

# 海富通风格优势股票型证券投资基金

## 2010 第一季度报告

2010年3月31日

**基金管理人:海富通基金管理有限公司**  
**基金托管人:中国建设银行股份有限公司**  
**报告送出日期:2010年4月20日**

**1.1 重要提示**

基金管理人及董事承诺本报告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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年4月19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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至2010年3月31日止。

基金简称	海富通风格优势股票
基金主代码	510913
基金运作方式	契约型开放式
报告期末基金份额总额	20069.10 万 19 日
报告期末基金份额总额	7,234,270,647.49
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,通过把握市场不同风格股票的轮动,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
投资策略	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,通过把握市场不同风格股票的轮动,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
业绩比较基准	75%MSCI China A-25%上证综指
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于中高风险、较高收益的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
项目	报告期(2010年1月1日至2010年3月31日)
1.本期已实现收益	256,167,171.30
2.本期利润	97,263,544.90
3.期末资产净值	0.044
4.期末基金资产净值	8,182,213,082.24
5.期末基金份额净值	1.131

注:1.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。

2.期末资产净值是指基金期末资产减去负债后的余额。

3.2 基金业绩表现

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	0.085%	1.20%	-1.44%	0.06%	4.22%

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

海富通风格优势股票基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**4.1 基金经理 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**4.2 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**5.1 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。

**5.2 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五名债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**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资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.8 投资组合报告附注**

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,282,846.32
2	应收证券清算款	101,708,989.81
3	应收利息	-
4	应收股利	217,727.94
5	应收申购款	11,912,253.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,121,817.86

注:1.对基金的投资组合基金管理人,其任日期指基金合同生效日,离任日期指基金做出决定之日;非任基金经理,其任日期指离任日期指基金做出决定之日。

2.基金经理在报告期内未发生变更。

3.基金经理在报告期内未发生变更。

4.基金经理在报告期内未发生变更。

5.基金经理在报告期内未发生变更。

6.基金经理在报告期内未发生变更。

7.基金经理在报告期内未发生变更。

8.基金经理在报告期内未发生变更。

9.基金经理在报告期内未发生变更。

10.基金经理在报告期内未发生变更。

11.基金经理在报告期内未发生变更。

12.基金经理在报告期内未发生变更。

13.基金经理在报告期内未发生变更。

14.基金经理在报告期内未发生变更。

15.基金经理在报告期内未发生变更。

16.基金经理在报告期内未发生变更。

17.基金经理在报告期内未发生变更。

18.基金经理在报告期内未发生变更。

19.基金经理在报告期内未发生变更。

20.基金经理在报告期内未发生变更。

21.基金经理在报告期内未发生变更。

22.基金经理在报告期内未发生变更。

23.基金经理在报告期内未发生变更。

24.基金经理在报告期内未发生变更。

25.基金经理在报告期内未发生变更。

26.基金经理在报告期内未发生变更。

27.基金经理在报告期内未发生变更。

28.基金经理在报告期内未发生变更。

29.基金经理在报告期内未发生变更。

30.基金经理在报告期内未发生变更。

31.基金经理在报告期内未发生变更。

32.基金经理在报告期内未发生变更。

33.基金经理在报告期内未发生变更。

34.基金经理在报告期内未发生变更。

35.基金经理在报告期内未发生变更。

36.基金经理在报告期内未发生变更。

37.基金经理在报告期内未发生变更。

38.基金经理在报告期内未发生变更。

39.基金经理在报告期内未发生变更。

40.基金经理在报告期内未发生变更。

41.基金经理在报告期内未发生变更。

42.基金经理在报告期内未发生变更。

43.基金经理在报告期内未发生变更。

44.基金经理在报告期内未发生变更。

45.基金经理在报告期内未发生变更。

46.基金经理在报告期内未发生变更。

47.基金经理在报告期内未发生变更。

48.基金经理在报告期内未发生变更。

49.基金经理在报告期内未发生变更。

50.基金经理在报告期内未发生变更。

51.基金经理在报告期内未发生变更。

52.基金经理在报告期内未发生变更。

53.基金经理在报告期内未发生变更。

54.基金经理在报告期内未发生变更。

55.基金经理在报告期内未发生变更。

56.基金经理在报告期内未发生变更。

57.基金经理在报告期内未发生变更。

58.基金经理在报告期内未发生变更。

59.基金经理在报告期内未发生变更。

60.基金经理在报告期内未发生变更。

61.基金经理在报告期内未发生变更。

62.基金经理在报告期内未发生变更。

63.基金经理在报告期内未发生变更。

64.基金经理在报告期内未发生变更。

65.基金经理在报告期内未发生变更。

66.基金经理在报告期内未发生变更。

67.基金经理在报告期内未发生变更。

68.基金经理在报告期内未发生变更。

69.基金经理在报告期内未发生变更。

70.基金经理在报告期内未发生变更。

71.基金经理在报告期内未发生变更。

72.基金经理在报告期内未发生变更。

73.基金经理在报告期内未发生变更。

74.基金经理在报告期内未发生变更。

75.基金经理在报告期内未发生变更。

76.基金经理在报告期内未发生变更。

77.基金经理在报告期内未发生变更。

78.基金经理在报告期内未发生变更。

79.基金经理在报告期内未发生变更。

80.基金经理在报告期内未发生变更。

81.基金经理在报告期内未发生变更。

82.基金经理在报告期内未发生变更。

83.基金经理在报告期内未发生变更。

84.基金经理在报告期内未发生变更。

85.基金经理在报告期内未发生变更。

86.基金经理在报告期内未发生变更。

87.基金经理在报告期内未发生变更。

88.基金经理在报告期内未发生变更。

89.基金经理在报告期内未发生变更。

90.基金经理在报告期内未发生变更。

91.基金经理在报告期内未发生变更。

92.基金经理在报告期内未发生变更。

93.基金经理在报告期内未发生变更。

94.基金经理在报告期内未发生变更。

95.基金经理在报告期内未发生变更。

96.基金经理在报告期内未发生变更。

97.基金经理在报告期内未发生变更。

98.基金经理在报告期内未发生变更。

99.基金经理在报告期内未发生变更。

100.基金经理在报告期内未发生变更。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	7,399,885,913.24	89.86
2	其中:股票	7,399,885,913.24	89.86
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	715,576,661.35	8.69
10	其他资产	119,121,817.86	1.45
11	合计	8,234,584,392.45	100.00

**基金管理人:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司**  
**基金托管人:交通银行股份有限公司**  
**报告送出日期:二〇一〇年四月二十日**

**1.1 重要提示**

基金管理人及董事承诺本报告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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年4月16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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至2010年3月31日止。

基金简称	摩根士丹利华鑫货币市场
基金主代码	163303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月17日
报告期末基金份额总额	304,566,694.72
投资目标	在力争本金安全和保持资产流动性的前提下,追求高于业绩比较基准的收益
投资策略	本基金主要投资于货币市场工具,通过把握市场不同风格股票的轮动,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
业绩比较基准	75%MSCI China A-25%上证综指
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于中高风险、较高收益的投资品种。
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
项目	报告期(2010年1月1日至2010年3月31日)
1.本期已实现收益	1,357,710.05
2.本期利润	1,357,710.05
3.期末资产净值	304,566,694.72
4.期末基金资产净值	304,566,694.72
5.期末基金份额净值	1.000

注: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。由于证券市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期的净收益。

3.2 基金业绩表现

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	0.085%	0.005%	0.554%	0.000%	-0.068%

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

摩根士丹利华鑫货币市场基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2006年8月17日至2010年3月31日

**4.1 基金经理 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**4.2 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**5.1 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。

**5.2 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五名债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**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资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.8 投资组合报告附注**

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	638,057.69
4	应收股利	-
5	其他应收款	3,985,803.45
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,623,861.14

**6.1 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**6.2 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

注:本基金合同于2006年8月17日正式生效。按照本基金基金合同规定,基金管理人应在基金合同生效后3个月内内的基金的投资比例符合基金合同的约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

# 摩根士丹利华鑫货币市场基金

## 2010 第一季度报告

2010年3月31日

基金简称	摩根士丹利华鑫货币市场
基金主代码	163303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月17日
报告期末基金份额总额	304,566,694.72
投资目标	在力争本金安全和保持资产流动性的前提下,追求高于业绩比较基准的收益
投资策略	本基金主要投资于货币市场工具,通过把握市场不同风格股票的轮动,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
业绩比较基准	75%MSCI China A-25%上证综指
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于中高风险、较高收益的投资品种。
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
项目	报告期(2010年1月1日至2010年3月31日)
1.本期已实现收益	1,357,710.05
2.本期利润	1,357,710.05
3.期末资产净值	304,566,694.72
4.期末基金资产净值	304,566,694.72
5.期末基金份额净值	1.000

注: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。由于证券市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期的净收益。

3.2 基金业绩表现

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	0.085%	0.005%	0.554%	0.000%	-0.068%

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

摩根士丹利华鑫货币市场基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2006年8月17日至2010年3月31日

**4.1 基金经理 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**4.2 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**5.1 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。

**5.2 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五名债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**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资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.8 投资组合报告附注**

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	638,057.69
4	应收股利	-
5	其他应收款	3,985,803.45
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,623,861.14

**6.1 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**6.2 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

注:本基金合同于2006年8月17日正式生效。按照本基金基金合同规定,基金管理人应在基金合同生效后3个月内内的基金的投资比例符合基金合同的约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

# 海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)

## 2010 第一季度报告

2010年3月31日

**基金管理人:海富通基金管理有限公司**  
**基金托管人:中国建设银行股份有限公司**  
**报告送出日期:2010年4月20日**

**1.1 重要提示**

基金管理人及董事承诺本报告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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年4月19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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至2010年3月31日止。

基金简称	海富通中证 100 指数(L0F)
基金主代码	162307
基金运作方式	上市型开放式
基金合同生效日	2009年10月30日
报告期末基金份额总额	1,746,979,309.02
投资目标	采用指数化投资方式,通过有效的投资组合和数量化投资管理系统,复制中证 100 指数收益率,追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制策略,跟踪标的指数的成份股及其权重构建基金投资组合,并跟踪标的指数的成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于中高风险、较高收益的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
项目	报告期(2010年1月1日至2010年3月31日)
1.本期已实现收益	-20,218,750.16
2.本期利润	-165,815,819.47
3.期末资产净值	-0.0807
4.期末基金资产净值	1,647,106,937.29
5.期末基金份额净值	0.943

注:1.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。

2.期末资产净值是指基金期末资产减去负债后的余额。

3.2 基金业绩表现

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	-8.00%	1.20%	-7.80%	1.27%	-0.20%

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

海富通中证 100 指数(L0F)基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2009年10月30日合同生效日起至2010年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**4.1 基金经理 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2009年10月30日合同生效日起至2010年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**4.2 基金管理人 魏基贤小组 简介**

注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2009年10月30日合同生效日起至2010年4月18日。建仓期结束本基金投资组合符合基金合同规定(第七条C)中规定的比例限制和本基金投资组合的比例范围。

**5.1 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。

**5.2 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五名债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**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资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**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权证投资组合**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.8 投资组合报告附注**

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	811,503.36
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	17,794.01
5	其他应收款	1,388,253.35
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,263,044.92

注:1.对基金的投资组合基金管理人,其任日期指基金合同生效日,离任日期指基金做出决定之日;非任基金经理,其任日期指离任日期指基金做出决定之日。

2.基金经理在报告期内未发生变更。

3.基金经理在报告期内未发生变更。

4.基金经理在报告期内未发生变更。

5.基金经理在报告期内未发生变更。

6.基金经理在报告期内未发生变更。

7.基金经理在报告期内未发生变更。

8.基金经理在报告期内未发生变更。

9.基金经理在报告期内未发生变更。

10.基金经理在报告期内未发生变更。

11.基金经理在报告期内未发生变更。

12.基金经理在报告期内未发生变更。

13.基金经理在报告期内未发生变更。

14.基金经理在报告期内未发生变更。

15.基金经理在报告期内未发生变更。

16.基金经理在报告期内未发生变更。

17.基金经理在报告期内未发生变更。

18.基金经理在报告期内未发生变更。

19.基金经理在报告期内未发生变更。

20.基金经理在报告期内未发生变更。

21.基金经理在报告期内未发生变更。