

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人新华基金管理有限公司
基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月二十一日

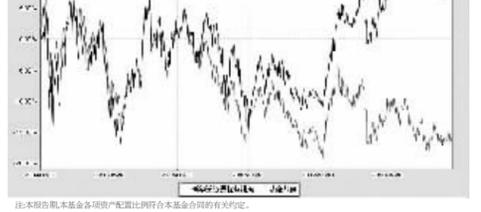
重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金资产净值变动与净值增长率不存在虚假记载,误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。
基金过往业绩并不预示其未来表现,投资者有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期内基金未发生诉讼、仲裁事项。
本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 新华泛资源优势混合 (Xinhua Broad Resource Advantage Flexible Allocation Hybrid). Rows include 基金代码 (Fund Code), 交易代码 (Trading Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Share Amount), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (2014年4月1日至2014年6月30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, 6.本期基金份额持有人数量, 7.期末基金资产净值, 8.期末基金份额净值, 9.本期基金份额持有人数量, 10.期末基金资产净值, 11.期末基金份额净值.

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净增值率(%) (Net Growth Rate %). Rows include 1.本期, 2.上期, 3.自基金合同生效以来.



4.1 基金投资组合情况

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience). Rows include 基金经理 (Fund Manager), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant).

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1.权益投资, 2.其中:股票, 3.固定收益投资, 4.其中:债券, 5.买入返售金融资产, 6.其中:买入返售金融资产, 7.其他资产, 8.合计.

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1.权益投资, 2.其中:股票, 3.固定收益投资, 4.其中:债券, 5.买入返售金融资产, 6.其中:买入返售金融资产, 7.其他资产, 8.合计.

5.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 新华优选分红混合 (Xinhua Preferred Dividend Hybrid). Rows include 基金代码 (Fund Code), 交易代码 (Trading Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Share Amount), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (2014年4月1日至2014年6月30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, 6.本期基金份额持有人数量, 7.期末基金资产净值, 8.期末基金份额净值, 9.本期基金份额持有人数量, 10.期末基金资产净值, 11.期末基金份额净值.

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净增值率(%) (Net Growth Rate %). Rows include 1.本期, 2.上期, 3.自基金合同生效以来.



4.1 基金投资组合情况

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience). Rows include 基金经理 (Fund Manager), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant).

Table with 5 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include A.农林、牧、渔业, B.采矿业, C.制造业, D.电力、热力、燃气及生产供应业, 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.房地产业, P.教育, Q.卫生和社公工作, R.文化、体育和娱乐业, S.合计.

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity (Shares)), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 000709 亨通光电, 2. 002111 威远生化, 3. 000226 鲁西化工, 4. 002211 东阿阿胶, 5. 600221 东阿阿胶, 6. 000605 渤海股份, 7. 002081 金鼎股份, 8. 600754 锦江股份, 9. 000852 广日股份, 10. 000228 中国石化.

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 国债, 2. 央行票据, 3. 金融债, 4. 其中:政策性金融债, 5. 企业债, 6. 中期票据, 7. 可转债, 8. 其他, 9. 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十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity (Shares)), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 122014 09国债04, 2. 122031 09国债03.

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
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
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
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11 投资组合报告附注

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount (Yuan)). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金份额总额, 报告期基金总申购金额, 报告期基金总赎回金额, 报告期基金净申购金额, 报告期末基金份额总额.

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 重要事项提示
8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount (Yuan)). Rows include 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金基金份额.

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人新华基金管理有限公司
基金托管人中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月二十一日

重要提示
基金管理人的董事会及董事保证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。
基金资产净值变动与净值增长率不存在虚假记载,误导性陈述或重大遗漏。
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,也不保证最低收益。
基金过往业绩并不预示其未来表现,投资者有风险,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。
本报告期内基金未发生诉讼、仲裁事项。
本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 新华钻石品质企业股票 (Xinhua Diamond Quality Enterprise Equity). Rows include 基金代码 (Fund Code), 交易代码 (Trading Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Share Amount), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (2014年4月1日至2014年6月30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, 6.本期基金份额持有人数量, 7.期末基金资产净值, 8.期末基金份额净值, 9.本期基金份额持有人数量, 10.期末基金资产净值, 11.期末基金份额净值.

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净增值率(%) (Net Growth Rate %). Rows include 1.本期, 2.上期, 3.自基金合同生效以来.



4.1 基金投资组合情况

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience). Rows include 基金经理 (Fund Manager), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant), 基金经理助理 (Fund Manager Assistant).

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1.权益投资, 2.其中:股票, 3.固定收益投资, 4.其中:债券, 5.买入返售金融资产, 6.其中:买入返售金融资产, 7.其他资产, 8.合计.

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1.权益投资, 2.其中:股票, 3.固定收益投资, 4.其中:债券, 5.买入返售金融资产, 6.其中:买入返售金融资产, 7.其他资产, 8.合计.

5.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 新华钻石品质企业股票 (Xinhua Diamond Quality Enterprise Equity). Rows include 基金代码 (Fund Code), 交易代码 (Trading Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Share Amount), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (2014年4月1日至2014年6月30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, 6.本期基金份额持有人数量, 7.期末基金资产净值, 8.期末基金份额净值, 9.本期基金份额持有人数量, 10.期末基金资产净值, 11.期末基金份额净值.

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净增值率(%) (Net Growth Rate %). Rows include 1.本期, 2.上期, 3.自基金合同生效以来.



4.1 基金投资组合情况

Table with 5 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include A.农林、牧、渔业, B.采矿业, C.制造业, D.电力、热力、燃气及生产供应业, 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.房地产业, P.教育, Q.卫生和社公工作, R.文化、体育和娱乐业, S.合计.

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity (Shares)), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 000510 贵州茅台, 2. 600007 中国国航, 3. 601166 兴业银行, 4. 600754 锦江股份, 5. 000284 中国国航, 6. 600086 中国电力, 7. 601588 华鲁恒升, 8. 002027 华兰生物, 9. 000766 上海医药, 10. 000521 上海医药.

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 国债, 2. 央行票据, 3. 金融债, 4. 其中:政策性金融债, 5. 企业债, 6. 中期票据, 7. 可转债, 8. 其他, 9. 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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity (Shares)), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 113002 华安证券, 2. 113005 平安证券, 3. 110015 长石转债, 4. 128006 石化转债.

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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount (Yuan)), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Rows include 1. 权益投资, 2. 其中:股票, 3. 固定收益投资, 4. 其中:债券, 5. 买入返售金融资产, 6. 其中:买入返售金融资产, 7. 其他资产, 8. 合计.

Table with 5 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include A.农林、牧、渔业, B.采矿业, C.制造业, D.电力、热力、燃气及生产供应业, 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.房地产业, P.教育, Q.卫生和社公工作, R.文化、体育和娱乐业, S.合计.

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity (Shares)), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 000510 贵州茅台, 2. 600754 锦江股份, 3. 002284 鲁西化工, 4. 600007 中国国航, 5. 601166 兴业银行, 6. 600086 中国电力, 7. 601588 华鲁恒升, 8. 002027 华兰生物, 9. 000766 上海医药, 10. 000521 上海医药.

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五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity (Shares)), 公允价值 (元) (Fair Value (Yuan)), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 113002 华安证券, 2. 113005 平安证券, 3. 110015 长石转债, 4. 128006 石化转债.

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明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

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贵金属投资明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

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股指期货投资明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

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国债期货交易明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.10 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.11 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国债期货交易明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.12 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.13 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.14 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国债期货交易明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.15 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.16 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.17 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国债期货交易明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.18 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.19 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.20 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国债期货交易明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.21 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.22 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.23 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国债期货交易明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). 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. 其他应收款, 6. 其他, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.24 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3.