表人：孙海平
联系人：常晓娟
电话：0877-2060907
传真：0877-2061603
客户服务电话：0877-96522
网址：http://www.yxycb.com.cn

(113) 江苏紫金农村商业银行股份有限公司
注册地址：南京市建邺区梦都大街136号
办公地址：南京市建邺区梦都大街136号
法定代表人：孙小军
联系人：孙小军
电话：025-88866645
传真：025-88866645
客户服务电话：025-96008
网址：http://www.zjcbank.com

(114) 富滇银行股份有限公司
注册地址：昆明市拓东路41号
办公地址：昆明市拓东路41号
法定代表人：夏蜀

联系人：杨琳琳
电话：0871-63140324
传真：0871-63194471
客户服务电话：400-083-0633
网址：www.hudian-bank.com
(115) 苏州银行股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号
办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号
法定代表人：王兰凤
联系人：朱晓娟
电话：0512-69686364
传真：0512-69686370
客户服务电话：96307
网址：www.suzhoubank.com

(116) 上海证券有限责任公司
注册地址：上海市虹口区四川中路565号
办公地址：上海市虹口区四川中路565号
法定代表人：孙名扬
联系人：孙名扬
电话：0451-82339863
传真：0451-82281111
客户服务电话：4006662288
网址：http://www.sse.com.cn

(117) 方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：邵洪
联系人：郭建强
电话：0731-85325013
传真：0731-85322104
客户服务电话：95571
网址：http://www.fund.com.cn

(118) 北京特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区中关村东路17号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座
法定代表人：王瑾
联系人：王瑾
电话：010-59118245
传真：89189566
客户服务电话：个人业务：96118 企业业务：400 088 8816
网址：http://fund.jd.com

(119) 通华财富（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路567弄107号201室
办公地址：上海市浦东新区金桥路28号新金桥大厦3楼
法定代表人：周峰
联系人：金昌明
电话：021-6176938
传真：0400-699-5156
网址：https://www.tonghuafund.com

(120) 北京恒信基金销售有限公司
注册地址：北京市密云区云里街88号2号楼106-67
办公地址：北京市朝阳区建外大街10号11层1010室
法定代表人：杨晓峰
联系人：杨晓峰
电话：010-85721404
客服电话：4008-102-123
网址：www.hxinc.com

(121) 上海华源财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市朝阳区金融大街33号通泰大厦B座16层
法定代表人：毛海平
联系人：仲秋明
电话：010-88066322
传真：010-88066214
客户服务电话：400-817-5666
网址：www.amcfund.com

(122) 北京蛋蛋基金销售有限公司
注册地址：北京市密云区云里街88号2号楼106-67
办公地址：北京市朝阳区建外大街10号11层1010室
法定代表人：杨晓峰
联系人：杨晓峰
电话：010-85721404
客服电话：4008-102-123
网址：www.hxinc.com

(123) 济安财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼40层4601室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼40层4601室
法定代表人：杨晓峰
联系人：杨晓峰
电话：010-65309698
传真：010-61840699
客户服务电话：4006185181
网址：https://danjuanapp.com

(124) 北京金泰基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人：杨晓峰
联系人：李海晨
电话：010-65309616
传真：010-65309698
客户服务电话：400-673-7010
网址：www.jiantaifund.com

(125) 上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人：王廷富
联系人：沈杰
电话：021-5132 7185
传真：021-5071 6181
客户服务电话：400-821-0203

(126) 北京天泽财富基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号3层1122室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号SOHO嘉盛中心303室
法定代表人：李悦
联系人：张晖
电话：010-56642600
传真：010-56642823
客户服务电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com

(127) 天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公D座2层202-12室
办公地址：北京市朝阳区霄云路36号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁华芳
联系人：李奕俊
电话：010-59287061
传真：010-59287825
客户服务电话：400-111-0899
网址：www.gomefund.com

(128) 泰诚财富基金销售有限公司（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：杨晓峰
联系人：杨晓峰
电话：0411-88801212
传真：0411-84396636
客户服务电话：400-0411-001
网址：www.taichengcaifu.com

(129) 金泰保险代理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街19号1号楼1层南座
办公地址：北京市西城区金融大街19号丰联广场A座1009
法定代表人：夏子柱
联系人：胡胡胡
电话：15810201340
传真：020-62852827
客户服务电话：400-8557333
网址：www.jhfund.com

(130) 北京新晨鑫在基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块
法定代表人：李海晨
联系人：梁爽
电话：010-60619607
传真：0810-62618822
客户服务电话：400-62676369
网址：www.xincin.com

(131) 浙商银行股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市庆春路288号
办公地址：浙江省杭州市庆春路288号
法定代表人：沈立
联系人：王盈盛
电话：0571-88257825
传真：0571-87659544
客户服务电话：96527
网址：www.zcbank.com

(132) 徽商银行股份有限公司
注册地址：合肥安庆路70号天徽大厦A座
办公地址：合肥安庆路70号天徽大厦A座
法定代表人：李海晨
联系人：叶中伟
电话：0551-62676335
传真：0551-62676384
客户服务电话：96588
网址：www.hsbank.com.cn

(133) 天津银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区友谊道15号
办公地址：天津市河西区友谊道15号
法定代表人：袁庆华
联系人：李岩
电话：022-28406684
传真：022-28406631
客户服务电话：4006000216
网址：http://www.zjcbank.com.cn

(134) 云南信义基金销售有限公司
注册地址：云南省玉溪市东风南路2号
办公地址：云南省玉溪市东风南路2号
法定代表人：孙海平
联系人：常晓娟
电话：0877-2060907
传真：0877-2061603
客户服务电话：0877-96522
网址：http://www.yxycb.com.cn

(135) 江苏紫金农村商业银行股份有限公司
注册地址：南京市建邺区梦都大街136号
办公地址：南京市建邺区梦都大街136号
法定代表人：孙小军
联系人：孙小军
电话：025-88866645
传真：025-88866645
客户服务电话：025-96008
网址：http://www.zjcbank.com

(136) 富滇银行股份有限公司
注册地址：昆明市拓东路41号
办公地址：昆明市拓东路41号
法定代表人：夏蜀

超额收益；指数调整成分股在指数调整公告日后具有显著的负超额收益，在指数调整日之后具有显著的超额收益。指数调整交易策略对调入和调出指数的成分股采取不同的交易策略。

(3) 股票组合交易策略

股票组合特性和数量以及持有期对增持股票的股价走势产生重要影响，高管或大股东的增持比例、数量、股票组合持有期可获得较多的超额收益。本策略针对股东增持的时间设置股价反应、增持比例等条件筛选出相应的投资组合。

4. 市场风险对冲策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，进行股指期货投资。

具体而言，本基金主要使用股指期货作为工具，按照相关法律法规的有关规定，进行股指期货投资。本基金将根据量化模型确定权益类资产的目标市场暴露度，调整权益类资产主动投资比例并开列股指期货空头合约进行套期保值。当出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理，根据基金净申购或净赎回的金额，分别买入或卖出股指期货合约或卖出股指期货合约，并选择适当的时机平仓。采用股指期货投资策略可以有效对冲权益类资产的系统性风险，有效管理现金流量，降低建仓或调仓过程中的冲击成本。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算权益类资产与股指期货的相关性、投资权益类资产与股指期货的稳定性，精细化确定最优套保比例。

本基金在多数情况下，将保持权益类资产对股票市场大盘走势的敏感程度处于0-0.2，即：基金管理人将根据数量化分析工具，分析本基金持有的权益类资产相对于沪深300指数的敏感程度，即beta系数，然后利用沪深300指数期货套期保值合约，建立沪深300指数期货空头头寸，使本基金的整体权益类资产对沪深300指数变化的敏感程度处于-0.2-0.2。

5. 债券及其它金融工具投资策略

由于流动性管理及其他资产配置需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类资产的投资以及可转换债券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略等，主要服务于流动性管理，着力于短期投资。

本基金还将在法律法规允许的范围内，基于谨慎原则使用期权以及其它金融工具进行套期保值或风险管理，为基金收益提供增加保障。本基金进行权证投资时，将在对权证价值的证券进行基本面研究和估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化模型定价分析，确定其合理内在价值，从而构建套利或避险投资组合。

(二) 投资管理程序

本基金管理人实行“投资决策委员会领导下的团队制”管理模式，建立了严谨、科学的投资管理流程，具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全流程，如下图所示：

图1 投资管理流程

1. 投资决策

研究独立开展研究工作，在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观政策及政策分析，债券市场分析、行业及上市公司分析，重点分析行业的景气度和各类资产的相对价值，为投资决策委员会及各基金经理提供独立、统一的投资决策支持平台。

风险管理部运用风险监控模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险和投资组合整体风险进行监测，并提供权益类资产以及股指期货的量化风险分析报告。风控部每日提供基金申购赎回的量化分析报告，供基金经理参考。

2. 投资决策

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，投资决策委员会依据风险管理部的研究报告，定期或遇重大事件召开投资决策会议，决定基金整体投资策略及资产配置方案，审核基金基金经理的投资计划，提供投资建议，并审核其涉及基金投资权限的大同。

基金经理在公司总体投资策略的指导下，根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等规定，制定相应的投资计划，报投资决策委员会审批。

3. 投资组合构建

基金投资决策委员会根据投资决策委员会的决议，以及量化风险分析报告和申购赎回报告，利用数量化投资管理系统，选择证券构建基金投资组合，并根据基金资产配置调整基金投资组合，或者根据使用股指期货进行风险控制，进行投资组合的日常管理。

4. 交易执行

交易员负责在合法合规的前提下，执行基金经理的投资指令，并实施一线风险监控。

5. 风险分析及绩效评估

风险管理部对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估，报风险管理委员会、投资决策委员会、投资总监、基金经理，并就基金的投资组合提出风险管理建议。

基金管理人定期对基金的投资行为进行合规性控制，并对投资组合存在的风险隐患向基金经理、投资决策委员会、风险管理委员会进行风险提示。

6. 投资组合再平衡

基金管理人根据风险管理及绩效评估结果，结合宏观政策、债券市场、行业分析结果及最新的市场研究，并结合股指期货市场情况、股票资产流动性、基金申购赎回情况，在风险可控前提下，对投资组合进行调整、优化、再平衡。

7. 基金的业绩比较标准

本基金采用绝对收益型业绩标准：中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行调整该等基准利率将进行调整并相应调整）。注：因央行实时调整银行定期存款利率，则利率执行的时间进行加权平均。计算方法为

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例之和与合计可能有尾差。

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	288,500.00	0.12
B	采矿业	4,660,076.00	1.90
C	制造业	39,001,946.57	16.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	583,372.00	0.24
E	建筑业	14,123,660.00	5.82
F	交通运输、仓储业	1,061,805.46	0.44
G	信息传输、软件和信息技术服务业	4,375,304.91	1.80
H	金融业	7,728,740.20	3.19
J	房地产业	60,563,564.34	24.86
K	批发和零售业	7,407,580.00	3.03
L	租赁和商务服务业	724,253.26	0.30
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	国防、军工、医药和生物制品业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.69	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,568,506.46	0.61
S	综合	139,564,000.08	57.56

1.3 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产净值比例(%)
1	权益投资	139,564,000.08	56.22
2	固定收益	139,564,000.08	56.22
3	股指期货投资	20,020,000.00	7.92
4	资产支持证券	20,020,000.00	7.92
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	70,000,210.00	27.70
7	银行存款和结算备付金合计	3,690,760.08	1.46
8	其他资产	262,738,540.00	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例之和与合计可能有尾差。

1.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.4.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	288,500.00	0.12
B	采矿业	4,660,076.00	1.90
C	制造业	39,001,946.57	16.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	583,372.00	0.24
E	建筑业	14,123,660.00	5.82
F	交通运输、仓储业	1,061,805.46	0.44
G	信息传输、软件和信息技术服务业	4,375,304.91	1.80
H	金融业	7,728,740.20	3.19
J	房地产业	60,563,564.34	24.86
K	批发和零售业	7,407,580.00	3.03
L	租赁和商务服务业	724,253.26	0.30
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	国防、军工、医药和生物制品业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.69	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,568,506.46	0.61
S	综合	139,564,000.08	57.56

注：由于四舍五入的原因占基金总资产净值比例之和与合计可能有尾差。

1.2.2 报告期末按行业分类的股指期货投资组合

1.5 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股指期货投资

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	600138	中信证券	184,200	9,978,222.00	4.11
2	600380	招商证券	300,300	7,800,415.00	3.22
3	600619	兴业银行	11,200	5,797,366.00	2.39
4	601288	农业银行	1,306,700	5,338,394.00	2.20
5	600186	民生银行	610,700	4,887,814.00	2.02
6	600016	中国银行	1,173,600	4,831,112.00	1.99
7	600908	中信银行	444,000	4,126,880.00	1.70
8	600194	工商银行	120,900	3,622,800.00	1.49
9	601166	兴业银行	284,900	3,577,200.00	1.48
10	600048	保利地产	289,400	2,978,560.00	1.23

1.6 报告期末按基金品种分类的股票投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	地方政府债	-	-
3	金融债券	20,020,000.00	8.28
4	其他固定收益类金融债	20,020,000.00	8.28
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	20,020,000.00	8.28

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值比例之和与合计可能有尾差。

1.7 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债券投资

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	160201	16国开01	200,000	20,020,000.00	8.28

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.9 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

1.10 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

本基金本报告期末未持有权证。

1.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

IH1712	IH1712	-13	-10,537,020.00	-52,800.00	-
--------	--------	-----	----------------	------------	---