

(上接 C43 版)
联系人:秦明
 电话:010-85678888-6035
 客服电话:4009101888
(114)国金证券股份有限公司
 注册地址:成都市东城根上街95号
 法定代表人:冉净怡
 联系人:刘婧瑜
 电话:028-86660057
 客服电话:4000-600109
(115)中信期货有限公司
 注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北楼13层1301-1305及14层
 法定代表人:张皓
 联系人:刘宏莹
 电话:0755-82791065
 客服热线:4009908826
(116)西南证券股份有限公司
 注册地址:重庆市江北桥北路8号
 法定代表人:李伟
 联系人:秦明
 电话:023-63786141
 客服电话:4008098766
(117)中泰证券股份有限公司
 注册地址:山东省济南市经七路86号
 法定代表人:李玮
 联系人:秦明
 电话:021-20315255
 客户服务电话:95538
(118)北京晟隆天下基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座18层
 法定代表人:秦明
 联系人:曹慧
 客服电话:4008188866
备注:销售上述产品外还销售融通深证100C的机构名单:上海财财基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海长量基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、金鹰基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、腾安基金销售有限公司(深圳)有限公司、上海基煜基金销售有限公司。
3. 融通深证100指数基金H类别基金份额销售机构
 融通深证100指数基金H类基金份额销售机构的具体情况请参见招募说明书补充文件或基金管理人届时发布的公告。
(二)注册登记
名称: 融通基金管理有限公司
注册地址: 深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
办公地址: 深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
邮政编码: 518033
法定代表人: 高崎
联系人: 杜嘉
电话: (0755) 26948075
传真: (0755) 26930101
客服热线: 400-883-8088、(0755) 26948088
网址: www.rtfund.com
(三)律师事务所和经办律师
名称: 广东君信律师事务所
注册地址: 深圳前海红树林国际证券大厦12楼
办公地址: 深圳前海红树林国际证券大厦12楼
法定代表人: 闵齐双
联系人: 尹小旻
经办律师: 闵齐双 刘少华 尹小旻 崔卫群
电话: (0755) 83382828(总机) (0755) 33033000(直线) 13480989076
传真: (0755) 33033088
(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: 上海市湖南路202号华普中心11楼
办公地址: 上海湖南路202号华普中心11楼
执行事务合伙人: 李丹
电话: 021-23238888
传真: 021-23238880
联系人: 俞伟敏
经办注册会计师: 陈玲、俞伟敏
五、基金的名称
 融通深证100指数投资基金
六、基金的类型
 契约型开放式
七、基金的投资目标
(一)融通债券基金
 融通债券基金为开放式债券投资基金,在强调本金安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
(二)融通深证100指数基金
 融通深证100指数基金为开放式股票型投资基金,跟踪标的指数投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现对深证100指数的有效控制,谋求分享中国中资证券的持续稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增值,为投资者带来长期稳定回报。
(三)融通资产配置混合基金
 融通资产配置混合基金主要投资于具有较高内在投资价值的优质蓝筹公司,具有极强的核心竞争力,业绩能持续增长或具有增长潜力的成长型企业。通过组合投资,在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,追求资产的长期增值。
八、基金的投资方向
(一) 融通债券基金
 主要投资于低风险和/或低流动性风险等级,而利率风险根据组合优化的需要在高低等不同风险等级上。
(二) 融通深证100指数基金
 主要投资于深证100指数成份股和融券券。
(三) 融通蓝筹成长或资产配置混合基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内公开发行上市股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。融通蓝筹成长混合基金限制将相当比例的基金资产投资于符合蓝筹成长投资标准的投资对象;同时将根据市场状况调整投资组合,把握投资机会,实现组合的进一步优化。
九、基金的投资策略
A、融通债券基金
(一) 投资策略
 本基金以组合优化为本策略,利用收益曲线模型和债券品种定价模型,采取较好的资产配置策略,在市场出现的中短期投资机会,根据投资组合优化的过程,具体如下:
 1. 总体资产配置自上而下
 利率是债券市场的主导因素,本基金将在宏观研究的基础上对未来利率变化趋势进行预测,形成债券投资政策的根本依据;同时中期结构对债券市场的变动有重要参考和驱动作用,本基金将基于对利率期限结构变化,给出利率变动预警信号。总体资产配置将根据宏观和期限结构的有关研究成果,设定债券组合的久期,控制整体的利率风险。此外,结合市场环境,充分考虑流动性和信用风险等其他风险指标,对银行间国债市场、银行间金融债市场、交易所国债市场和交易所企业债市场给予不同的久期配置。
 本基金将保留适量的现金以应付赎回或开展逆回购,以便获得较好的收益。
2. 类属资产配置优化
 在总体资产配置的基础上,对类属配置采取定长期的凸度优化、收益率优化、交易成本等多种优化组合策略,最终优化的比例是一个多目标规划的结果。
 债券市场存在无效之处,本基金将结合收益曲线模型和收益率模型把握市场出现的短期投资机会,提高组合的投资收益。
3. 单个品种的优化配置
 本基金力求通过绝对和相对定价模型对市场上所有债券品种进行合理定价,基于对每个品种的绝对和相对定价,进行债券品种的投资价值分析。
4. 风险控制之下追求收益最大化
 目前国债期货的风险主要来自利率风险,本基金将通过适当的久期管理来控制债券组合的利率风险,然后通过凸度优化和收益率优化等追求收益的最大化。
 可转债的投资风险主要来源于股价的波动,在可转债的总体比例上,本基金将根据Vak、风险控制和模型进行控制。在可转债的品种选择上,本基金主要通过绝对定价模型和相对定价模型对股票的评级等综合判断其投资价值,力求实现较高的收益。
(二) 投资法规
 1. 决策依据
 (1) 国家有关法律、法规和基金合同的约定;
 (2) 国家宏观经济环境及其对债券市场的影响;
 (3) 国家货币政策、财政政策以及证券市场走势;
 (4) 发债公司财务状况、行业地位、经济和市场需求状况及其当前市场价格;
 (5) 货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。
 2. 决策程序
 (1) 确定投资策略
 基金经理在宏观、债券以及金融工程研究员提供的研究报告和模型的基础上完成最终的投资策略报告,上报投资决策委员会审批。投资决策委员会审批通过后,交由风险管理委员会备案监督,并由基金经理进行具体实施。
 (2) 进行资产配置
 基金经理根据前述研究报告和投资策略报告,对基金资产在个市场进行合理的配置,为每个市场设计合理的久期,并根据基金资产风险对每个市场进行不同的风险等级。
 (3) 进行品种配置
 运用组合优化模型构建初始组合,然后根据市场的变动情况及时对组合进行调整。但是调整的幅度不得超过整体的投资策略和资产配置策略。
(三) 组合风险监控
 风险监控小组每日对组合主要来自于两个方面,一是可能出现的需要,例如出现极具吸引力短期买入或卖出机会;二是风险监控的需要,由专门的风险管理小组对持仓和交易进行监控,基金经理或者风险管理小组发现组合局部或者整体风险超标时,基金经理应立即对组合进行调整。
(四) 风险监控与业绩分析
 风险监控小组每日对组合进行风险监控,出具风险监控报告,同时还将对组合的债券基金业绩进行归因分析,找出基金投资策略的长处和短处,为未来的管理提供有益的借鉴。
(三) 资产配置优化的投资策略、风险控制措施及投资比例
1. 投资策略
 本基金在确定与基金投资目标相一致的前提下,可以着重通过风险和可控的回报,为取得与承担风险相称的收益,投资于资产支持证券。
(1) 买入持有策略
 基金可在与投资目标一致的前提下,买入并持有资产支持证券,以获取相应的利息收入。
(2) 利率预期策略
 根据对利率趋势、提前还款率等的预测,调整资产支持证券收益率的变化幅度,从而决定资产支持证券的买入或卖出。
(3) 持有策略
 通过对资产支持证券的信用评级、分析近期违约率和违约损失率的变化情况,评估其信用价差是否合理,并预测其变化趋势,通过其信用利差的改善和利差的缩小获利。
(4) 相对价值策略
 基金通过计算资产支持证券的名义利差、套利利差及期限调整利差等指标,将资产支持证券的相对风险特征与其他资产类别和债券的收益风险特征,确定其是否具有相对价值,从而决定对其整体或个券的买入和卖出。
2. 风险控制措施
 (1) 通过严格的投资流程控制投资风险,基金经理及有关人员必须严格执行投资控制制度。
 (2) 在投资资产支持证券时,首先应由固定收益研究员提出资产支持证券的风险收益报告和投资建议,基金经理根据投资决策委员会的配置计划制定相应的投资授权,参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告,充分评估资产支持证券的风险收益特征,确定具体投资方案,在严格控制风险的前提下,谨慎进行投资。
(三) 交易员负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责,监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。
(四) 风险监控
 (1) 风险监控小组对资产支持证券投资进行风险监控和绩效评估,密切跟踪影响基金资产支持证券投资的各种因素,并在投资中进行相应调整,以规避风险的上升。
(5) 固定收益研究员负责不断完善资产支持证券定价模型,并评估模型风险,密切跟踪影响资产支持证券投资的各种因素,并评估其对应资产支持证券持有期间的收益,并进行相应的投资决策。
(6) 基金经理负责资产支持证券投资的上市流程和流动性支持安排,并考虑其对基金资产流动性的影响,分散投资,确保所持有资产支持证券具有适当的流动性。
(7) 基金经理将密切关注影响债务人提前还款的各种因素,并评估其对资产支持证券投资价值的影,并进行相应的投资决策。
(8) 基金经理负责投资授权及风险控制手段,确保基金相关操作以谨慎安全的方式进行,确保基金资产持有及风险得到保障。
(9) 严格审查所投资资产支持证券的法律文件,确保各环节都有适当的法律保障。

3. 本基金可投资资产支持证券。
 (1) 持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例不得超过该资产支持证券规模的10%。
 (2) 投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例不得超过基金资产净值的10%。
 (3) 与基金管理人管理的其它基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。
 (4) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%。
 (5) 因市场波动、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金资产支持证券不符合上述第(2)项和第(4)项规定的比例,基金管理人将在10个工作日内调整完毕。
 (6) 投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级,且本基金投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。在持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降,不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。
(四) 投资组合管理
 本基金资产配置于国债、金融债和企业债(包括可转债),投资组合必须符合下列规定:
 1. 投资于债券的比例不低于本基金总资产的80%,投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%;
 2. 本基金基金与由基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
 3. 持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年之内的政府债券的比例不低于本基金资产净值的5%;
 4. 本基金基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司公开被停牌、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金不符合前款约定的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
 5. 本基金基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
 6. 遵守中国证监会规定的其它比例限制。
 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素使基金投资不符合上述1至2项规定的比例,基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。
B、融通深证100指数基金
(一) 投资策略
 本基金以基金债券资产90%以上的资产投资深证100指数的成份股进行股票型投资。股票投资组合部分不得高于基金资产的50%,相对对于深证100指数的跟踪误差率不超过0.5%,因基金规模或市场变化导致投资组合不能满足上述比例不在限制之内,但基金管理人应在合理期限内进行调整,以达到上述标准。
(二) 投资法规
 (1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
 (2) 宏观经济形势及前景、经济政策趋向;
 (3) 本行业状况及趋势; (4) 行业及上市公司基本面研究;
 (5) 提前或后指数成份股的变化。根据指数编制规则,预测指数成份股可能发生变动以及对股价的影响,提前或后调整成份股。
2. 决策程序
 (1) 研究部提供宏观分析、利率和通货膨胀数据,深证100指数成份股公司的研究报告;金融工程小组利用模型进行历史模拟和风险评估。在此基础上进行投资论证,做出投资建议提交基金经理,并为投资决策委员会提供资产配置的建议。
 (2) 基金经理根据研究部提交的投资建议初步确定下一阶段的投资资产配置建议,并报投资决策委员会审批。
 (3) 投资决策委员会审定基金经理提交的投资配置提案,形成资产配置计划书。
 (4) 基金经理根据投资决策委员会的决策,制定相应的指数投资组合方案并报投资决策委员会备案,对超出基金经理权限的单项投资决策须经投资决策委员会审批。
(五) 基金风险管理
 (1) 基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划,并以投资指令的形式下达至交易部。
 (2) 交易部依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。
 (3) 基金经理负责跟踪组合的跟踪误差和风险进行评估,定期投资组合跟踪误差和风险报告的调整。
 (4) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施,跟踪审核对投资决策和执行过程进行日常监督,投资组合方案执行完毕,基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。
(三) 资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例
融通债券基金
(一) 投资策略
 本基金主要投资于股票、国债等,投资组合必须符合以下规定:
 1. 投资于股票、债券的比例不低于本基金总资产的80%;
 2. 持有一家公司以上的股票,不得超过本基金资产净值的10%;
 3. 本基金基金与由基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
 4. 现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年之内的政府债券的比例不低于本基金资产净值的5%;
 5. 本基金基金管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;但完全按照该比例进行证券投资的投资组合,不受此限制;
 6. 本基金基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司公开被停牌、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金不符合前款约定的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
 8. 本基金基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
 9. 遵守中国证监会规定的其它比例限制。
 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素使基金投资不符合上述1至3项、第5项、第6项规定的比例,基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。
C、融通蓝筹成长混合基金
(一) 投资策略
 1. 资产配置
 贯彻自上而下的投资策略,结合宏观经济状况、资本市场的运行周期确定风险收益互斥的股票资产和债券资产的投资比例。
 2. 行业资产配置
 在蓝筹成长型投资理念的指导下,通过对宏观经济、行业经济把握以及对行业运行周期的认识,确定投资资产不同行业的投资比例。
 3. 债券选择
 分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响,各种品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;另一方面考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。
4. 股票选择
 本基金为蓝筹成长型基金,其股票投资主要包括两部分:一部分为蓝筹股投资,另一部分为成长股投资。对蓝筹上市公司和成长型上市公司股票的投资比例不得超过基金资产净值的30%。
 本基金投资的蓝筹公司具有以下主要特点:
 (1) 行业地位突出,收益稳定,属于相对成熟、稳定的行业;
 (2) 业绩优良,盈利能力高,由于投资回报高而具备投资价值;
 (3) 经营稳健,市值以及权益较大,市场地位突出;
 (4) 市场前景良好,行业景气度高且行业具有良好的公共收益及投资回报,良好的股价走势(慢牛特征、抗周期性)等等。
 本基金投资的成长型上市公司具有以下主要特点:
 (1) 公司成长能力强,主营业务和行业具有良好的成长性;同时,销售增长率或收益增长率高;
 (2) 公司在中小公司,有优于同行其他公司的某种竞争优势;
 (3) 公司具有成长潜力,已建立并拥有较强的管理团队,具有较大发展空间;
 (4) 公司处于技术前沿,创新能力强。
5. 权证投资
 根据权证作为衍生品种本身的特性和作用,本基金在权证投资上主要运用以下投资策略:基于标的证券未来合理估值分析以及权证自身比例基础上的买入/保护策略及权证投资策略;基于权证杠杆比率、Delta对冲比分析基础上的权证替换投资策略;基于Black-Scholes等权证合理定价分析方法法基础上的权证与标的证券的套利投资策略。
(二) 投资法规
 1. 决策依据
 (1) 国家有关法律、法规和基金合同的约定;
 (2) 国家宏观经济环境及其对债券市场的影响;
 (3) 国家货币政策、财政政策以及证券市场走势;
 (4) 发债公司财务状况、行业地位、经济和市场需求状况及其当前市场价格;
 (5) 货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。
 2. 决策程序
 (1) 确定投资策略
 基金经理在宏观、债券以及金融工程研究员提供的研究报告和模型的基础上完成最终的投资策略报告,上报投资决策委员会审批。投资决策委员会审批通过后,交由风险管理委员会备案监督,并由基金经理进行具体实施。
 (2) 进行资产配置
 基金经理根据前述研究报告和投资策略报告,对基金资产在个市场进行合理的配置,为每个市场设计合理的久期,并根据基金资产风险对每个市场进行不同的风险等级。
 (3) 进行品种配置
 运用组合优化模型构建初始组合,然后根据市场的变动情况及时对组合进行调整。但是调整的幅度不得超过整体的投资策略和资产配置策略。
(三) 组合风险监控
 风险监控小组每日对组合主要来自于两个方面,一是可能出现的需要,例如出现极具吸引力短期买入或卖出机会;二是风险监控的需要,由专门的风险管理小组对持仓和交易进行监控,基金经理或者风险管理小组发现组合局部或者整体风险超标时,基金经理应立即对组合进行调整。
(四) 风险监控与业绩分析
 风险监控小组每日对组合进行风险监控,出具风险监控报告,同时还将对组合的债券基金业绩进行归因分析,找出基金投资策略的长处和短处,为未来的管理提供有益的借鉴。
(三) 资产配置优化的投资策略、风险控制措施及投资比例
1. 投资策略
 本基金在确定与基金投资目标相一致的前提下,可以着重通过风险和可控的回报,为取得与承担风险相称的收益,投资于资产支持证券。
(1) 买入持有策略
 基金可在与投资目标一致的前提下,买入并持有资产支持证券,以获取相应的利息收入。
(2) 利率预期策略
 根据对利率趋势、提前还款率等的预测,调整资产支持证券收益率的变化幅度,从而决定资产支持证券的买入或卖出。
(3) 持有策略
 通过对资产支持证券的信用评级、分析近期违约率和违约损失率的变化情况,评估其信用价差是否合理,并预测其变化趋势,通过其信用利差的改善和利差的缩小获利。
(4) 相对价值策略
 基金通过计算资产支持证券的名义利差、套利利差及期限调整利差等指标,将资产支持证券的相对风险特征与其他资产类别和债券的收益风险特征,确定其是否具有相对价值,从而决定对其整体或个券的买入和卖出。
2. 风险控制措施
 (1) 通过严格的投资流程控制投资风险,基金经理及有关人员必须严格执行投资控制制度。
 (2) 在投资资产支持证券时,首先应由固定收益研究员提出资产支持证券的风险收益报告和投资建议,基金经理根据投资决策委员会的配置计划制定相应的投资授权,参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告,充分评估资产支持证券的风险收益特征,确定具体投资方案,在严格控制风险的前提下,谨慎进行投资。
(三) 交易员负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责,监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。
(四) 风险监控
 (1) 风险监控小组对资产支持证券投资进行风险监控和绩效评估,密切跟踪影响基金资产支持证券投资的各种因素,并在投资中进行相应调整,以规避风险的上升。
(5) 固定收益研究员负责不断完善资产支持证券定价模型,并评估模型风险,密切跟踪影响资产支持证券投资的各种因素,并评估其对应资产支持证券持有期间的收益,并进行相应的投资决策。
(6) 基金经理负责资产支持证券投资的上市流程和流动性支持安排,并考虑其对基金资产流动性的影响,分散投资,确保所持有资产支持证券具有适当的流动性。
(7) 基金经理将密切关注影响债务人提前还款的各种因素,并评估其对资产支持证券投资价值的影,并进行相应的投资决策。
(8) 基金经理负责投资授权及风险控制手段,确保基金相关操作以谨慎安全的方式进行,确保基金资产持有及风险得到保障。
(9) 严格审查所投资资产支持证券的法律文件,确保各环节都有适当的法律保障。

十二、基金的投资组合报告

本系列基金基金管理人的董事会及董事保证本投资组合报告中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。

本系列基金托管人中国工商银行根据本系列基金合同约定,于2019年4月26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至2019年3月31日,本报告中列示财务数据未经审计。

(一) 融通债券基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	0.00
1.1	其中:股票	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	1,120,639,990.05	94.08
3.1	其中:债券	1,120,639,990.05	94.08
4	贵金属投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	44,775,678.70	3.76
8	其他资产	25,719,589.46	2.16
9	合计	1,191,135,258.21	100.00

2. 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	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	222,034,275.00	23.43
3.1	其中:政策性金融债	222,034,275.00	23.43
4	企业债券	381,587,642.00	40.26
5	企业短期融资券	20,662,000.00	2.16
6	中期票据	471,303,000.00	49.72
7	可转债(可交换债)	25,653,073.05	2.71
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	1,120,639,990.05	118.23

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	180406	18农发06	1,000,000	105,950,000.00	11.18
2	101801461	18熊猫10C	500,000	50,590,000.00	5.34
3	136143	16万达01	460,000	46,878,600.00	4.95
4	180310	18进出10	400,000	43,032,000.00	4.54
5	127831	18国债01	300,000	31,782,000.00	3.35

4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	539,572,217.58	63.00
1.1	其中:股票	539,572,217.58	63.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	162,095,162.40	18.93
3.1	其中:债券	162,095,162.40	18.93
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	149,249,563.88	17.43
8	其他资产	5,571,007.38	0.65
9	合计	856,487,931.24	100.00

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	-	-
B	制造业	370,163,067.97	46.95
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	76,707,488.00	9.73
G	交通运输、仓储和邮政业	8,229,620.00	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	56,444,422.33	7.16
J	房地产业	134,343.00	0.02
K	金融业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,103,516.28	1.28
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、修和其他	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	17,789,760.00	2.26
S	综合	-	-
合计	539,572,217.58	68.44	

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

代码	行业类别	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002640	跨境通	6,705,200	76,707,488.00	9.73
2	002180	纳思达	2,048,719	64,482,496.29	8.18
3	300011	特锐德	2,485,643	55,581,463.91	7.05
4	002832	比音勒芬	1,161,647	51,925,620.00	6.59
5	300525	博思股份	1,361,199	48,023,100.72	6.09
6	603308	惠盈股份	3,910,629	42,860,493.84	5.44
7	603577	三棵树	546,695	32,085,713.50	4.07
8	002745	林森	1,536,900	23,868,057.00	3.03
9	603208	江川控股	565,900	22,046,300.00	2.80
10	603129	春风动力	829,683	18,833,804.10	2.39

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,877,147,024.37	94.60
1.1	其中:股票	4,877,147,024.37	94.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	162,301,530.00	3.15
3.1	其中:债券	162,301,530.00	3.15
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	88,108,437.53	1.71
8	其他资产	28,245,245.25	0.55
9	合计	5,155,802,235.15	100.00

2. 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、业	262,926,796.13	5.12
B	制造业	14,000,211.75	0.27
C	制造业	3,101,393,549.51	60.34
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	33,743,946.90	0.66
F	批发和零售业	96,309,534.39	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	12,710,802.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	323,853,054.56	6.30
J	房地产业	512,879,100.43	9.98
K	房地产业	334,793,324.14	6.51
L	租赁和商务服务业	68,237,319.15	1.33
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、修和其他	16,790,134.34	0.33
P	教育	-	-
Q	卫生和社工作	77,297,457.79	1.50
R	文化、体育和		