

招商双债增强债券型证券投资基金(LOF)

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月21日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中所列数据未经审计。
本报告日期为2016年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 基金资产概况 (Fund Assets Overview) and 主要财务指标 (Key Financial Indicators). Includes data for assets, liabilities, and performance metrics.

3.1 主要财务指标

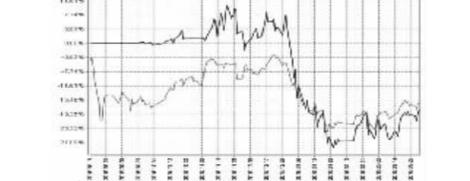
Table showing financial indicators for the period 2016年1月1日至2016年3月31日止, including net asset value and performance metrics.

注:1.上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 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
本基金本报告期净值增长率为-1.09%,同期业绩比较基准收益率为-0.86%。

注:业绩比较基准收益率=60%×中证综合指数收益率+40%×天相可转债指数收益率,业绩比较基准在每个交易日实时变动。

3.3 本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
图例:招商双债增强债券型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较



注:根据基金合同约定,本基金投资于可转债的投资比例不低于基金资产的70%,本基金投资于可转债不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金于2013年3月1日成立,自基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期结束时相关比例均符合上述规定的要求。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职本基金基金经理的起止日期 (Term), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks).

注:1.本基金历任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,前任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司决议作出决定的公告(生效)日期;
2.证券从业年限指从事行业执业(证券业从业人员资格管理办法)中关于证券从业人员的有关规定。

4.2 报告期内基金投资运作及运作的说明
基金管理人声明:在本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《招商双债增强债券型证券投资基金(LOF)基金合同》等基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资运作符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人(以下简称“公司”)已建立完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有投资组合的备选库,制定明确的备选库建立、维护程序,公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体的职责和授权划分,严格控制投资组合的权限,在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序,公司的相关研究成果向所有投资组合开放,在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易,确保投资组合的投资策略和流动性等需要而发生的同日反向交易,公司要求相关投资组合经理提供决策依据,并留存记录备查,完全按照有关指数或比例进行投资的操作等除外。
本报告期内,本基金各投资组合严格按照相关法律法规、基金合同和有关投资、交易公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在或不存在成批的单一交易员超过该证券当日成交量的5%的情形,报告期内未发现有导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
宏观与资产配置:
2016年一季度经济持续下行趋势,房地产市场销售继续回暖,但销售到投资的传导不畅或制约后期经济空间,投资领域房地产行业、基建、制造业投资增速均继续放缓,经济下行压力仍然较大,3月份PMI数据回升,50,经济呈现短期复苏迹象,但房地产销售依然疲软,一二线城市房地产市场投资主要以一二线城市为主,三四线城市销售依然疲软,由于一二线城市新增供给有限,房地产行业投资继续放缓从销售到投资的传导不畅,三四线城市仍以去库存为基调,后期能否持续提振经济仍有待观察。
CPI年初以来持续上行,PMI仍保持在通缩区间,但同比降幅有所收窄,受生猪存栏量持续回升影响,猪肉价格近期以来持续上涨,接近历史高点,另外,PMI回落受钢铁等大宗商品价格回落反弹影响,通胀水平有所收窄。
一季度以来货币财政政策整体以中性为主。公开市场操作方面,3月份基金回笼了年初以来的投放规模;3月初央行降准0.5个百分点,用于支持资金面的流动性而非实质宽松。

5.1 报告期内基金资产组合情况
5.1.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.1.3 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
5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.1.5 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 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Lists the top 10 stocks and top 5 bonds held by the fund as of the end of the reporting period.

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
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
5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.6 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.7 投资组合报告附注
5.8 其他资产构成

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 投资组合报告附注
5.10 其他资产构成

5.10.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.10.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.10.3 其他资产构成

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.10.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.10.6 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
5.10.7 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
5.10.8 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
5.10.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10.10 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
5.12 其他资产构成

5.11 投资组合报告附注
5.12 其他资产构成

5.12.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.12.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.12.3 其他资产构成

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.12.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.12.6 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
5.12.7 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
5.12.8 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
5.12.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.12.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.13 投资组合报告附注
5.14 其他资产构成

5.13 投资组合报告附注
5.14 其他资产构成

5.14.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.14.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.14.3 其他资产构成

5.14.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.14.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.14.6 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
5.14.7 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
5.14.8 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
5.14.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.14.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.15 投资组合报告附注
5.16 其他资产构成

5.15 投资组合报告附注
5.16 其他资产构成

5.16.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.16.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.16.3 其他资产构成

5.16.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.16.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.16.6 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
5.16.7 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
5.16.8 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
5.16.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.16.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.17 投资组合报告附注
5.18 其他资产构成

5.17 投资组合报告附注
5.18 其他资产构成

5.18.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.18.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.18.3 其他资产构成

5.18.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.18.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.18.6 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
5.18.7 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
5.18.8 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
5.18.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.18.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.19 投资组合报告附注
5.20 其他资产构成

5.19 投资组合报告附注
5.20 其他资产构成

5.20.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.20.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.20.3 其他资产构成

5.20.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.20.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.20.6 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
5.20.7 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
5.20.8 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
5.20.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.20.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.21 投资组合报告附注
5.22 其他资产构成

5.21 投资组合报告附注
5.22 其他资产构成

5.22.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.22.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.22.3 其他资产构成

5.22.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.22.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.22.6 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
5.22.7 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
5.22.8 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
5.22.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.22.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.23 投资组合报告附注
5.24 其他资产构成

5.23 投资组合报告附注
5.24 其他资产构成

5.24.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.24.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.24.3 其他资产构成

5.24.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.24.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.24.6 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
5.24.7 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
5.24.8 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
5.24.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.24.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.25 投资组合报告附注
5.26 其他资产构成

5.25 投资组合报告附注
5.26 其他资产构成

5.26.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.26.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.26.3 其他资产构成

5.26.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.26.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.26.6 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
5.26.7 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
5.26.8 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
5.26.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.26.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.27 投资组合报告附注
5.28 其他资产构成

5.27 投资组合报告附注
5.28 其他资产构成

5.28.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.28.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.28.3 其他资产构成

5.28.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.28.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.28.6 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
5.28.7 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
5.28.8 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
5.28.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.28.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.29 投资组合报告附注
5.30 其他资产构成

5.29 投资组合报告附注
5.30 其他资产构成

5.30.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.30.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.30.3 其他资产构成

5.30.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.30.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.30.6 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
5.30.7 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
5.30.8 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
5.30.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.30.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.31 投资组合报告附注
5.32 其他资产构成

5.31 投资组合报告附注
5.32 其他资产构成

5.32.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.32.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.32.3 其他资产构成

5.32.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.32.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.32.6 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
5.32.7 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
5.32.8 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
5.32.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.32.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.33 投资组合报告附注
5.34 其他资产构成

5.33 投资组合报告附注
5.34 其他资产构成

5.34.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.34.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.34.3 其他资产构成

5.34.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.34.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.34.6 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
5.34.7 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
5.34.8 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
5.34.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.34.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.35 投资组合报告附注
5.36 其他资产构成

5.35 投资组合报告附注
5.36 其他资产构成

5.36.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.36.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.36.3 其他资产构成

5.36.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.36.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.36.6 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
5.36.7 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
5.36.8 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
5.36.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.36.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.37 投资组合报告附注
5.38 其他资产构成

5.37 投资组合报告附注
5.38 其他资产构成

5.38.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.38.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.38.3 其他资产构成

5.38.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.38.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.38.6 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
5.38.7 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
5.38.8 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
5.38.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.38.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.39 投资组合报告附注
5.40 其他资产构成

5.39 投资组合报告附注
5.40 其他资产构成

5.40.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.40.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.40.3 其他资产构成

5.40.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.40.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.40.6 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
5.40.7 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
5.40.8 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
5.40.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.40.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.41 投资组合报告附注
5.42 其他资产构成

5.41 投资组合报告附注
5.42 其他资产构成

5.42.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.42.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.42.3 其他资产构成

5.42.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.42.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.42.6 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
5.42.7 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
5.42.8 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
5.42.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.42.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.43 投资组合报告附注
5.44 其他资产构成

5.43 投资组合报告附注
5.44 其他资产构成

5.44.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.44.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.44.3 其他资产构成

5.44.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.44.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.44.6 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
5.44.7 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
5.44.8 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
5.44.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.44.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.45 投资组合报告附注
5.46 其他资产构成

5.45 投资组合报告附注
5.46 其他资产构成

5.46.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.46.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.46.3 其他资产构成

5.46.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.46.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.46.6 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
5.46.7 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
5.46.8 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
5.46.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.46.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.47 投资组合报告附注
5.48 其他资产构成

5.47 投资组合报告附注
5.48 其他资产构成

5.48.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.48.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.48.3 其他资产构成

5.48.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.48.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.48.6 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
5.48.7 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
5.48.8 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
5.48.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.48.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.49 投资组合报告附注
5.50 其他资产构成

5.49 投资组合报告附注
5.50 其他资产构成

5.50.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.50.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.50.3 其他资产构成

5.50.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.50.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.50.6 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
5.50.7 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
5.50.8 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
5.50.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.50.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.51 投资组合报告附注
5.52 其他资产构成

5.51 投资组合报告附注
5.52 其他资产构成

5.52.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.52.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.52.3 其他资产构成

5.52.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.52.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.52.6 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
5.52.7 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
5.52.8 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
5.52.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.52.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.53 投资组合报告附注
5.54 其他资产构成

5.53 投资组合报告附注
5.54 其他资产构成

5.54.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.54.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.54.3 其他资产构成

5.54.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.54.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.54.6 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
5.54.7 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
5.54.8 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
5.54.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.54.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.55 投资组合报告附注
5.56 其他资产构成

5.55 投资组合报告附注
5.56 其他资产构成

5.56.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.56.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.56.3 其他资产构成

5.56.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.56.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.56.6 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
5.56.7 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
5.56.8 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
5.56.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.56.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.57 投资组合报告附注
5.58 其他资产构成

5.57 投资组合报告附注
5.58 其他资产构成

5.58.1 报告期内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,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.58.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
5.58.3 其他资产构成

5.58.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.58.5 报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入损益的金融资产

5.58.6 报告期末按公允价值占