

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金更新招募说明书摘要

(上接 94 页)

(92) 华鑫证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 8 号
法定代表人: 俞萍
客户服务电话: 963231; 4001099918
公司网站: www.cfsc.com.cn
(93) 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 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元
办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层
法定代表人: 龙增荣
客服热线: 4006008008
公司网址: www.china-invs.cn
(94) 西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦
法定代表人: 陈宏
客服热线: 96357
公司地址: http://www.18.cn
(95) 九州证券股份有限公司
注册地址: 青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层
法定代表人: 陈先强
客服热线: 963305
公司网址: http://www.jzsec.com
(96) 国金证券股份有限公司
注册地址: 四川省成都市东城根上街 95 号
办公地址: 四川省成都市东城根上街 95 号
法定代表人: 冉云
客服热线: 96310
公司网址: www.gjzq.com.cn
(97) 华宝证券有限责任公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层
法定代表人: 陈林
客服电话: 4008209898
公司网址: www.hwbstock.com
(98) 长城国瑞证券有限公司
注册地址: 厦门市思明区莲前西路 2 号富嘉大厦 17 楼
办公地址: 厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼
法定代表人: 王勇
客服热线: 400-0099-886
公司网址: www.gwqz.com
(99) 爱建证券有限责任公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼
法定代表人: 祝健
客服电话: 4001962052
公司网址: www.ajzq.com
(100) 金惠家保险代理有限公司
注册地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107
办公地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107
法定代表人: 夏子钰
客服热线: 400-8567333
公司网址: www.jhfund.com
(101) 阳光人寿保险股份有限公司
注册地址: 海南省三亚市河东区三亚湾路海商商务 12、13 层
办公地址: 海南省海口市朝晖 1 号大街 12 号 12 层
法定代表人: 李科
客服电话: 4006-902-123
公司网址: https://www.zhixin-in.com/
3. 基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的约定, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时履行公告义务。

(二) 注册登记机构: 东吴基金管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区源深路 279 号 (200135)
办公地址: 上海市浦东新区源深路 279 号 (200135)
法定代表人: 王刚
联系人: 王刚
电话: 021-50609898
传真: 021-50609894
客户服务电话: 4008210588
网站: www.sctfund.com.cn
(三) 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
负责人: 俞卫锋
电话: 021-31358666
传真: 021-31358600
联系人: 陆奇
经办律师: 黎明、陆奇

(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: 上海市东城区东长安街 1 号东方广场安永大厦 17 层
执行事务合伙人: 毛锐宁
电话: 010-58163000
传真: 010-58188298
联系人: 徐旭
经办注册会计师: 徐旭、张亚丽
四、基金的名称
本基金名称: 东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金
五、基金的投资目标
本基金类型: 契约型开放式混合型基金
六、基金的投资目标
分享中国经济成长, 以中低风险水平获取中长期较高收益。
本基金通过个股精选、科学的操作策略及严密的风险控制等手段来降低投资风险, 力争将本基金的风险水平控制在比较基准的一定幅度范围内; 同时, 本基金通过对中国经济成长规律的准确把握和具有价值成长比较优势股票的前瞻性投资来分享中国经济成长, 获得中长期较高收益。

七、基金的投资方向
本基金投资范围为法律法规允许基金投资的良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具, 具体比例范围为: 30%-95% 的基金资产投资于股票, 投资债券资产不高于基金资产的 60%, 现金类资产最低比例为 5%, 其中, 现金类资产不包括库存现金、存出保证金、应收申购款等。基金股票资产的 80%以上投资于三只比较优势选股模型选出的股票。
八、基金的投资策略
1. 资产配置策略: 平衡风险收益, 把握优势成长
通过评估各细分市场的风险收益水平, 再根据本基金的风险收益目标动态调整股票、债券及现金类资产的配置比例。在配置比例上, 股票优先, 其次债券。在股票资产配置上以优势行业和优势企业为主。
2. 股票选择策略: 三只比较优势选股模型
本基金通过行业、企业及价格比较优势选股模型对个股在行业、企业及价格三方面比较优势的分析筛选构建本基金股票池。
具体过程为: 首先根据东吴量化行业综合评价模型对所有行业进行分析排名, 按排名结果将所属行业行业划分为东吴优势行业、一般行业和弱势行业。其次, 根据东吴量化企业优势综合评价模型构建东吴优势初选库(Ⅰ); 根据东吴 EVA 价格比较优势选股模型构建东吴优势初选库(Ⅱ); 第三, 取初选库(Ⅰ)和初选库(Ⅱ)交集集中东吴优势行业部分的股票作为本基金股票池的主要备选股票库; 取(Ⅰ)和(Ⅱ)交集不属于东吴优势行业部分的股票作为本基金股票池的补充备选股票库。最后, 主要备选股票库和补充备选股票库经过流动性优化后共同构成本基金最终股票池。
3. 股票操作策略: 周期持有, 波段操作
本基金将根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律在最具成长优势的时间段上中期长期持有证券资产, 同时根据指数及个股运行的时空和价差收益进行最有利的时点上进行中期波段操作。
4. 债券投资策略
本基金在债券品种选择上, 遵循相对价值原则和流动性原则, 相对价值原则指选择到期收益率处于收益率曲线上方, 且在到期收益率接近的券种中, 选择久期较短者; 在久期接近的券种中, 选择凸性较大者; 流动性原则指选择交易活跃的券种, 用换手率或周换手率指标来衡量。
本基金对债券资产品种选择的依据为不同品种之间的风险收益水平, 配置方法根据利率变动情况分别考虑利率、通胀等因素综合考虑方法, 同时考虑动态调整和组合久期, 可转债品种配置将综合考虑市场容量、条款对价格的影响等因素。
5. 现金管理策略
充分利用交易所市场与银行间市场的无风险投资机会, 提高现金使用效率。
九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准: 65%*(60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数)+35%*中证全债指数。
十、基金的风险收益特征
本基金定位于中低风险水平, 力求通过选股方法、投资策略等, 谋求中长期较高收益。
十一、基金的投资组合报告
东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的约定, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时履行公告义务。

本基金的资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	371,779,646.48	89.49
2	固定收益	371,779,646.48	89.49
3	现金类资产	10,642,133.58	2.54
4	资产支持证券	10,642,133.58	2.54
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,699,679.12	7.87
8	其他资产	416,481.81	0.10
9	合计	416,481,811.00	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,977,113.26	4.54
B	医药	19,064,263.00	4.56
C	制造业	154,967,943.24	37.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,287,028.84	2.00
E	建筑业	16,833,475.00	4.01
F	批发和零售业	22,300,012.04	5.37
G	交通运输、仓储和邮政业	68,100,672.84	16.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,075,528.00	6.73
J	金融业	28,075,528.00	6.73
K	房地产业	4,208,146.83	1.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	29,547,470.00	7.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、文体和娱乐业	-	-
P	国防军工	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,676,046.00	2.10
S	合计	371,779,646.48	89.49

2.2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。

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组合

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	300864	华鲁恒升	274,488	24,556,028.00	5.96
2	300076	华兰生物	279,588	22,775,100.00	5.53
3	300077	华谊集团	2,091,520	22,269,758.52	5.43
4	600850	王府井	1,538,000	22,046,720.00	5.34
5	002773	康拓股份	562,762	19,172,969.64	4.64
6	601225	联华环保	2,542,400	19,094,296.00	4.59
7	300094	国盛金控	2,718,528	18,911,712.00	4.58
8	600955	山推股份	1,315,248	18,490,780.00	4.48
9	300523	金明科技	1,487,200	16,340,213.00	3.97
10	000461	海康威视	1,949,200	14,434,532.00	3.49

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	100,000.00	0.02
2	13国债07	6,534,560.16	1.58
3	13国债08	20,200,000.00	0.00

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十名债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	13国债07	100,000.00	0.02
2	13国债07	6,534,560.16	1.58
3	13国债08	20,200,000.00	0.00

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股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
10.1 本期股指期货投资政策
10.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.3 本期股指期货投资对基金资产净值的影响
10.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.5 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.6 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.7 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.84 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.85 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.87 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.88 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.89 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.92 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.93 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.95 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.96 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.97 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.99 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
10.100 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

鹏华可转债债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

(上接 93 页)

得超额收益。
1) 传统可转债投资策略
传统可转债策略指可转换公司债券, 是指在规定的期限内持有人有权没有义务按约定的价格转换成公司股票的—种公司债券, 兼具债权和股权双重属性。其属性是指投资者可以选择持有可转债到期, 得到本金与利息收益; 也可以选择转股获取股权, 是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格将可转债转换成股票。因此, 可转债的价格由债权价格和期权价格共同组成。
a. 交易策略
一方面, 本基金将对于所有可转债对应的标的股票进行深入的研究, 采用定性分析(行业地位、竞争优势、治理结构、市场前景、创新能力等)与定量分析(P/B、P/R、PEG、DCF、DDM、NAV 等)相结合的方式进行挑选, 选择成长性良好且估值合理的标的; 另一方面, 本基金将深入研究可转债自身的信用评估。综上所述, 本基金将结合可转债自身的信用评估和其转股期的价值分析, 做为选取个券的重要依据。
b. 套利策略
可转债价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款, 包括修正转股价格条款、回售条款、赎回条款等, 这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。修正转股价格条款赋予了发行人向下修正转股价格的权利, 有利于提升可转债的期权价值; 回售条款赋予了投资者将可转债按照约定价格回售给发行人的权利。为可转债投资提供了一种安全边际; 赎回条款赋予了发行人投资者赎回可转债的权利, 若发行人放弃赎回权利则会提高可转债的期权价值。本基金将通过有效分析相关信用力来把握各项条款对可转债带来的可能的投资机会。
c. 套利策略
可转债可以按照约定的价格转换成股票, 因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当处于转股期内的可转债价格低于转股价值, 即可转债的转换溢价率为负时, 买入可转债的同时卖出对应的股票可以获得套利价差; 反之, 买入标的股票的同时卖出可转债也可以获得套利的价差。在日常交易中, 本基金将密切关注可转债与标的股票之间的价差, 择机实施套利策略, 以增强本基金的投资收益。
2) 分离交易可转债投资策略
分离交易可转债与传统可转债的不同点主要体现在分离交易可转债上市后的分离交易可转债权证部分各自独立进行发行。本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时, 将重点分析权证部分对债券价值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理, 权证部分将在可交之日起不超过 3 个月的期限内卖出。
(2) 普通债券投资策略
本基金债券投资将主要采取久期策略、类属配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略。
1) 久期策略
本基金将通过自上而下的组合久期管理策略, 以实现对组合利率风险的主动控制。基金管理人将根据对宏观经济周期所处阶段及其他相关因素的研究判断债券久期。如果预期利率下降, 本基金将增加组合的久期, 以较多地获得债券价格上涨带来的收益; 反之, 如果预期利率上升, 本基金将缩短组合的久期, 以减小债券价格下降带来的风险。
2) 类属配置策略
本基金在确定久期的基础上, 通过对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的分析, 预测各类属资产预期收益及收益情况, 并结合不同债券品种期限和不同债券市场流动性及收益性现状, 制定普通债券品种和期限配置策略, 确定普通债券组合资产在政府债券、企业主体债券、货币资产之间的分配比例。
3) 收益率曲线策略
收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一, 本基金将根据此预测债券的长短、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测, 适时采用子弹、杠铃或梯形策略构建组合, 并进行动态调整。
4) 骑乘策略
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析, 在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右端的债券。在收益率曲线不变动的情况下, 随着其剩余期限的衰减, 债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑, 从而获得较高的资本收益, 即使收益率曲线上升或进一步平坦, 这一策略也能够提供更多的安全边际。
5) 息差策略
本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形, 通过正回购将所获得资金投资于债券, 利用杠杆放大债券投资收益。
6) 债券选择策略
根据单个债券投资价值相对于市场收益率曲线的偏离程度, 结合信用等级、流动性、选择权条款、期权条款等因素, 确定其投资价值, 选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。
7) 中小企业私募债券投资策略
中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行转让, 约定在一定期限内还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款协商性, 普遍具有较高收益。本基金将深入研究和充分挖掘其投资价值, 合理合规地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切跟踪债券信用评级等情况发生, 及时评估其信用风险, 尽量选择有增信措施的债券投资, 并获取超额收益。
3. 股票投资策略

本基金的资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	3,771,266.66	7.92
2	固定收益	3,771,266.66	7.92
3	现金类资产	41,146,488.87	88.27
4	资产支持证券	41,146,488.87	88.27
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,088,902.14	6.53
8	其他资产	289,488.17	0.62
9	合计	89,293,133.74	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	69,060.00	0.15
B	医药	129,713.75	0.28
C	制造业	2,179,186.89	4.72
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	119,570.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	489,966.02	1.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	403,280.20	1.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	176,263.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、文体和娱乐业	-	-
P	国防军工	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	3,771,266.66	8.21

2.2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。

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组合

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	601800	联华环保	20,500	3,367,675.00	7.21
2	13国债07	国债逆回购	28,800	2,851,028.00	6.24
3	12国债06	交通银行	14,788	1,736,674.42	3.71
4	12国债08	招商银行	14,788	1,566,073.20	3.34
5	12国债06	民生银行	16,104	1,490,365.00	3.24

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	3,367,675.00	7.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,367,675.00	7.21
4	企业债券	3,367,675.00	7.21
5	中期票据	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	可转换债券(可交换债)	37,789,013.17	82.22
8	其他	-	-
9	合计	41,146,488.87	88.27

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组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	601800	联华环保	3,367,675.00	7.21	
2	13国债07	国债逆回购	28,800	2,851,028.00	6.24
3	12国债06	交通银行	14,788	1,736,674.42	3.71
4	12国债08	招商银行	14,788	1,566,073.20	3.34
5	12国债06	民生银行	16,104	1,490,365.00	3.24

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
(1) 本期股指期货投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(2) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(3) 本期股指期货投资对基金资产净值的影响
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(4) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(5) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(6) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(7) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(8) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(9) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(10) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(11) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(12) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(13) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(14) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(15) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(16) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(17) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(18) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(19) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(20) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(21) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(22) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(23) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(24) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(25) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(26) 报告期末本基金投资的股指期货持仓