

(上接B38版)

(2)灵活调整组合久期
管理人将在合理预期市场利率水平的基础上,在不同的市场环境下灵活调整组合的目标久期。当预期市场利率上升时,通过增加持有短期债券等方式降低组合久期,以降低组合价格风险;在预期市场利率下降时,通过增持长期债券等方式提高组合久期,以充分分享债券价格上涨的收益。

(3)科学配置投资品种
管理人将通过研究宏观经济运行状况、货币市场和资本市场资金供求关系,以及不同时期市场投资热点,分析国债、央票、金融债等不同债券种类的利率水平,评定不同债券品种的相对投资价值,确定组合资产在不同债券品种间的配置比例。

(4)谨慎选择持仓
在具体品种的选择上,管理人主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析,对收益率曲线形态变化的预期,信用评估和流动性分析等方式,合理选择不同券种的固定收益类产品,筛选出的品种一般具有流动性较好、符合目标久期、同等条件下信用质量较好或预期信用质量得到改善、风险水平合理、有较好下行保护等特点。

4.风险控制策略
本基金将从权证标的证券基本面,权证定价合理性,权证隐含波动率等多个角度对拟投资标的权证进行分析,以有利于资产增值为原则,加强风险控制,谨慎参与投资。

5.股指期货投资策略
本基金股指期货投资中将通过对证券市场中期和短期市场运行趋势的研究,采用定性分析、交易策略的整合应用,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,主要通过套期保值和有效管理实现预期目标:(1)避险,在市场大幅波动时,减小本基金投资组合市场上跌而遭受的市场风险;(2)有效管理,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整,提高投资组合运作效率。

7.3. 业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中国国债企业债收益率*45%+中证全债收益率*35%+沪深300指数收益率*20%。本基金管理人认为,该业绩比较基准能够较好地反映本基金的投资目标。本基金管理人认为,该业绩比较基准能够较好地反映本基金的投资目标。本基金管理人认为,该业绩比较基准能够较好地反映本基金的投资目标。

11. 投资组合报告
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,复制了本招募说明书中的财务指标,净值表现和投资组合报告内容。

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	93,902,262.30	88.46
	其中:股票	93,902,262.30	88.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
	其中:国债期货	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购	-	-
8	银行存款和拆借资金合计	7,521,807.09	7.09
9	其他资产	4,722,418.70	4.45
9	合计	106,146,587.56	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	4,727,515.00	4.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,499,097.80	63.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,882,881.00	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	-	-
J	金融业	13,540,401.00	13.19
K	房地产业	-	-
L	医药和生物服务业	-	-
M	科学技术和信息技术业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	5,722,987.50	5.58
O	国防军工	-	-
P	其他	-	-
Q	合计	93,902,262.30	91.48

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末持有沪港通股票投资组合

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	000858	五粮液	190,501	8,191,543.00	7.96
2	600519	贵州茅台	21,000	8,040,118.00	7.80
3	600779	开开食品	327,100	6,040,118.00	5.87
4	000678	山东墨龙	181,800	7,670,142.00	7.43
5	600436	华拜尔	124,000	6,235,960.00	6.07
6	600903	爱建集团	100,320	5,722,987.50	5.58
7	603889	汇川技术	137,200	4,808,484.00	4.68
8	000423	泰山钢铁	71,500	4,169,840.00	4.02
9	600678	东方电子	82,500	4,100,587.00	3.97
10	600036	招商银行	284,600	3,922,182.00	3.82

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债券投资明细
本基金本报告期末持有债券

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债券投资明细
本基金本报告期末持有债券

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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有债券

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贵金属投资明细
本基金本报告期末持有债券

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股指期货投资明细
本基金本报告期末持有债券

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
本基金本报告期末持有债券

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1) 本期股指期货投资概况
(2) 本基金股指期货投资的交易策略
(3) 本期股指期货投资的持仓情况

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1) 本期国债期货投资概况
(2) 本基金国债期货投资的交易策略
(3) 本期国债期货投资的持仓情况

11. 投资组合报告附注
(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

12. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

13. 报告期内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。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

14. 报告期内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。

15. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

16. 报告期内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。

17. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

18. 报告期内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。

19. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

20. 报告期内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。

21. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

22. 报告期内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。

23. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	4,727,515.00	4.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,499,097.80	63.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,882,881.00	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	-	-
J	金融业	13,540,401.00	13.19
K	房地产业	-	-
L	医药和生物服务业	-	-
M	科学技术和信息技术业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	5,722,987.50	5.58
O	国防军工	-	-
P	其他	-	-
Q	合计	93,902,262.30	91.48

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	000858	五粮液	190,501	8,191,543.00	7.96
2	600519	贵州茅台	21,000	8,040,118.00	7.80
3	600779	开开食品	327,100	6,040,118.00	5.87
4	000678	山东墨龙	181,800	7,670,142.00	7.43
5	600436	华拜尔	124,000	6,235,960.00	6.07
6	600903	爱建集团	100,320	5,722,987.50	5.58
7	603889	汇川技术	137,200	4,808,484.00	4.68
8	000423	泰山钢铁	71,500	4,169,840.00	4.02
9	600678	东方电子	82,500	4,100,587.00	3.97
10	600036	招商银行	284,600	3,922,182.00	3.82

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债券投资明细
本基金本报告期末持有债券

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
本基金本报告期末持有债券

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
本基金本报告期末持有债券

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
本基金本报告期末持有债券

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股指期货投资明细
本基金本报告期末持有债券

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
本基金本报告期末持有债券

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1) 本期股指期货投资概况
(2) 本基金股指期货投资的交易策略
(3) 本期股指期货投资的持仓情况

11. 投资组合报告附注
(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

12. 报告期内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。

13. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

14. 报告期内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。

15. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

16. 报告期内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。

17. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

18. 报告期内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。

19. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

20. 报告期内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。

21. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

22. 报告期内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。

23. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

24. 报告期内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。

25. 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(1) 报告期内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。

(2) 本基金股指期货投资的交易策略
本基金本报告期末未持有股指期货。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

(4) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(5) 报告期内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。

(6) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(7) 报告期内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。

(8) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(9) 报告期内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。

(10) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 报告期内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。

(12) 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定)第十条对并仔采取出具警示函的监督管理措施。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

(3) 其他情况说明

序号	名称	金额(元)
1	银行存款	114,914.12
2	应收证券清算款	1,477,428.66
3	应收利息	-
4	应收股利	2,596.69
5	应收申购款	3,127,478.70
6	预收账款	-
7	其他	-
9	合计	4,722,418.17

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩
本基金管理人恪守诚信、诚实信用,勤勉尽责的贯彻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。基金的投资业绩并不表示其未来表现,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金业绩截至2017年3月31日。

(一) 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	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	基金份额净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-③
2016年7月31日-2016年12月31日	3.53%	0.54%	7.0%	0.62%	-4.07%
2016年7月31日-2017年3月31日	3.87%	0.60%	4.06%	0.43%	-0.16%
基金成立至今	7.57%	0.56%	11.97%	0.57%	-0.60%

(二) 本基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

1. 本基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

2. 本基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较