

证券代码:002252 证券简称:上海莱士 公告编号:2019-068

上海莱士血液制品股份有限公司 关于控股股东科瑞天诚被动减持计划实施期限届满的公告

目前,上述被动减持计划实施期限已届满。公司于2019年7月11日收到科瑞天诚《关于公司被动减持计划实施期限届满的告知函》,被动减持期间,该次被动减持计划实际减持公司股份。现将该次预披露的被动减持计划实施情况公告如下:

一、该次被动减持计划减持股份情况
科瑞天诚该次被动减持计划未减持公司股份。
二、该次被动减持计划减持前后持股情况
1、科瑞天诚该次被动减持计划未减持公司股份;该次被动减持计划减持前,科瑞天诚持有本公司股份1,595,529,564股,占公司总股本的32.07%。
2、公司分别于2018年12月8日、12月12日、12月19日、12月22日、12月26日及2019年1月9日披露了《关于控股股东科瑞天诚及其一致行动人存在可能被动减持公司股票风险的预披露公告》等,并分别于2018年12月12日、12月21日、12月22日、12月25日、12月26日、12月27日、12月28日披露了《关于控股股东科瑞天诚及其一致行动人被动减持股份的进展公告》等,截至2019年7月10日,科

瑞天诚及其一致行动人累计被动减持公司股份30,842,952股(占公司总股本的0.62%),累计被动减持后,科瑞天诚持有公司股份1,582,529,564股(占公司总股本的31.81%),科瑞天诚及其一致行动人持有公司股份1,801,744,412股(占公司总股本的36.22%)。

三、其他有关说明
1、科瑞天诚本次被动减持计划符合《证券法》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》、《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等相关法律法规、法规、规章、业务规则的规定。该次被动减持股份事项已按照相关规定进行了预披露,被动减持期间,该次被动减持计划未减持公司股份。
2、自公司2018年12月8日首次发布关于科瑞天诚及其一致行动人存在可能被动减持公司股票风险的预披露公告之日起,科瑞天诚及其一致行动人累计被动减持公司股份30,842,952股(占公司总股本的0.62%),除此之外,科瑞天诚及其一

致行动人不存在减持公司股份的情形。
3、该次减持计划为科瑞天诚的被动减持计划,科瑞天诚及其一致行动人一直与债权人保持沟通协调,并积极根据债权人要求,进行债务展期、筹措资金、追加保证金或抵押物等相关措施防范平仓风险。

4、该次被动减持计划未对公司治理结构及持续经营产生实质影响,也未直接导致公司控制权发生变更。
四、备查文件
科瑞天诚《关于公司被动减持计划实施期限届满的告知函》。
特此公告。

上海莱士血液制品股份有限公司
董事会
二〇一九年七月十二日

证券代码:002252 证券简称:上海莱士 公告编号:2019-069

上海莱士血液制品股份有限公司 关于控股股东莱士中国被动减持计划实施期限届满的公告

持计划实施期限已届满。公司于2019年7月11日收到莱士中国《被动减持计划实施期限届满的告知函》,被动减持期间,该次被动减持计划未减持公司股份。现将该次预披露的被动减持计划实施情况公告如下:

一、该次被动减持计划减持股份情况
莱士中国该次被动减持计划未减持公司股份。
二、该次被动减持计划减持前后持股情况
1、莱士中国该次被动减持计划未减持公司股份;该次被动减持计划减持前,莱士中国持有本公司股份1,509,120,000股,占公司总股本的30.34%。
2、公司分别于2018年12月8日、12月12日、12月19日、12月20日披露了《关于控股股东莱士中国存在可能被动减持公司股票风险的预披露公告》等,并于2018年12月20日、2019年6月15日、2019年7月12日披露了《关于控股股东莱士中国被动减持股份的进展公告》,截至2019年7月10日,莱士中国累计减持公司

股份84,408,236股(占公司总股本的1.697%);
3、截至2019年7月10日,莱士中国持有公司股份1,424,711,764股(占公司总股本的28.64%),莱士中国及其一致行动人深圳莱士凯吉投资咨询有限公司(“深圳莱士”)持有公司股份1,652,830,930股(占公司总股本的33.23%)。

三、其他有关说明
1、莱士中国本次被动减持计划符合《证券法》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》、《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等相关法律法规、法规、规章、业务规则的规定。该次被动减持股份事项已按照相关规定进行了预披露,被动减持期间,该次被动减持计划未减持公司股份。
2、自2018年12月8日公司首次发布关于莱士中国存在可能被动减持公司股票风险的预披露公告之日起,截至2019年7月10日,莱士中国及其一致行动人累

计被动减持公司股份84,408,236股(占公司总股本的1.697%)。除此之外,莱士中国及其一致行动人不存在减持公司股份的情形。

3、该次减持计划为莱士中国的被动减持计划,莱士中国及其一致行动人一直与债权人保持沟通协调,并积极根据债权人要求,进行债务展期、筹措资金、追加保证金或抵押物等相关措施防范平仓风险。

4、该次被动减持计划未对公司治理结构及持续经营产生实质影响,也未直接导致公司控制权发生变更。
四、备查文件
莱士中国被动减持计划实施期限届满的告知函。
特此公告。

上海莱士血液制品股份有限公司董事会
二〇一九年七月十二日

证券代码:002252 证券简称:上海莱士 公告编号:2019-070

上海莱士血液制品股份有限公司 关于下属子公司完成内部股权转让并取得换发的单采血浆许可证的公告

任公司(“浙江海康”)。

目前,公司与浙江海康之间的内部股权转让事项已完成,青田莱士单采血浆站有限公司更名为青田海康单采血浆站有限公司(“青田海康”),浙江海康持有青田海康100%股权,青田海康成为浙江海康的全资子公司。浙江海康并于近日取得了本次股权转让后换发的单采血浆许可证,具体如下:

一、青田海康单采血浆站有限公司

机构名称:青田海康单采血浆站有限公司;
设置单位:浙江海康生物制品有限责任公司;
地址:浙江省丽水市青田县鹤塘口镇口村老江路30号;
登记证书:浙卫监浆站[2019]第4号
许可证号:0004;
法定代表人:周星;

业务范围:原料血浆的采集(包括乙肝、破伤风、狂犬病免疫血浆);
采集范围:青田县、景宁族自治县;
有效期:自2019年6月25日至2021年3月28日。
特此公告。

上海莱士血液制品股份有限公司董事会
二〇一九年七月十二日

证券代码:300612 证券简称:宣亚国际 公告编号:2019-046

宣亚国际营销科技(北京)股份有限公司 2019年半年度业绩预告

2019年半年度业绩预告本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、本期业绩预告情况
1.业绩预告期间:2019年1月1日至2019年6月30日
2.预计的业绩:√亏损 □扭亏为盈 □同向上升 □同向下降
3.业绩预告情况表:

项目	本期预告	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	亏损:650万元—1150万元	盈利:260.17万元

注:上表中“万元”均指人民币万元。
二、业绩预告预审计情况
本次业绩预告未经注册会计师审计。
三、业绩变动原因说明

宣亚国际营销科技(北京)股份有限公司
董事会
2019年7月11日

证券代码:300612 证券简称:宣亚国际 公告编号:2019-047

宣亚国际营销科技(北京)股份有限公司 关于参加北京辖区深市上市公司投资者集体接待日的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

为进一步加强与广大投资者的沟通交流,宣亚国际营销科技(北京)股份有限公司(以下简称“公司”)将参加由北京上市公司协会、深圳全景网络有限公司共同举办的“2019年北京辖区深市上市公司投资者集体接待日”活动,现将有关事项公告如下:

本次活动将在深圳市全景网络有限公司提供的网上平台,采取网络远程的方式进行。活动时间为2019年7月18日(星期四)15:00至17:00。投资者可登录“全景路演天下”参与本次互动交流(<http://rs.p5w.net/html/103630.shtml>),或扫描二维码方式登录参与。



宣亚国际营销科技(北京)股份有限公司董事会
2019年7月11日

(上接 D95 版)

2.债券投资策略
(1)久期管理策略

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势,判断债券市场的未来走势,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整组合久期,当期预期收益率曲线下移时,适当提高组合久期,以分享债券市场上涨的收益;当期预期收益率曲线上移时,适当降低组合久期,以规避债券市场下跌的风险。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析和判断在期限上的投资偏好,并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。

(2)期限结构配置策略
在期限结构分析的基础上,运用统计和数量分析技术,对市场利率期限结构历史数据进行分析和情景测试,并综合考虑债券市场微观因素如历史期限结构、新发行、回购及拆借利率等,形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断,从而在子弹型、杠铃型或阶梯型配置策略中进行选择并动态调整。其中,子弹型策略是将偿还期限集中于收益率曲线上的某一点;杠铃型策略是将偿还期限集中于收益率曲线的两端,而阶梯型策略则是选择期限债券所占比重大致一致,在收益率曲线变陡时,本基金将采用子弹型配置,当预期收益率曲线变平时,将采用哑铃型配置;在预期收益率曲线变平时时,则采用哑铃型配置。

(3)骑乘策略
通过分析收益率曲线各期限段的利率情况,当债券收益率曲线比较陡峭时,买入期限位于收益率曲线陡峭区域债券,在收益率曲线不变的情况下,随着债券持有期限的延长,债券的收益率水平将较投资初期有所下降,这样可间接获得该债券持有期间的稳定的票息收入以及收益率下降带来的价差收入;即使收益率曲线上升或进一步变陡,这一策略也能够提供更多的安全垫。

(4)息差策略
根据市场利率水平、收益率曲线的形态以及对未来期限结构的预期,通过采用长期债券和短期回购相结合,获取较高水平流动性及回购利率优势。当回购利率低于债券收益率时,可以将正回购所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资的收益。

(5)信用策略
发债主体的资信状况以及信用利差曲线的变动将直接影响债券的信用评级水平。本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估,分析违约风险及合理期限利率,以作为投资决策的重要依据。
本基金将重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司治理、财务质量(主要是财务指标分析,包括资产负债率、偿债能力、运营效率以及现金流量等),融资目的等重要要素,综合评价其信用等级。本基金还将定期对上述指标进行更新,并及时因发债主体信用等级的变化,从而调整信用等级,对债券重新定价。本基金还将关注信用评级机构的变动趋势,通过对宏观经济周期的判断结合对信用债在不同市场中的供需状况、市场容量、债券结构和流动性因素的分析,形成信用利差曲线变动趋势的合理预期,确定信用债配置和分行业配置比例。

(6)个券选择策略
根据发债人公司所在行业发展以及公司治理、财务状况等信息对债券发行人主体信用评级,在信用评级上,进一步结合债券发行主体资产(主要是债券担保状况)对债券进行评级,根据评级的评价,选择具有优势的品种进行投资,并与市场上的信用评级进行对比,发掘具备相对价值的个券。

(7)可转换债券投资策略
可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点,是本基金的重要投资对象。本基金将选择公司基本面良好、其可转债价格具有较高上涨潜力的可转债进行投资,并采用内外部定价模型等数量化工具评定其投资价值,以合理价格买入。
(8)资产支持证券投资策略
本基金将深入 researched 资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素,评估资产支持证券的信用风险、利率风险和流动性风险,通过运用分析和流动性管理,辅以前述化债工具,选择那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资,力求获得长期稳定的投资回报。

(9)中小企业私募债券投资策略
本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面因素,在充分研究的基础上,对个券发行主体的性质、行业、经营情况,以及债券的增信措施等进行综合分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整,适度分散投资来管理组合的风险。

(10)证券公司短期公司债券投资策略
对于证券公司短期公司债券,本基金对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选,综合考虑和分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、债券收益等要素,确定投资价值。本基金将对拟投资证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测,并适当控制债券投资组合整体的久期,防范流动性风险。

3.股票投资策略
在严格控制风险、保持资产流动性的前提下,本基金将适度参与权益类资产的投资。本基金在股票基本面的研究的基础上,同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响,将影响上市公司基本面的和股价的增长因素、估值因素、盈利因素、财务风险等因素进行综合分析,在定性分析的基础上结合量化分析方法,精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的国内A股及内地与香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资的股票,以构建股票组合。本基金通过对国内A股市场和港股市场跨市场的投资,来达到分散投资风险,增强基金整体收益的目的。

(1)增长因素分析
本基金将综合考虑宏观经济、产业政策、市场因素、宏观经济统计局的“中国行业景气景气指数”,对各行业的景气状况进行比较分析。评估产业链对各细分行业财富效应和替代效应的影响,重点选择处于行业成长和成熟期的细分行业。其次,主要考虑上市公司盈利的历史及将来预期的增长率。此因素不仅含有公司的历史盈利增长能力,也包含了市场预期将来盈利增长能力。此盈利因素的决定因素有销售收入、净利润及现金流增长率等。

(2)估值水平分析
本基金根据一系列历史和预期的财务指标,结合定性方法,分析公司盈利稳定性,判断相对投资价值。主要指标包括:EV/EBITDA、EV/Sales、P/E、P/B、P/RNAV、股息率等。在全市场范围内选择增长与估值性价比最好的公司。

(3)盈利能力分析
盈利能力是反映公司经营管理和盈利方面的能力,此因素是估值因素的重要补充,因为市场通常会以盈利能力强弱不同的公司给予不同的估值,在盈利能力因素中的因子有净资产回报率(ROE),资本投资回报率(CIOC)等因素。

(4)财务风险分析
考虑此因素可以在市场极端的情况下,寻找安全边际,有效地避免高风险投资,此因素中的因子有净资产收益率(Du/Eq)、总资产负债率(Du/As)等因素。

(5)股票选择与组合优化
在以上分析的基础上,本基金选择定价合理或者价值被低估的股票构建投资组合,并根据股票的预期收益与风险水平对组合进行优化,在合理风险水平下追求基金收益最大化。同时监控组合中证券的估值水平,在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

4.港股通标的股票投资策略
本基金在在以固定收益资产投资为主的基础上,适度参与港股市场投资,以增强整体收益。在港股投资标的筛选上,注重与市场良好、相对A股市场估值合理、具备优质成长性、注重现金流分红的股票进行长期投资。股票筛选的方法上,将以基本面研究为基础,辅以量化分析,以更深入、更全面的挖掘优质标的。另外,本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外,还需关注:
(1)香港股票市场与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响,比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌幅限制、估值与盈利

回报等方面。

(2)港股通每日额度运用情况。
(3)人民币与港币间的汇率升值变化。
5.其他金融工具投资策略
(1)股指期货投资策略
在股指期货投资上,本基金以回避价值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中,将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究现货和期货市场的发展趋势,运用定价模型对其进行合理估值,谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调整投资组合仓位,以降低组合风险、提高组合的运作效率。并合理利用股指期货对冲系统性风险,降低基金的流动性风险,如大额申购赎回等。

(2)国债期货投资策略
在风险可控的前提下,本基金将本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本基金参与国债期货交易以套期保值为主要目的,运用国债期货对冲风险。本基金将根据对债券市场和期货市场的情况,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,发挥国债期货对冲风险和流动性较好的特点,灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考量国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险,对冲收益率曲线平坦、陡峭等形态变化的风险,对冲关键利率期限波动的风险;利用金融衍生品工具进行投资,以达到降低投资组合的整体风险的目的。
(3)权证投资策略
权证为基金投资组合的工具,本基金进行权证投资时,将在对权证投资的价值进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险投资组合。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资于其他金融工具,本基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

随着国内债券市场的深入、发展和结构性新变,更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式。本基金将密切跟踪更新的债券品种及相关金融衍生品市场发展动态,如果法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,如利率远期、利率期货等金融衍生工具,本基金将遵循届时法律法规,制定符合本基金投资目标的投资策略,谨慎地进行投资。

九、基金的风险控制策略
本基金的风险控制策略为:中债综合财富(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+金融机构人民币活期存款利率(税后)+5%
本基金的投资目标为在严格控制风险的基础上,通过合理配置大类资产和精选投资标的,力争实现基金资产的长期稳健增值,为投资者提供稳健的长期投资工具。本基金采用“中债综合财富(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率+金融机构人民币活期存款利率(税后)”分别作为债券、股票和现金类资产投资的比较基准,并将业绩比较基准中债券指数、股票指数与现金类资产的权重确定为75%、20%和5%。鉴于上述指数的权威性、代表性,以及本基金的投资目标和投资范围,选用该业绩比较基准能够真实、客观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,或者证券市场中有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在与本基金托管人协商一致,并按照监管规定履行必要程序后,对业绩比较基准进行调整,调整业绩比较基准须经中国证监会备案并及时公告,而无需基金份额持有人大会决议。

十、基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金与货币型基金。本基金投资涉及法律法规或监管机构所规定的特定范围内的境外投资,即本基金是一只涉及跨境投资的股票型基金。除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、流动性风险、海外市场风险等境外投资所面临的特别投资风险。

十一、基金投资组合报告(未经审计)
基金管理人的董事会及董事承诺:本报告所载数据不存在虚假记载、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。
本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告中与基金财产净值、投资组合报告等有关内容,保证复核内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截止2019年03月31日,本报告中列示财务数据未经审计。

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	3,905,044.34	1.23
2	其中:普通股	3,905,044.34	1.23
3	固定收益投资	303,673,532.32	98.28
4	其中:债券	303,673,532.32	98.28
5	资产支持证券	—	—
6	贵金属投资	—	—
7	金融衍生品投资	—	—
8	买入返售金融资产	1,000,000.00	0.31
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
10	银行存款和结算备付金合计	3,397,237.27	1.07
11	其他	6,797,735.36	2.14
12	合计	318,357,514.23	100.00

注:1.本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为1,014,160.00元,占期末资产净值比例为0.35%。
2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	—	—
B	制造业	—	—
C	采矿业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,890,884.34	0.99
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	—	—
J	金融业	—	—
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	教育、文体、娱乐和休闲业	—	—
P	医疗保健业	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	合计	2,890,884.34	0.99

(2)报告期末按行业分类的港股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(%)
A 基础材料	—	—
B 消费者必需品	—	—
C 医疗保健用品	—	—
D 能源	—	—
E 金融	592,420.00	0.20
F 医疗健康	—	—
G 工业	421,780.00	0.14
H 信息技术	—	—
I 电信服务	—	—
J 公用事业	—	—
K 房地产	—	—
合计	1,014,160.00	0.36

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	600519	贵州茅台	2,386	2,037,620.14	0.69
2	0908H	中金公司	38,000	592,420.00	0.20
3	600104	上汽集团	22,500	586,575.00	0.20
4	00694	北京银行	66,000	421,780.00	0.14
5	603288	海天味业	3,076	366,689.20	0.09
6	0919H	其他	—	—	—
7	其他	—	—	—	
8	合计	—	—	303,673,532.32	100.35

对于同时处于A+H上市上的股票,合并计算公允价值并与排序,并按照不同股票分别披露。
4.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	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	4,598,320.00	1.57
2	中期票据	64,993,000.00	21.23
3	其中:政策性金融债	64,993,000.00	21.23
4	企业债券	88,948,000.00	30.33
5	企业短期融资券	65,660,500.00	22.32
6	中期票据	61,943,000.00	21.12
7	可转换(可交换)债	17,214,095.32	5.87
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	303,673,532.32	100.35

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	170215	17国债15	300,000	30,795,000.00	10.50
2	160210	16国债10	250,000	23,665,000.00	8.17
3	143190	17国债02	150,000	15,190,500.00	5.18
4	10178005	17浦发MTN001	100,000	10,177,000.00	3.65
5	101760073	17陕煤04 MTN004	100,000	10,679,000.00	3.64

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
本基金本报告期内未投资股指期货。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期内未投资国债期货。
11.投资组合报告附注
11.1 本报告期末本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。
11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应收保证金	3,817.14
2	应收待清算款项	900,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,578,122.38
6	其他应收款	715,798.81
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,797,735.30

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112006	东财转债	1,799,942.52	0.61
2	12			