

中融恒泰纯债债券型证券投资基金 2017年第一季度报告 2017年03月31日

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2017年04月21日
1. 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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。

2.1 基金基本情况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 报告期末基金份额总额.

3.1 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 中融恒泰纯债 A, 中融恒泰纯债 C. Rows include 1. 本期已实现收益, 2. 本期利润, 3. 加权平均基金份额本期利润, 4. 期末基金资产净值, 5. 期末基金份额净值.

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,截至本报告期末仍在建仓期内。

4. 基金管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明.

注:(1)上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、《中融恒泰纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行,公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,在研究、决策、交易执行各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合,保证公平交易原则的实现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
经过过去一季度的运作,债券市场收益率大幅上行,10年期国债收益率在一月初达到了4.6%左右,度过了年底的紧张期,一月份债券市场比较平稳,春节后央行超预期提高了公开市场操作利率,这种变化和消息使得债券收益率快速上行,10年期国债收益率超过了4.2%。鉴于今年经济增速一季度达到高点,后面几个季度随着风险偏好的降低,4%以上的利率作为配置价值显现,所以3月份的市场在诸多利空扰动下,长端利率依然下行明显。

自去年8月份央行通过重启14天以上逆回购以来,央行即开启了金融去杠杆之路,我们认为此过程会维持较长时间,因此17年上半年大类资产配置中,现金类资产性价比最高,本基金今年一季度债券的配置主要以现金类资产为主。

在基建和地产的带动下,一季度宏观经济比较平稳,随着管理层对地产调控政策的升级,后续房地产在投资增速有待观察,另外金融去杠杆导致的银行端流动性紧缩会传导至企业融资,使得企业融资成本提升,在此影响下料今年的经济增速会呈现出前高后低的走势。

在经济较为平稳,一带一路、雄安新区等一揽子政策催化下,一季度股票市场对比较活跃,偏周期类的地产、基建、PPP等热点不断涌现。在流动性相对偏紧的大背景下,股票走势表现出存量博弈的特征,偏周期和确定性增长的大消费相对较强,而风险偏好较高的偏成长类个股相对较弱。随着一季报的披露,周期类个股会被逢季下行的经济增速所证伪,结构依然是经济的重要矛盾,随着估值修复复合合理区间,业绩稳定增长的成长类个股预计会成为二季度的热点。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
截至报告期末中融恒泰纯债 A 基金份额净值为 1.0026 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.81%,同期业绩比较基准收益率为 -0.34%。截至报告期末中融恒泰纯债 C 基金份额净值为 1.0023 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.78%,同期业绩比较基准收益率为 -0.34%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资, 2. 基金投资, 3. 固定收益投资, 4. 贵金属投资, 5. 金融衍生品投资, 6. 买入返售金融资产, 7. 银行存款和结算备付金合计, 8. 其他资产, 9. 合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债债券, 2. 央行票据, 3. 金融债券, 4. 企业债券, 5. 企业短期融资券, 6. 中期票据, 7. 可转换债(可交换债), 8. 同业存单, 9. 其他, 10. 合计.

5.5 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

Table with columns: 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(%). Rows include 1. 111698126, 2. 170401, 3. 111688820, 4. 111681062, 5. 111681115.

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投资。

5.7 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投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 其他, 8. 合计.

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.7 开放式基金份额变动

Table with columns: 单位:份, 中融恒泰纯债 A, 中融恒泰纯债 C. Rows include 报告期初基金份额总额, 报告期间基金总申购份额, 减:报告期间基金总赎回份额, 报告期间基金份额变动(增加/减少), 报告期末基金份额总额.

5.11.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

5.11.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

Table with columns: 投资者序号, 持有基金份额比例达到或超过 20% 的时间区间, 期初份额, 中期份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比(%). Rows include 机构 1, 机构 2.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

9.1 备查文件目录

- (1)中国证监会准予中融恒泰纯债债券型证券投资基金募集的文件
(2)中融恒泰纯债债券型证券投资基金基金合同
(3)中融恒泰纯债债券型证券投资基金招募说明书
(4)中融恒泰纯债债券型证券投资基金托管协议
(5)基金管理人业务资格批件、营业执照
(6)基金托管人业务资格批件、营业执照
(7)中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人的办公场所
9.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅,也可在支付工本费后,在合理时间取得上述文件的复印件。
咨询电话:中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000 (免长途话费),010-85003210
网址: http://www.zrfunds.com.cn/

中融基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

中融中证钢铁行业指数分级证券投资基金 2017年第一季度报告 2017年03月31日

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:海通证券股份有限公司
报告送出日期:2017年04月21日
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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。

基金管理人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月17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。

2.1 基金基本情况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 报告期末基金份额总额.

3.1 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期末(2017年01月01日至2017年03月31日). Rows include 1. 本期已实现收益, 2. 本期利润, 3. 加权平均基金份额本期利润, 4. 期末基金资产净值, 5. 期末基金份额净值.

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,截至本报告期末仍在建仓期内。

8. 基金管理人报告

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

Table with columns: 投资者序号, 持有基金份额比例达到或超过 20% 的时间区间, 期初份额, 中期份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比(%). Rows include 机构 1, 机构 2.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

9. 备查文件目录

- (1)中国证监会准予中融中证钢铁行业指数分级证券投资基金募集的文件
(2)中融中证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同
(3)中融中证钢铁行业指数分级证券投资基金招募说明书
(4)中融中证钢铁行业指数分级证券投资基金托管协议
(5)基金管理人业务资格批件、营业执照
(6)基金托管人业务资格批件、营业执照
(7)中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人的办公场所
9.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅,也可在支付工本费后,在合理时间取得上述文件的复印件。
咨询电话:中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000 (免长途话费),010-85003210
网址: http://www.zrfunds.com.cn/

中融基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资, 2. 基金投资, 3. 固定收益投资, 4. 贵金属投资, 5. 金融衍生品投资, 6. 买入返售金融资产, 7. 银行存款和结算备付金合计, 8. 其他资产, 9. 合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(指数基金)按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%). Rows include A. 农、林、牧、渔业, B. 采矿业, C. 制造业, 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, 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. 居民服务、修理和其他服务业, P. 教育, Q. 卫生和社会工作, R. 文化、体育和娱乐业, S. 综合, 合计.

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.3.1 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 600019, 2. 600010, 3. 002075, 4. 000709, 5. 000778, 6. 000825, 7. 600307, 8. 600022, 9. 600808, 10. 002343.

5.3.2 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票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细