

信息披露

(上接B097版)
单元

法人代表: 俞洋
联系人: 杨莉娟
客服电话: 95323
公司网站: http://www.cfsc.com.cn/
(67) 瑞银证券有限责任公司
注册地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15

办公地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15

法人代表: 程宜恭
联系人: 牟冲
客服电话: 4008878827
公司网站: www.ubsecurities.com
(68) 中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层~21层及第04层01、02、03、05、11
办公地址: 深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法人代表: 高海
联系人: 张鹏
客服电话: 95532,400-600-8008
公司网站: www.china-invs.cn
(69) 江海证券有限公司
注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号

法人代表: 孙洪尧
联系人: 刘爽
客服电话: 400-666-2288
公司网站: www.jhzq.com.cn
(70) 民族证券有限责任公司
注册地址: 北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层~43层
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层~43层

法人代表: 赵大键
联系人: 李微
客服电话: 400-889-5618
公司网站: www.nc618.com
(71) 华宝证券有限责任公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

法人代表: 陈林
联系人: 刘润川
客服电话: 4008-209-898
公司网站: www.cnhbstock.com
(72) 英大证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法人代表: 吴昊
联系人: 吴晓晖
客服电话: 4000-188-688
公司网站: www.ydscc.com.cn
(73) 华融证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区金融大街8号
办公地址: 北京市朝阳区朝阳门内大街18号中国人保寿险大厦

法人代表: 祝敏忠
联系人: 李慧灵
客服电话: 400-898-9999
公司网站: www.hrsec.com.cn
(74) 天风证券股份有限公司
注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦

办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法人代表: 余磊
联系人: 杨晨
客服电话: 4008-005-000
公司网站: www.tfzq.com
(75) 中汇期货有限公司
注册地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北

座13层1301-1305室、14层
办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北
座13层1301-1305室、14层
法人代表: 张皓
联系人: 韩征
客服电话: 400-990-8826
公司网站: www.ctitcst.com

(76) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
办公地址: 北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦A座7楼
法人代表: 张彦
联系人: 张燕
客服电话: 400-166-1188
公司网站: http://8.jrj.com.cn

(77) 上海挖财基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号3号楼5层01、02、03室
办公地址: 上海浦东陆家嘴金融世纪广场3号楼5F
法人代表: 冷飞
联系人: 李娟
客服电话: 021-50810673
公司网站: http://www.wacaijin.com/

(78) 民商基金销售有限公司
注册地址: 上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室
办公地址: 上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室
法人代表: 唐惠琴
联系人: 杨一军
客服电话: 021-50206003
公司网站: www.msftcc.com

(79) 诺亚正信基金销售有限公司
注册地址: 上海市金山区漕泾镇漕柳公路7660号205室
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼
法人代表: 汪静波
联系人: 李婉璐
客服电话: 400-821-5399
公司网站: www.noah-fund.com

(80) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单

法人代表: 薛峰
联系人: 苏豪娜
客服电话: 4006-788-887
公司网站: www.zlfund.cn
(81) 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26楼
法人代表: 其实
联系人: 潘世华
客服电话: 400-1818-188
公司网站: www.1234567.com.cn

(82) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法人代表: 杨文斌
联系人: 张茹
客服电话: 4007-009-665
公司网站: www.ehowbuy.com

(83) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址: 杭州市滨江区江南大道3688号恒生大厦12楼
法人代表: 陈柏青
联系人: 张裕
客服电话: 4000-766-123
公司网站: www.fund123.cn

(84) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路555号裕景国际B座16层
法人代表: 张跃伟
联系人: 沈雯斌
客服电话: 400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

(85) 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: 浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2
法人代表: 凌顺平
联系人: 吴强
客服电话: 4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com

(86) 上海利得基金销售有限公司
注册地址: 上海市宝山区蕴川路475号1033室
办公地址: 上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法人代表: 沈轶伟
联系人: 曹怡晨
客服电话: 400-067-6266
公司网站: http://aleadfund.com.cn

(87) 北京创金启富基金销售有限公司
注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法人代表: 梁睿
联系人: 张旭
客服电话: 400-6262-818
公司网站: www.51rich.com

(88) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法人代表: 沈伟桦
联系人: 程刚
客服电话: 400-609-9200
公司网站: www.yixinfund.com

(89) 南京苏宁基金销售有限公司
注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
法人代表: 钱燕飞
联系人: 王锋
客服电话: 95177
公司网站: www.snjijin.com

(90) 北京格上富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室
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法人代表: 李悦章
联系人: 张林
客服电话: 400-066-8586
公司网站: https://www.igesafe.com/

(91) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法人代表: 周斌
联系人: 马鹏程
客服电话: 400-786-8868
公司网站: www.chtwm.com
(92) 北京汇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号
办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

法人代表: 王伟刚
联系人: 丁向坤
客服电话: 400-619-9069
公司网站: www.hcjijin.com
(93) 深圳盈信基金销售有限公司
注册地址: 深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)

办公地址: 辽宁省大连市中山区海军广场街道人民东路52号民生金融中心22楼盈信基金
法人代表: 苗宏升
联系人: 葛伟倩
客服电话: 4007-903-688
公司网站: www.fundying.com
(94) 上海大智慧基金销售有限公司
注册地址: 上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼
办公地址: 上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1108

法人代表: 申键
联系人: 印明强
客服电话: 021-20292031
公司网站: https://8.gw.com.cn/
(95) 北京新浪乐石基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区北四环西路68号理想国际大厦906室
办公地址: 北京市海淀区北四环西路68号理想国际大厦906室、海

淀北二街10号泰鹏大厦12层
法人代表: 张琪
联系人: 付文红
客服电话: 010-62675369
公司网站: www.xincail.com
(96) 北京君德汇置投资有限公司
注册地址: 北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502

办公地址: 北京市东城区朝阳门内大街8号富华大厦F座12层B室
法人代表: 李振
联系人: 魏尧
客服电话: 400-057-8865
公司网站: www.kstresure.com
(97) 济安财富(北京)资本管理有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
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

法人代表: 杨健
联系人: 李海燕
客服电话: 400-673-7010
公司网站: www.jianfortune.com
(98) 上海万得投资顾问有限公司
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: 上海市浦东新区福山路33号8楼
法人代表: 王廷富
联系人: 姜吉灵
客服电话: 400-821-0203
公司网站: www.520fund.com.cn

(99) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址: 中国上海-自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址: 上海市市长宁区福泉北路518号8座3楼
法人代表: 燕斌
联系人: 凌秋艳
客服电话: 400-046-6798
公司网站: www.66zichan.com
(100) 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潘园公路1800号2号楼6153室

上海泰和经济发展区
办公地址: 上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法人代表: 王刚
联系人: 蓝杰
客服电话: 400-820-5369
公司网站: www.jiyufund.com.cn
(101) 上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址: 上海市黄浦区延安路1号凯石大厦4楼

法人代表: 陈继武
联系人: 李晓明
客服电话: 400-178-0000
公司网站: www.lingxianfund.com
(102) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法人代表: 鲍尔华
联系人: 宁博宇
客服电话: 4008-219-031
公司网站: www.lufund.com

(103) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105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
法人代表: 肖雯
联系人: 黄敏敏
客服电话: 400-09629066
公司网站: www.yingmi.cn

(104) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址: 北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法人代表: 彭运年
联系人: 陈珍珍
客服电话: 400-8909-998
公司网站: www.jnlc.com

(105) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街18号东兴大厦A座17层
法人代表: 江卉
联系人: 陈启宇
客服电话: 95118
公司网站: http://fund.jd.com/

(106) 大连网金基金销售有限公司
注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
法人代表: 樊怀东
联系人: 贾伟刚
客服电话: 4000-899-100
公司网站: www.yibaijin.com

(107) 深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18F
法人代表: 赖建军
联系人: 张维
客服电话: 400-9600-898
公司网站: www.jfzinv.com

(108) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层
办公地址: 北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507
法人代表: 钟斐斐
联系人: 戚晓强
客服电话: 4000-618-518
公司网站: danjuanapp.com

(109) 上海华鑫财富管理管理有限公司
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: 上海市虹口区金融大街33号通泰大厦B座8层
法人代表: 李秋月
联系人: 李秋月
客服电话: 400-817-5666
公司网站: www.amcfortune.com

(三) 其他
基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加或调整本基金代销机构,并及时公告。
二、基金登记机构
名称: 富国基金管理有限公司
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼
法定代表人: 薛爱东
成立日期: 1999年4月13日
办公地址: (021) 20361818
传真: (021) 20361616
联系人: 徐慧

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: 韩炯
电话: (021) 31358666
传真: (021) 31358600
联系人: 孙睿
经办律师: 黎明、孙睿

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
注册地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场东楼经贸安永大
楼16层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人: 葛明
联系电话: 021-22288888
传真: 021-22290000
联系人: 徐艳
经办注册会计师: 徐艳、蒋燕华

第四部分 基金名称
富国天选灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金类型
混合型

第六部分 投资目标
本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选择,实现

基金资产增值的长期回报。

第七部分 基金投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单、期权的,本基金可参与同业存单、期权的投资,不需召开持有人大会。
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: 股票投资占基金资产的比例为0% - 95%, 权证投资占基金资产净值的比例为0% - 3%, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

第八部分 基金投资策略
本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。

1. 大类资产配置策略
本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略,根据宏观经济环境,主要结合国内生产总值、经济增长率、失业率、通货膨胀率、财政收支、国际收支、固定资产投资规模、货币政策和利率走势等指标,并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合,持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。

(1) 战略资产配置策略
在长期范围内,基金管理人将在理性预期的基础上获得战略资产配置的最优比例,并以此作为资产配置调整的依据或参照基准。主要考虑因素包括大类资产的历史回报、历史波动率,各类资产之间的相关性、行情驱动因素、类别风险轮动、行业强弱等,从其变动及趋势中得出未来资产回报、风险及相关的可能变化。
(2) 战术资产配置策略
在短期范围内,基金管理人将对组合进行战术资产配置,即在战略资产配置长期维持均衡的基础上积极主动的实现对大类资产配置动态优化调整。重点考虑以下因素:

① 基本面(Fundamental Factors): 评估基本因素,包括国内外宏观形势、工业企业利润、货币政策等;
② 资金面(Liquidity Factors): 评估影响股市中短期资金流;
③ 估值(Valuation Factors): 评估股市历史绝对对、相对估值及业绩调升调整;
④ 市场面(Market Factors): 评估市场情绪指标、动量、技术面等指标。

2. 股票投资策略
本基金将运用“价值为本,成长为重”的合理价格成长投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架,综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平,以寻找具有增长潜力且价格合理或低估的股票。
同时,本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性,通过精细化风险管理和组合优化化技术,实现行业与风格类资产的均衡配置,从而实现风险调整后收益的最大化。

(1) 第一层: 筛选量化筛选
本基金重点关注由以下量化筛选过程产生的股票样本:
本基金构建的量化选股筛选主要包含: 市净率(PB)、市盈率(P/E)、动念市盈率(PEG)、主营业务收入增长率、净利润增长率等;
① 价值股票的量化筛选: 选取PB、PE较低的上上市公司股票;
② 成长性股票的量化筛选: 选取动态市盈率(PEG)较低、主营业务收入增长率、净利润增长率排名靠前的上市公司股票。

(2) 第二层: 突出基本面分析
在量化筛选的基础上,本基金将基于“定性定量分析相结合、动态静态指标相结合”的原则,进一步筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。

基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型,重点关注上市公司资产的产量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价值等因素;通过运用(定性的)上市公司质量评估模型,重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。

3. “自上而下”的债券投资
本基金将采用“自上而下”的投资策略,对债券资产进行合理有效的配置,并在此框架下进行具有针对性的债券选择。

基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政货币政策与货币市场政策以及结构调整因素(包括:资金面结构的调整、投资者结构的变化、制度建设和品种创新等)对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的品种和利率水平,制定久期控制下的资产配置策略,力争有效控制整体债券资产风险。在确定组合整体框架后,基金管理人将对收益率曲线以及各品种债券品种价格的变化进行进一步预测,相机而动、积极调整。

在债券投资组合构建和管理过程中,基金管理人将具体采用久期控制、期限结构配置、市场择机、相对价值判断、信用风险评估等管理手段。
(1) 久期控制是根据对宏观经济未来发展状况、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期限期限结构,进行组合子弹策略、杠杠策略、梯子策略等,在长期、中期与短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券中选择对价格变化中获利。

(3) 市场转换: 基金管理人将针对债券子市场之间不同的运行规律,在充分研究风险-收益特征、信用特性的基础上构建与调整组合(包括跨市场套利操作),以求提高投资收益。
(4) 相对价值判断: 基金管理人将在现金流特征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,并选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的品种,减持相对高估、价格将会下降的品种。

(5) 信用风险评估: 基金管理人将充分利用现有行业与公司的研究力量,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。
债券投资策略制定与贯彻的依据,也是基金管理人对于风险进行动态评估与管理的过程。在系统化的风险控制体系下,通过对管理指标的设定与监控,结合对风险定价失效机会的把握,基金管理人不但可以有效控制整体资产的风险水平,而且可以在寻求风险结构优化的过程中不断提高组合的收益水平。

4. 金融衍生工具投资
本基金还可运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具:

(1) 运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益;
(2) 构建权证与债券的组合,利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性,形成保本投资组合;

(3) 针对不同的市场环境,构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合,形成多元化的盈利模式;
(4) 在严格风险监控的前提下,通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究,谨慎参与以杠杆放大为目的的权证投资。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

第九部分 基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。
沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性好、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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

受业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在中国证监会备案后变更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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高风险预期收益和预期风险水平的投资品种。

第十一部分 投资组合报告
一、报告期末投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	76,385,000.00	21.29
	其中:股票	76,385,000.00	21.29
2	固定收益投资	28,012,000.00	8.04
	其中:债券	28,012,000.00	8.04
	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	-	-
6	其中:买入返售的金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	289,694,609.07	72.97
8	其他资产	1,340,642.86	0.31
9	合计	386,200,251.93	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	40,821,243.00	26.04
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	信息传输、软件和信息技术服务业	3,072,427.00	1.84
J	金融业	8,826,546.00	2.62
K	房地产业	5,852,000.00	1.88
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	房地产业、建筑业和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
9	合计	76,385,000.00	26.00

三、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组合明细

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	600619	贵州茅台	12,282.00	8,948,340.00	3.03
2	000066	中国平安	106,300.00	8,854,113.00	2.89
3	600767	恒顺醋业	93,300.00	5,924,560.00	2.00
4	000661	格力电器	147,200.00	5,917,440.00	2.00
5	601318	中国平安	64,000.00	4,446,650.00	1.50
6	000895	汇川技术	46,300.00	4,342,520.00	1.50
7	002741	光科科技	272,300.00	4,276,523.00	1.48
8	000100	平安银行	271,200.00	2,996,760.00	1.01
9	601016	复星医药	94,000.00	2,984,430.00	1.01
10	002415	奥康医疗	103,400.00	2,971,740.00	1.00

四、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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,012,000.00	6.77
	其中:政策性金融债	28,012,000.00	6.77
4	企业债券	-	-
5	地方政府债	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,012,000.00	6.77

五、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组合明细

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	150223	国开23	300,000.00	28,012,000.00	6.77