长盛添利宝货币市场基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛添利宝货币	
基金主代码	000424	
交易代码	000424	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月9日	
报告期末基金份额总额	10,089,434,795.18份	
投资目标	以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金在短期市场利率预期策略的基础上,综合运用期限结构的滚动配置策略,投资组合优化策略和无风险套利操作策略,通过比较各类短期固定收益工具如央行票据、债券、短期融资券、银行存款、债券回购等投资品种在流动性、收益率水平和风险参数等指标的差异,确定这些投资品种的合理配置比例,以保证投资组合在低风险的前提下尽可能提高组合收益率。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
下属分级基金的交易代码	000424	000425
报告期末下属分级基金的份额总额	184,129,569.29份	9,905,305,225.89份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)	
	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
1. 本期已实现收益	1,640,148.95	46,845,868.71
2.本期利润	1,640,148.95	46,845,868.71
3.期末基金资产净值	184,129,569.29	9,905,305,225.89

注:1.所列数据截止到2016年3月31日。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛添利宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.5786%	0.0039%	0.3366%	0.0000%	0.2420%	0.0039%

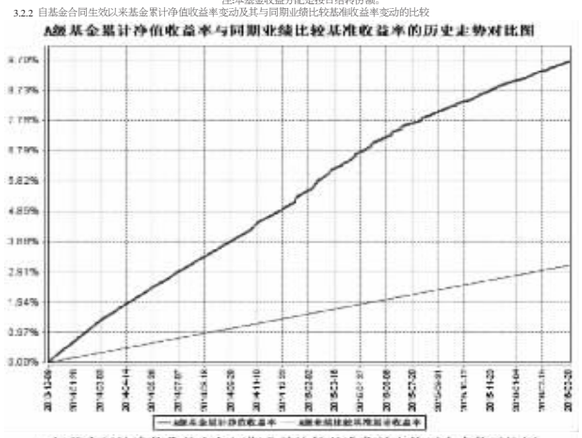
注:本基金收益分配是按日结转份额。

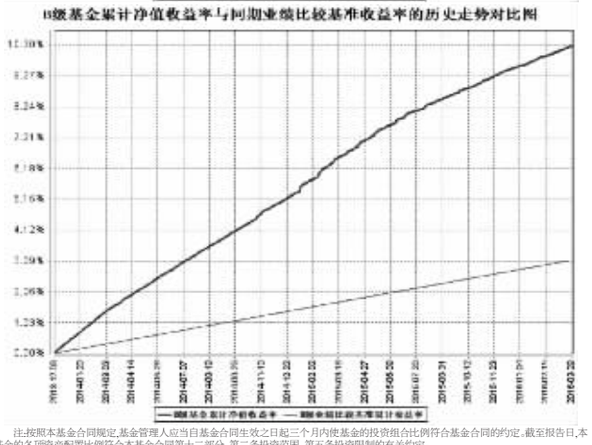
长盛添利宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.6397%	0.0039%	0.3366%	0.0000%	0.3031%	0.0039%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

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:按照本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二部分、第二条投资范围、第五条投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张帆	本基金基金经理、长盛纯债债券型证券投资基金基金经理、长盛同丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同裕信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金经理。	2013年12月9日	-	9年	男,1983年1月出生,中国国籍,华中科技大学硕士,曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作,2012年4月加入长盛基金管理有限公司,曾任职信用研究员、长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。现任长盛纯债债券型证券投资基金基金经理、长盛添利宝货币市场基金(本基金)基金经理、长盛同裕信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金经理。

注:1.上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"任券从业年限"中"任券从业"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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、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基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有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

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合合规公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1.报告期内行情回顾

2016年一季度,受基建和房地产投资增速回升等因素影响,国内经济有所改善,但持续性仍需观察;通胀方面,食品价格上涨推动通胀温和回升,大宗商品价格反弹带动PPI跌幅收窄。货币政策方面,央行运用多种工具保持适度流动性,并于3月1日起下调了存款准备金率,资金面总体呈现相对宽松的局面。债市呈现震荡调整走势,利率债方面,政策效益率曲线陡峭化,中短端利率下行,而长端利率上行,期限利差有所扩大;信用债方面,收益率曲线整体下行,中高评级债券信用利差均处于历史低位,而低评级债券信用利差仍较高,主要是受债市信用风险加速暴露影响所致。

货币市场方面,受央行运用多种流动性调节工具释放流动性及降准等宽松货币政策影响,市场流动性整体保持相对宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率维持在较低水平。

2.报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制资产配置节奏,优化持仓结构,保持组合流动性,合理调整协存和债券配置比例,努力提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年1季度,本基金A级净值收益率为0.5786%,B级净值收益率为0.6397%,同期业绩比较基准收益率0.3366%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,408,503,880.10	53.59
	其中:债券	5,408,503,880.10	53.59
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,011,322,586.98	10.02
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,566,667,670.51	35.34
4	其他资产	106,136,932.87	1.05
5	合计	10,092,631,070.46	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		1.80
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	49.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	10.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	3.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.98	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	589,998,095.18	5.85
	其中:政策性金融债	589,998,095.18	5.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,062,376,544.45	20.44
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,756,129,240.47	27.32
8	其他	-	-
9	合计	5,408,503,880.10	53.61
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150419	15农发19	1,600,000	160,190,001.41	1.59
2	011509007	15国电集SCP007	1,500,000	150,217,994.19	1.49
3	150311	15进出11	1,300,000	130,034,222.22	1.29
4	041554026	15国电集CP002	1,200,000	120,316,790.19	1.19
5	011599945	15中油股SCP006	1,200,000	120,123,865.38	1.19
6	160201	16国开01	1,200,000	119,711,409.08	1.19
7	041555013	15庆延油CP001	1,000,000	100,548,341.34	1.00
8	011513003	15招商局SCP003	1,000,000	100,300,874.05	0.99
9	011561005	15五矿贸SCP005	1,000,000	100,242,261.54	0.99
10	111620008	16广发银行CD008	1,000,000	99,984,563.40	0.99

5.6 影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1255%
报告期内偏离度的最低值	0.0370%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0897%

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2

本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4 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	46,504,370.92
4	应收申购款	59,632,561.95
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	106,136,932.87

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
报告期期初基金份额总额	882,998,915.00	14,389,928,673.61
报告期期间基金总申购份额	354,765,954.31	11,874,576,656.07
报告期期间基金总赎回份额	1,053,635,300.02	16,359,200,103.79
报告期期末基金份额总额	184,129,569.29	9,905,305,225.89

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2016年3月8日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
合计			40,000,000.00	40,000,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛添利宝货币市场基金合同》;

3、《长盛添利宝货币市场基金托管协议》;

4、《长盛添利宝货币市场基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666.010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2016年4月22日

长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 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2016年4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同庆中证800指数(LOF)
场内简称	长盛同庆
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月22日
报告期末基金份额总额	175,862,097.08份
投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律的束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中证800指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性。 性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×中证800指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金,具有高风险、高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-624,245.82
2.本期利润	-38,473,189.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2158
4.期末基金资产净值	211,617,210.14
5.期末基金份额净值	1.203

注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额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.所列数据截止到2016年3月31日。

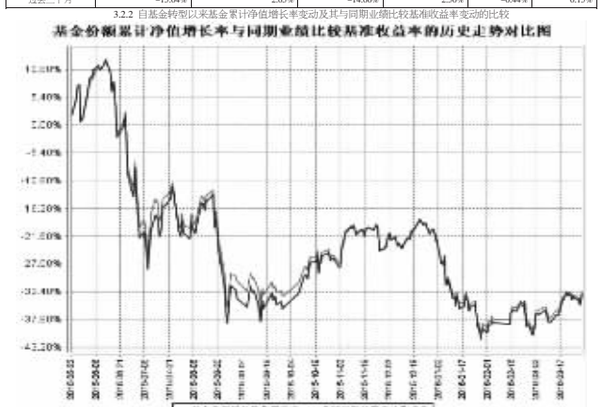
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额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
过去三个月	-15.04%	2.65%	-14.60%	2.50%	-0.44%	0.15%

3.2.2 自基金转型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



注:1.本基金由长盛同庆中证800指数分级证券投资基金转型而来,基金转型日(即基金合同生效日)为2015年5月22日,截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按照本基金合同规定,本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定,建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定,截止本报告期末本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理、长盛同福中证200指数分级证券投资基金基金经理、长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理、长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同益创业板指数型证券投资基金基金经理。	2015年5月22日	-	9年	男,1981年9月出生,中国国籍,中央财经大学硕士,金融风险管理师(FRM),2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员、从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同辉中证200指数分级证券投资基金基金经理、长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同庆中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理、长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理。

注:1.上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"任券从业年限"中"任券从业"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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、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基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有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

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1.报告期内行情回顾

2016年开年伊始,股票市场出现快速大幅下跌,其中以高估值成长板块跌幅巨大;2-3月大盘止跌企稳,呈现区间震荡格局,各板块股票依次弱反弹,反弹热点多元化,但持续性均较为有限。年初股市大幅下跌,主要原因是市场预期悲观,包括去产能导致经济破着陆的预期、美元加息人民币持续贬值导致资本大幅外流的预期、注册制战略新兴板导致股票供给大幅增加的预期。随着政府的努力和政策的修正,这些悲观预期被逐个证伪,市场风险偏好有所回升,叠动大盘出现震荡反弹行情。

2.报告期内本基金投资策略分析

投资策略上,管理人对本次股市的大幅下跌有充分的预期,并且在组合管理上进行有效的防御性操作,最大限度的控制了基金净值的回撤幅度,取得比较显著的超额收益。在股市企稳反弹阶段,稳步进行组合调整,适度增强组合的弹性和进攻性。同时根据近期股市热点轮动转换比较快、持续性有限的特点,进行轮动波段操作,取得一定的成效。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.3962元,本报告期份额净值增长率为-9.91%,同期业绩比较基准增长率为-10.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	197,670,840.36	92.70
	其中:股票	197,670,840.36	92.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	63,621.60	0.03
	其中:债券	63,621.60	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,484,081.33	7.26
8	其他资产	20,168.80	0.01
9	合计	213,238,712.09	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,297,768.83	0.61
B	采矿业	7,217,266.09	3.41
C	制造业	78,609,473.55	37.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,085,718.87	3.35
E	建筑业	6,480,200.88	3.06
F	批发和零售业	7,181,428.81	3.39
G	交通运输、仓储和邮政业	6,965,690.07	3.29
H	住宿和餐饮业	132,725.62	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,321,158.60	5.35
J	金融业	49,659,522.04	23.47
K	房地产业	10,999,730.60	5.20
L	租赁和商务服务业	2,254,728.80	1.07
M	科学研究和技术服务业	259,200.32	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,563,245.44	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	345,596.28	0.16
R	文化、体育和娱乐业	2,980,369.72	1.41
S	综合	1,502,336.14	0.71
	合计	195,856,160.66	92.55

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,032.30	0.00
B	采掘业	183.54	0.00
C	制造业	916,552.54	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	551.98	0.00
F	批发和零售业	183,933.27	0.09
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	710,787.73	0.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	254.19	0.00
L	租赁和商务服务业	1,384.15	0.00
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	1,814,679.70	0.86

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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

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	601318	中国平安	172,935	5,501,062.35	2.60
2	600016	民生银行	467,900	4,262,569.00	2.01
3	600036	招商银行	263,130	4,233,761.70	2.00
4	600000	浦发银行	177,333	3,179,580.69	1.50
5	000002	万 科A	154,726	2,910,396.06	1.38
6	601166	兴业银行	181,670	2,821,335.10	1.33
7	601398	工商银行	576,333	2,472,468.57	1.17
8	600030	中信证券	125,434	2,232,725.20	1.06
9	600519	贵州茅台	8,191	2,028,419.24	0.96
10	600837	海通证券	128,843	1,841,166.47	0.87

5.3.2 报告期末积极投资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

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	000839	中信国安	39,926	709,884.28	0.34
2	002018	华信国际	20,800	515,840.00	0.24
3	600110	诺德股份	36,885	246,760.65	0.12
4	002091	江苏国泰	8,653	183,184.01	0.09
5	002240	威华股份	6,478	69,897.62	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	63,621.60	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,621.60	0.03

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

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(%)
1	110031	航信转债	490	63,621.60	0.03

注:本基金本报告期末仅持有上述1只债券。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

1