

（上接D4版）

（二）投资策略

本基金主要通过投资于目标ETF基金份额,标的指数成份股,备选成份股,为更好地实现投资目标,本基金还可投资于与标的指数成份股、备选成份股相似的股票、债券、衍生品、货币市场工具、信用债(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股指期货、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资融券业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本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:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,每个交易日终在扣除股指期货、国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者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、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许基金变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资策略

1.目标ETF投资策略
本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF。根据投资者申购、赎回的现金流量情况,本基金将密切跟踪目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析,对投资组合进行实时监控和调整,力争获得较好的投资效果。本基金可以参与基金申购赎回二级市场交易。

2.股票投资策略
本基金通过买入标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数,也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股的方式申购目标ETF。为了“更好地实现投资目标,对于出现市场流动性不足等情况,导致基金无法按照拟定的投资计划,本基金管理人有权通过二级市场申购目标ETF的方式进行替代。”

3.衍生品投资策略
为了更好地实现投资目标,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析、定量分析等方式,选择恰当的衍生品投资标的。

4.债券投资策略
结合对未来利率市场预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利率轮动策略等多种积极管理策略,通过严谨的信用分析发现被低估的债券和债券类属资产,构建稳健投资、流动性好的投资组合。基金还可参与风险低且可控的衍生品等投资。

5.衍生品投资策略
为了更好地实现投资目标,本基金还有权投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生品工具。

基金参与股指期货、股票期权等衍生品交易,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的标的合约,股票期权合约,以提高投资组合的流动性,同时降低投资组合成本,实现套期保值。

基金参与国债期货等,应遵循风险管理的原则,以套期保值为目的。

基金参与股指期货及期权交易,基金管理人将根据审慎原则,建立决策机制(或小组),授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,以防范股指期货投资的风险。

基金参与国债期货等,应遵循风险管理的原则,以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

6.资产支持证券投资策略
本基金将投资于资产支持证券的信用评级、发行条款、支持资产的结构及质量、增信措施等,从风险收益特征和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,按照资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,综合采用久期管理、评估其内在价值。

7.可转换债券
本基金将对可转换债券,可交换债券等品种,在深入研究的基础上,通过定性分析、定量分析等方式,选择具有较好盈利能力和成长潜力的品种进行投资。同时,本基金还将密切跟踪上市公司经营状况,从财务支付、转股意愿、未来的盈利状况等方面推演,并通过实地调研等方式上市公司对转股价格的修正和转股意愿,以更好地把握投资机会。

8.参与融资融券业务决策
为了更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下,本基金可根据投资需要参与融资融券业务。本基金可在符合法律法规的前提下,审慎参与融资融券业务,基金资产申购赎回管理、出售证券流动性等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。

未来,随着证券市场工具创新的发展和丰富,本基金可在不改变投资目标和基金风险收益特征的前提下,遵循法律法规的规定,经履行适当程序后将新增或更新相关投资品种,并在招募说明书更新中公告。

（四）投资限制

1.组合限制

本基金的投资组合遵循以下限制:

(1)本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%;

(2)每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易所保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1个月以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金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%;

(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)本基金持有的同一(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%;

(6)本基金管理人管理的全部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%;

(7)本基金应投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用评级下降,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;

(8)基金资产参与股指期货交易,本基金应遵守中国证监会关于基金投资股指期货业务的相关规定,基金持仓不得超过基金总资产的20%,本基金所申报的股票数量不得超过拟买入股票数量的20%;

(9)本基金在进行债券正回购的资金余额或逆回购的资金余额不得超过其上一日基金资产净值的40%,进行债券回购的最长期限为1年;

(10)本基金基金投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司流动性受限、基金赎回压力等因素导致基金不符合上述比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(11)本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开展回购交易而持有的,可变现金融资产余额不得超过与基金资产净值比例保持不低于10%;

(12)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%,在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%,在任何交易日内(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(13)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金资产净值的30%;基金在任何交易日日终(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;基金持有的国债期货(不含平仓)合约价值,和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于国债期货投资比例的有关约定;

(14)在任何交易日日终,持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(15)本基金参与股指期货交易,其持仓合约价值不得超过基金资产净值的10%,平仓开出的股指期货合约,应当符合中国证监会关于股指期货交易的相关规定,所有合约持仓的现金或交易保证金总额不得超过基金资产净值的20%。其中,合约市值按照行权价或合约结算价计算;

(16)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(17)本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开展回购交易而持有的,可变现金融资产余额不得超过与基金资产净值比例保持不低于10%;

(18)本基金参与股指期货交易,其持仓合约价值不得超过基金资产净值的10%,平仓开出的股指期货合约,应当符合中国证监会关于股指期货交易的相关规定,所有合约持仓的现金或交易保证金总额不得超过基金资产净值的20%。其中,合约市值按照行权价或合约结算价计算;

(19)法律法规及中国证监会规定和基金合同约定的其他投资限制。

(20)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(21)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(22)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(23)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(24)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(25)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(26)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(27)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(28)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(29)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(30)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(31)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(32)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(33)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(34)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(35)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(36)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(37)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(38)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(39)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(40)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(41)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(42)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(43)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(44)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(45)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(46)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(47)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(48)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(49)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(50)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(51)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(52)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(53)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(54)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(55)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(56)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(57)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(58)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(59)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(60)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(61)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(62)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(63)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(64)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(65)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(66)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(67)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(68)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(69)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(70)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(71)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(72)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(73)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(74)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(75)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(76)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(77)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(78)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(79)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(80)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(81)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(82)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(83)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(84)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(85)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(86)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(87)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(88)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(89)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(90)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(91)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(92)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(93)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(94)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(95)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(96)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(97)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(98)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(99)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(100)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(101)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(102)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(103)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

(104)本基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其重大关联方发行的证券,或者从事内幕交易、关联交易等事项,应符合中国证监会的相关规定,并履行信息披露义务,不得损害基金份额持有人的合法权益。

本基金本报告期末持有股票

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.5 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	1,621,239.23	4.39
2	中期票据	-	-
3	地方政府债	-	-
4	央行票据	-	-
5	企业债	-	-
6	公司债	-	-
7	可转债(含可交换债)	-	-
8	可转换分离债	-	-
9	其他	-	-
10	其他	1,621,239.23	4.39

5.6 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	019773	25国债08	16,000	1,621,239.23	4.39
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.7 报告期末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。

5.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资策略

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资概况

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.12.2 本基金投资的前十名股票未涉及境内被证监会处罚的证券。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应收利息	51,976.94
2	应收股利	-
3	应收申购款	-
4	其他应收款	-
5	其他	230,548.27
6	待摊费用	-
7	递延所得税资产	-
8	其他	