

(上接B21版)
(89)上海石财富基金销售有限公司
 注册地址:上海市黄浦区西藏中路765号402-115室
 办公地址:上海市黄浦区延安路401号凯石大厦4楼
 法定代表人:李俊峰
 电话:021-63331191
 传真:021-63328323
 客户服务热线:400-178-1000
 网站:www.lifund.com
基金管理人(简称“管理人”)和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。
二、登记机构
名称:鹏华基金管理有限公司
 住所:深圳市福田区中心区三路1号鹏华证劵广场第一座21层
 办公地址:深圳市福田区中心区3号鹏华证劵广场第一座21层
 法定代表人:张峰
 电话:0755-82370888-1668
 传真:0755-22381325
 联系人:李娜
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市锦天城律师事务所
 住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 法定代表人:王尧
 电话:021-31886666
 传真:021-31886600
经办律师:黎明、瞿明
 联系人:李娜
名称:北京中伦律师事务所(特殊普通合伙)
 住所:北京市西城区金融大街19号东方广场天辰大厦11层10-12室
 办公地址:北京市西城区金融大街19号东方广场天辰大厦11层10-12室
 执行事务合伙人:吴玉平
 电话:(010)58133000
 传真:(010)58128298
 经办律师:曹宇、吕华、陈立群
名称:上海国浩律师(集团)有限公司
 住所:上海市浦东新区世纪大道1502号3层
 电话:021-31886666
四、基金的投资
本基金的投资范围:股票型证券投资基金。
五、基金的投资策略
资产配置策略
 在严格控制投资组合风险的前提下,通过行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入的研究,选择性地优先配置,或战略性配置,或战术配置,寻求基金资产的长期增值增值,力争取得超越比较基准的绝对回报。
股票投资策略
 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票、沪港股票市场互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券)、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的品种。在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与科创板上市股票的投资。
固定收益投资策略
 本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置,在严格控制风险的前提下,选择性地配置于具有良好流动性的固定收益类资产,包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的品种。
衍生品投资策略
 本基金将基于套期保值或风险对冲的目的,适度参与股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品的投资。本基金管理人将根据法律法规的规定,选择适当的衍生品品种,制定适当的衍生品投资策略,并将衍生品投资作为辅助性投资手段,以对冲市场风险,提高投资组合的流动性。
六、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。
 沪深300指数是中证指数公司编制的包含沪深两市全部300只流动性好、规模最大的A股为样本的成份股指数,是市场上最具代表性的指数之一,能够反映沪深两市股票市场的整体走势,是评价本基金股票投资业绩的重要基准。恒生指数是由香港恒生指数有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股票市场整体走势的权威指标。
 中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券品种,中证全债指数每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券组合,为债券投资者提供定价参考和投资业绩比较基准。
 如上上述业绩比较基准中计算指数或更名,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致的前提下,按照一定的程序变更业绩比较基准并及时公告,但变更业绩比较基准不影响本基金的历史业绩。
七、基金的风险收益特征
 本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,本基金投资港股通标的股票,需承担汇率及境外市场的风险。
八、基金投资组合报告(未经审计)
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	4,749,932,195.08	88.34
2	基金投资	4,749,932,195.08	88.34
3	固定收益投资	329,707,998.44	6.13
4	其中:债券	329,707,998.44	6.13
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	166,810,283.41	3.10
8	其中:买断式回购买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	5,377,651,402.92	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,017,273,723.93	37.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	169,032,468.52	3.17
E	建筑业	63,865,748.76	1.20
F	交通运输业	198,110,935.14	3.71
G	信息技术业	587,994,688.48	11.02
H	房地产业	-	-
I	金融业	-	-
J	医药生物	90,838,736.80	1.70
K	零售业	20,313,208.79	0.38
L	公用事业	-	-
M	科学研究和技术服务业	199,428,099.88	3.74
N	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
O	教育业	-	-
P	金融业	75,098,587.50	1.41
Q	房地产业	102,915,173.90	1.93
R	综合	-	-
S	合计	3,778,860,318.70	70.71

3.报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
基础行业	23,368,062.96	0.44
通讯	211,331,037.78	3.96
消费品,周期性	564,919,929.02	10.59
消费品,非周期性	-	-
综合投资	-	-
金融	19,228,177.19	0.36
工业	77,972,953.33	1.46
公用事业	-	-
高科技	79,233,717.50	1.48
其他	976,071,876.38	18.29

注:以上行业分类采用彭博行业分类标准。
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	002174	华帝股份	2,117,735	248,579,734.30	4.66
2	002415	海康威视	6,748,412	209,095,577.84	3.92
3	0700	腾讯控股	1,582,440	204,498,308.32	3.81
4	600049	上海机场	6,858,946	198,110,935.14	3.71
5	300087	银信股份	7,048,782	188,353,123.28	3.47
6	600276	恒顺醋业	3,161,294	173,891,036.16	3.26
7	300017	网宿科技	2,156,440	170,185,712.40	3.17
8	600900	青岛啤酒	1,576,859	169,032,468.52	3.17
9	000077	浪潮信息	6,589,207	168,670,342.53	3.16
10	000017	长和	2,090,000	167,816,530.00	3.14

影响。同时,基金管理人将密切注意流动性对标的证券收益的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等策略,在严格控制风险的前提下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益的品种进行投资,以期获得超额收益。
E.衍生品投资策略
 本基金将根据对权证、股指期货等金融衍生品的分析和价值评估,结合对宏观经济、股市场政策、市场趋势的综合分析,寻找下一阶段的市场机会,力争取得超越业绩比较基准的投资回报。衍生品投资将严格遵守中国证监会及《基金合同》的相关规定,力求通过套利交易等手段,在有效控制风险的前提下,选择风险调整后收益的品种进行投资,以期获得超额收益。
F.其他投资策略
 本基金将基于套期保值或风险对冲的目的,适度参与股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品的投资。本基金管理人将根据法律法规的规定,选择适当的衍生品品种,制定适当的衍生品投资策略,并将衍生品投资作为辅助性投资手段,以对冲市场风险,提高投资组合的流动性。
(四) 报告期末投资组合
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
1. 报告期末本基金投资股指期货持仓情况
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
(五) 报告期末基金资产组合
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
1. 报告期末本基金投资股指期货持仓情况
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
九、基金的业绩比较基准
 沪深300指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数×10%。
 沪深300指数是中证指数公司编制的包含沪深两市全部300只流动性好、规模最大的A股为样本的成份股指数,是市场上最具代表性的指数之一,能够反映沪深两市股票市场的整体走势,是评价本基金股票投资业绩的重要基准。恒生指数是由香港恒生指数有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股票市场整体走势的权威指标。
 中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券品种,中证全债指数每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券组合,为债券投资者提供定价参考和投资业绩比较基准。
 如上上述业绩比较基准中计算指数或更名,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致的前提下,按照一定的程序变更业绩比较基准并及时公告,但变更业绩比较基准不影响本基金的历史业绩。
十、基金的风险收益特征
 本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,本基金投资港股通标的股票,需承担汇率及境外市场的风险。
十一、基金投资组合报告(未经审计)
1. 报告期末基金资产组合情况
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
九、基金的投资
资产配置策略
 在严格控制投资组合风险的前提下,通过行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入的研究,选择性地优先配置,或战略性配置,或战术配置,寻求基金资产的长期增值增值,力争取得超越比较基准的绝对回报。
股票投资策略
 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票、沪港股票市场互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券)、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的品种。在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与科创板上市股票的投资。
固定收益投资策略
 本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置,在严格控制风险的前提下,选择性地配置于具有良好流动性的固定收益类资产,包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的品种。
衍生品投资策略
 本基金将基于套期保值或风险对冲的目的,适度参与股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品的投资。本基金管理人将根据法律法规的规定,选择适当的衍生品品种,制定适当的衍生品投资策略,并将衍生品投资作为辅助性投资手段,以对冲市场风险,提高投资组合的流动性。
六、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。
 沪深300指数是中证指数公司编制的包含沪深两市全部300只流动性好、规模最大的A股为样本的成份股指数,是市场上最具代表性的指数之一,能够反映沪深两市股票市场的整体走势,是评价本基金股票投资业绩的重要基准。恒生指数是由香港恒生指数有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股票市场整体走势的权威指标。
 中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券品种,中证全债指数每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券组合,为债券投资者提供定价参考和投资业绩比较基准。
 如上上述业绩比较基准中计算指数或更名,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致的前提下,按照一定的程序变更业绩比较基准并及时公告,但变更业绩比较基准不影响本基金的历史业绩。
七、基金的风险收益特征
 本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,本基金投资港股通标的股票,需承担汇率及境外市场的风险。
八、基金投资组合报告(未经审计)
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	4,749,932,195.08	88.34
2	基金投资	4,749,932,195.08	88.34
3	固定收益投资	329,707,998.44	6.13
4	其中:债券	329,707,998.44	6.13
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	166,810,283.41	3.10
8	其中:买断式回购买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	5,377,651,402.92	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,017,273,723.93	37.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	169,032,468.52	3.17
E	建筑业	63,865,748.76	1.20
F	交通运输业	198,110,935.14	3.71
G	信息技术业	587,994,688.48	11.02
H	房地产业	-	-
I	金融业	-	-
J	医药生物	90,838,736.80	1.70
K	零售业	20,313,208.79	0.38
L	公用事业	-	-
M	科学研究和技术服务业	199,428,099.88	3.74
N	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
O	教育业	-	-
P	金融业	75,098,587.50	1.41
Q	房地产业	102,915,173.90	1.93
R	综合	-	-
S	合计	3,778,860,318.70	70.71

3. 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
基础行业	23,368,062.96	0.44
通讯	211,331,037.78	3.96
消费品,周期性	564,919,929.02	10.59
消费品,非周期性	-	-
综合投资	-	-
金融	19,228,177.19	0.36
工业	77,972,953.33	1.46
公用事业	-	-
高科技	79,233,717.50	1.48
其他	976,071,876.38	18.29

注:以上行业分类采用彭博行业分类标准。
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	002174	华帝股份	2,117,735	248,579,734.30	4.66
2	002415	海康威视	6,748,412	209,095,577.84	3.92
3	0700	腾讯控股	1,582,440	204,498,308.32	3.81
4	600049	上海机场	6,858,946	198,110,935.14	3.71
5	300087	银信股份	7,048,782	188,353,123.28	3.47
6	600276	恒顺醋业	3,161,294	173,891,036.16	3.26
7	300017	网宿科技	2,156,440	170,185,712.40	3.17
8	600900	青岛啤酒	1,576,859	169,032,468.52	3.17
9	000077	浪潮信息	6,589,207	168,670,342.53	3.16
10	000017	长和	2,090,000	167,816,530.00	3.14

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,213,000.00	6.00
4	其中:政策性金融债	320,213,000.00	6.00
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债券(可分离债)	9,494,998.44	0.18
8	其他债券	-	-
9	资产支持证券	-	-
10	合计	329,707,998.44	6.18

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	150215	15国开15	1,300,000	130,065,000.00	2.44
2	150416	15农发16	800,000	80,080,000.00	1.50
3	150211	15国开11	790,000	79,056,000.00	1.31
4	150413	15农发13	400,000	40,112,000.00	0.75
5	123001	蓝桥转债	83,708	9,494,998.44	0.18

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五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。
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。
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。
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 本基金本报告期末未持有股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.3 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.4 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.5 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.6 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.7 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.8 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.9 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.10 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.11 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.12 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.13 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.14 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.15 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
9.16 股指期货投资情况说明
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
十、基金的业绩比较基准
 沪深300指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数×10%。
 沪深300指数是中证指数公司编制的包含沪深两市全部300只流动性好、规模最大的A股为样本的成份股指数,是市场上最具代表性的指数之一,能够反映沪深两市股票市场的整体走势,是评价本基金股票投资业绩的重要基准。恒生指数是由香港恒生指数有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股票市场整体走势的权威指标。
 中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券品种,中证全债指数每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券组合,为债券投资者提供定价参考和投资业绩比较基准。
 如上上述业绩比较基准中计算指数或更名,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致的前提下,按照一定的程序变更业绩比较基准并及时公告,但变更业绩比较基准不影响本基金的历史业绩。
十一、基金的风险收益特征
 本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,本基金投资港股通标的股票,需承担汇率及境外市场的风险。
十二、基金投资组合报告(未经审计)
1. 报告期末基金资产组合情况
 本基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股指期货投资组合的仓位,选择不同的股指期货合约进行套期保值,力争实现对发行人进行充分市场对冲和风险控制。
九、基金的投资
资产配置策略
 在严格控制投资组合风险的前提下,通过行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入的研究,选择性地优先配置,或战略性配置,或战术配置,寻求基金资产的长期增值增值,力争取得超越比较基准的绝对回报。
股票投资策略
 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票、沪港股票市场互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券)、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的品种。在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与科创板上市股票的投资。
固定收益投资策略
 本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置,在严格控制风险的前提下,选择性地配置于具有良好流动性的固定收益类资产,包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的品种。
衍生品投资策略
 本基金将基于套期保值或风险对冲的目的,适度参与股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品的投资。本基金管理人将根据法律法规的规定,选择适当的衍生品品种,制定适当的衍生品投资策略,并将衍生品投资作为辅助性投资手段,以对冲市场风险,提高投资组合的流动性。
六、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。
 沪深300指数是中证指数公司编制的包含沪深两市全部300只流动性好、规模最大的A股为样本的成份股指数,是市场上最具代表性的指数之一,能够反映沪深两市股票市场的整体走势,是评价本基金股票投资业绩的重要基准。恒生指数是由香港恒生指数有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股票市场整体走势的权威指标。
 中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券品种,中证全债指数每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券组合,为债券投资者提供定价参考和投资业绩比较基准。
 如上上述业绩比较基准中计算指数或更名,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,