

(上接D75版)  
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层

法定代表人:齐剑辉  
电话:15201586214  
联系人:王永刚  
客服电话:400-623-6060  
网址:www.niumifund.com

(53)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A  
法定代表人:高锋  
电话:0755-83655588-605

联系人:廖嘉琦  
客服电话:400-804-8688  
网址:www.foreseekeynes.com

(54)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:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人:王廷富  
电话:021-68822800  
联系人:徐亚男  
客服电话:400-820-9463  
网址:www.wind.com.cn

(55)众升财富(北京)基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室  
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08  
法定代表人:李招弟  
电话:13611256407

联系人:李艳  
客服电话:400-059-8888  
网址:www.wy-fund.com

(56)北京肯特瑞财富投资管理有限公司  
注册地址:北京市经济技术开发区科贸十一街18号C座2层221室  
办公地址:北京市北京经济技术开发区科贸十一街18号C座2层222室

法定代表人:陈超  
电话:18612439949  
联系人:黄芹  
客服电话:400-088-8816  
网址:www.fund.com

(57)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

法定代表人:王伟刚  
电话:18001102931  
联系人:闫坤  
客服电话:400-619-0959  
网址:www.fundzone.cn

(58)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4号楼15层1809  
办公地址:北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809

法定代表人:戎兵  
电话:13520443582  
联系人:张得仙  
客服电话:400-6099-200  
网址:www.yixinfund.com

(59)奕丰基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1116室及1307室

法定代表人:TEO WEE HOWE  
电话:13424241000  
联系人:叶健  
客服电话:400-684-0500  
网址:www.willastps.com.cn

(60)北京创金启富投资管理有限公司  
注册地址:北京市西城区丰盛胡同31号2号楼215A  
办公地址:中国北京西城区白纸坊东街2号经济日报社A座综合楼712号

法定代表人:梁蓉  
电话:010-66154828-8047  
联系人:王瑞  
客服电话:400-626-2818  
网址:www.5irich.com

(61)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03室  
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内03室

法定代表人:安立欣  
电话:15600155787  
联系人:张琳  
客服电话:400-080-5828  
网址:www.licai.com

(62)上海大智慧财富管理有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区郭守敬路498号浦东软件园14幢22201-130室  
办公地址:上海市虹口区东大名路428号由由世纪广场1号楼

法定代表人:张长虹  
电话:18901685505  
联系人:施燕华  
客服电话:021-20219997  
网址:www.gw.com.cn

(63)中欧钱滚钱基金销售有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层  
办公地址:上海市浦东新区商城路618号良友大厦B303室

法定代表人:裘玉明  
电话:021-68609600  
联系人:屠帅卿  
客服电话:400-700-9700  
网址:www.zofund.com

(64)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:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503-1504室

法定代表人:尹翔  
电话:17721005485  
联系人:吴鸣飞  
客服电话:400-820-5369  
网址:www.jiyufund.com.cn

(65)凤凰金信(银川)基金销售有限公司  
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402  
办公地址:朝阳区来广营中街甲1号朝来高科技产业园5号楼

法定代表人:程刚  
电话:18701236910  
联系人:陈旭  
客服电话:400-810-5919  
网址:www.fengd.com

(66)乾道盈泰基金销售有限公司(北京)有限公司  
注册地址:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117  
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

法定代表人:王兴吉  
联系人:刘金凤  
电话:15901073209  
客服电话:400-088-8080  
网址:www.qiandao.com

(67)深圳市金斧子基金销售有限公司  
注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108  
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108

法定代表人:赖任军  
联系人:刘昕霞  
电话:0755-29330513  
客服电话:400-930-0660  
网址:www.jfzinv.com

(68)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:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4F  
法定代表人:陈继武  
联系人:高静  
电话:13861784145  
客服电话:21-6333-3389-230  
网址:www.vstonewealth.com

(69)东海期货有限责任公司  
注册地址:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号  
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼

法定代表人:陈太康  
联系人:陶云  
电话:15527357161  
客服电话:400-8888-588  
网址:www.qh168.com.cn

(70)杭州科地瑞富基金销售有限公司  
注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室  
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼  
法定代表人:陈刚  
电话:15926659590

联系人:张丽琼  
客服电话:0571-86655920  
网址:www.ed121.com

(71)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A-1

办公地址:大连市中山区南山路155号南山1910-A3-1  
法定代表人:苗志军  
联系人:王清臣  
电话:13522300698  
客服电话:4007-903-688

网址:www.fundying.com  
(72)江西正融资产管理有限公司  
注册地址:江西省南昌市高新区紫阳大道绿地新都会38栋2107室

办公地址:江西省南昌市高新区紫阳大道3333号绿地新都会38栋2108室  
法定代表人:陆雯  
联系人:熊勇  
电话:13879129841  
客服电话:0791-86692560  
网址:www.jxzzq.com.cn

(73)上海朝阳永续基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区张江碧波路690号4号楼2楼  
办公地址:上海市浦东新区张江碧波路690号4号楼2楼

法定代表人:廖冰  
联系人:陆纪青  
电话:15902135304  
客服电话:400-998-7172  
网址:www.998fund.com

(74)嘉晟瑞信(天津)基金销售有限公司  
注册地址:天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场1号楼2503室  
办公地址:天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场1号楼2503室

法定代表人:孙伟  
电话:15510846151  
联系人:孙颖  
客服电话:400-883-2993  
网址:www.jxfund.com

(75)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  
法定代表人:刘汉青  
电话:025-66969699-887226  
联系人:王泽  
客服电话:95177  
网址:www.sujijin.com

(76)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700号101.02.03室  
办公地址:上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼5层

法定代表人:胡燕亮  
电话:021-50810687  
联系人:李娟  
客服电话:400-025-6569  
网址:wacaijin.com

(77)中民财富基金销售有限公司  
注册地址:上海黄浦区中山南路100号7层05单元  
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

法定代表人:洪洋  
电话:18521506916  
联系人:王雨桐  
客服电话:400-876-5716  
网址:www.cmw.com

(78)万家财富基金销售有限公司  
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室  
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层

法定代表人:李峰  
电话:13811941597  
联系人:杨雪  
客服电话:010-59013828  
网址:www.wjasset.com

(79)济泰财富(青岛)基金销售有限公司  
注册地址:山东省青岛市香港东路195号9号楼701室  
办公地址:北京市西城区西什库大街31号院九思众创园5号楼501室

法定代表人:任淑楠  
电话:010-66121830  
联系人:周晓敏  
客服电话:0532-66728591  
网址:www.hongtaiwealth.com

(80)上海华夏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栋2楼268室  
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人:毛淮平  
电话:010-88066632  
联系人:仲秋玥  
客服电话:400-817-5666  
网址:www.amcfortune.com

(81)和耕传承基金销售有限公司  
注册地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼602、603房间  
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号楼国际电子城b座

法定代表人:李淑慧  
电话:13810222517  
联系人:董亚芳  
客服电话:400-360-0000  
网址:www.hgccpb.com

(82)华源财富(上海)基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区同江路667弄107号201室  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融大厦9层高南路799号3号楼9楼

法定代表人:王刚  
电话:021-60810586  
联系人:杨尚  
客服电话:95156  
网址:www.tonghualuafund.com

(83)嘉兴银行股份有限公司  
注册地址:浙江省嘉兴市建国南路409号  
法定代表人:夏林生  
电话:0573-82080201  
传真:86-573-82097275  
联系人:余丹  
客户服务热线:0573-96528  
网址:www.hoj.com

(84)江西银行股份有限公司  
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区金融大厦699号  
法定代表人:陈晓明  
电话:0791-86790794  
传真:86-791-86771100  
联系人:万俊  
客户服务热线:956055  
网址:www.jx-bank.com

3.基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构调整为本基金的销售机构,并及时公告。  
(一)登记机构  
名称:天益基金管理有限责任公司  
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号  
办公地址:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层  
法定代表人:井贤栋  
电话:(022)83865560  
联系人:薄贺龙  
(二)律师事务所和经办律师  
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  
电话:021-31358666  
传真:021-31358666  
经办律师:黎明、陈颖华  
联系人:陈颖华  
(四)会计师事务所和经办注册会计师  
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号展银银行大厦6楼  
办公地址:中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:李丹  
电话:(021)23238888  
传真:(021)23238800  
经办注册会计师:薛岚、周炜  
联系人:周炜

4.基金名称  
本基金名称:天弘中证500指数型发起式证券投资基金。

5.基金的类型  
本基金类型:股票型基金。

6.基金的投资目标  
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

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,以中证500指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如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,对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  
本基金采用完全复制制的方法,进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制的指数,并根据标的指数的成份及其权重的变动而进行相应调整,以复制跟踪标的指数。本基金在严格控制基金日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。

由于标的指数编制方法调整,成份股及其权重发生变化(包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等)的原因,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况下导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整,力求降低跟踪误差。

1. 本基金主要按照中证500指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2. 股票投资策略  
(1)股票投资组合构建  
本基金采用完全复制制的方法,按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异,若出现较为特殊的情况(例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素),本基金将采用替代性的方法构建组合,使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合,以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%的投资比例限制。

(2) 股票投资组合的调整  
本基金所构建的股票投资组合将根据中证500指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

3. 定期调整策略  
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

4. 不定期调整  
A. 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B. 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

C. 根据法律、法规和基金合同的规定,成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生变化时,本基金可只对投资组合管理进行适当调整和,力求降低跟踪误差。

在正常市场情况下,力争控制本基金的跟踪误差与业绩比较基准的超越率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施降低跟踪误差,跟踪误差进一步扩大。

5. 其他金融工具投资策略  
本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,控制基金投资组合风险水平,更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的,不得用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

(二)投资决策流程  
1. 决策依据  
(1)国家有关法律、法规和《基金合同》的规定;  
(2)以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则;  
(3)国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球投资因素分析。

2. 投资管理程序  
(1)本基金管理人每月定期召开资产配置会议,讨论基金的资产组合以及个股配置,形成资产配置建议,会议参加人员为全体投资研究团队。  
(2)投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下,确定基金资产配置方案,并审批重大单项投资决策。  
(3)基金经理在投资决策委员会的授权下,根据本会议的投资配置要求,参考资产配置会议、投资研究联席会议讨论结果,制定基金的投资策略,在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。  
(4)金融工程分析师运用风险监控模型以及各种风险监控指标,对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行评估,并提供数量化风险分析报告,行业分析师对标的指数成份股中基本面情况及时提供研究报告。  
(5)基金经理根据数量化风险分析报告,在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下,采取适当的方法控制与指数的偏差风险、流动性风险,降低交易成本。

9. 业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。  
中证500指数除了沪深300指数样本股本及最近一年日均总市值排名前300名的股票,再按照最近一年(前称为今年以来)的日均成交额由高到低排名,剔除排名前20%的股票,然后将剩余股票按日均总市值由高到低进行排名,选取排名在前300名的股票作为该指数样本。该指数综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况,并且能够作为反映沪深证券评价标准,为指数化投资和衍生品产品创新提供基础条件。  
如未来指数编制单位变更或停止中证500指数的编制、发布或授权,或中证500指数由其他指数替代,或由指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证500指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数,业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数为基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致,报中国证监会备案并及时公告。

10. 风险收益特征  
本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

11. 基金投资组合报告  
基金管理人的董事会及董事保证所披露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。  
基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年02月11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。  
本报告中所有财务数据未经审计。以下内容摘自本基金2018年第4季度报告。  
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         | 865,562,913.96 | 90.74        |
| 2  | 基金投资         | 865,562,913.96 | 90.74        |
| 3  | 固定收益投资       | —              | —            |
| 4  | 金融衍生品投资      | —              | —            |
| 5  | 买入返售金融资产     | —              | —            |
| 6  | 其中:买入返售金融资产  | —              | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计 | 80,498,512.92  | 8.44         |
| 8  | 其他资产         | 7,801,932.91   | 0.82         |
| 9  | 合计           | 953,863,359.79 | 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(指数投资)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             | 0,098,440.30   | 0.97         |
| B  | 采矿业              | 27,363,839.49  | 2.92         |
| C  | 制造业              | 489,678,032.06 | 52.24        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 27,798,619.06  | 2.97         |
| E  | 建筑业              | 16,184,645.90  | 1.73         |
| F  | 批发和零售业           | 45,986,586.78  | 4.91         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 30,485,959.41  | 3.25         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 3,235,275.20   | 0.35         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 78,889,837.62  | 8.42         |
| J  | 金融业              | 29,083,655.30  | 3.10         |
| K  | 房地产业             | 47,318,476.44  | 5.05         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 13,732,429.25  | 1.46         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,441,316.24   | 0.15         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 5,991,131.80   | 0.64         |
| O  | 国防服务业、修理和其他服务业   | 73,562.40      | 0.08         |
| P  | 教育               | 7,544,227.20   | 0.81         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 5,744,227.20   | 0.61         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 24,483,738.56  | 2.62         |
| S  | 综合               | 8,169,542.58   | 0.87         |
| S  | 综合               | 865,419,345.26 | 92.32        |
| 合计 |                  | 143,568.70     | 0.02         |

注:由于指数成份股调整,上表所列示股票中,\*ST华泽(证券代码:000693)被调出成份股后停牌,故以积极投资股票列表(下同)。

3. 报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 期末指数投资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  | 600201 | 生物股份 | 337,031   | 5,994,714.60 | 0.60         |
| 2  | 600872 | 中炬高新 | 161,928   | 4,770,398.88 | 0.51         |
| 3  | 000656 | 金科股份 | 767,104   | 4,748,373.76 | 0.51         |
| 4  | 600256 | 广汇能源 | 1,163,900 | 4,373,218.40 | 0.47         |
| 5  | 300146 | 高伟控股 | 253,700   | 4,310,363.00 | 0.46         |
| 6  | 300347 | 盛裕股份 | 100,660   | 4,300,850.00 | 0.46         |
| 7  | 300253 | 卫宁健康 | 325,615   | 4,057,162.90 | 0.43         |
| 8  | 002410 | 广联达  | 194,768   | 4,053,122.08 | 0.43         |
| 9  | 600426 | 华泰证券 | 328,619   | 3,966,433.33 | 0.42         |
| 10 | 000623 | 吉林敖东 | 270,515   | 3,903,531.45 | 0.42         |
| 合计 |        |      |           | 43,568.70    | 0.02         |

注:由于指数成份股调整,上表所列示股票中,\*ST华泽(证券代码:000693)被调出成份股后停牌,故以积极投资股票列表(下同)。

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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  | 603018 | 上机数控  | 1,345  | 66,039.50 | 0.01         |
| 2  | 601860 | 紫金银行  | 15,970 | 50,145.80 | 0.01         |
| 3  | 000693 | *ST华泽 | 49,788 | 27,383.40 | 0.00         |

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