



(上接B42版)

二、注册登记机构
名称:国泰基金管理有限公司
住所:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼
办公地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层
法定代表人:陈勇胜
联系人:平培
传真:021-31081800
客户服务专线:400-888-8688,021-31089000
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路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
负责人:俞峰
联系电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:李一
经办注册会计师:许琪玮、李一

第四部分 基金名称

第五部分 基金的类型和存续期限

1.基金类型:债券型证券投资基金
2.基金运作方式:契约型开放式
3.基金的存续期限:不定期

第六部分 投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

第七部分 投资范围

本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、可转债、企业债、地方政府债、次级债、分离交易可转债、政府支持债券、中小企业私募债券、可转换债券(含可分离可转债)、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,因持有可转换公司债券转股形成的股票以及因投资于分离交易可转债而产生的权证,本基金应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;保持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。

第八部分 投资策略

本基金将根据对经济周期和市场环境的把握,基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪,灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用债策略、可转债策略、回购交易策略等多种投资策略,构建债券投资组合,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

1.久期策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

2.利率策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

3.可转债策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

4.信用策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

5.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

6.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

7.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

8.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

9.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

10.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

11.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

12.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

13.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

14.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

15.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

16.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

17.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

18.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

19.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

20.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

21.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

22.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

23.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

24.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

25.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

26.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

27.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

28.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

29.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

30.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

31.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

32.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

33.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

债券组合收益,降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时,本基金将适当降低组合久期;当预期市场利率将下降时,则适当提高组合久期。

在确定债券组合久期的过程中,本基金将在判断市场利率变动趋势的基础上,根据债券市场收益率曲线的当前形态,通过合理假设下的情景分析和压力测试,最后确定最佳的债券组合久期。

2.收益率曲线策略
在组合久期配置确定以后,本基金将通过对收益率曲线的研究,分析和预测收益率曲线可能发生的形态变化,采用子弹型策略、哑铃型策略或梯型策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3.信用债策略
信用债策略是本基金投资信用债的核心策略。本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债市场信用利差的合理性,相对投资价值以及信用利差曲线的未来走势,确定信用债的配置。具体的投资策略包括:

(1)自上而下与自下而上的分析相结合的策略。自上而下即从宏观经济、债券市场、机构行为等角度分析,制定久期、类属配置策略,选择投资时点;自下而上即寻找相对有优势 and 评级上调概率较大的公司,制定个券选择策略;

(2)相对投资价值判断策略:根据对同类债券的相对价值判断,选择符合价值的交易时机,增持相对低估、价格将上升的债券,减持相对高估、价格将上升的债券。由于利差水平受信用债信用水平的影响,因此该策略也可扩展到新券置换、流动性和信用的置换,即在相同收益率下买入近期发行的债券或是流动性更好的债券,或在相同外部信用评级和收益率下,买入内部信用评级更高的债券。

(3)信用风险评估:信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险的信用利差。基准收益率主要受宏观经济政策环境的影响,而信用利差收益率主要受该信用债信用水平的市场信用溢价以及该信用债本身的信用变化的影响。债券发行人自身素质的变化,包括公司产权状况、法人治理结构、管理水平、经营状况、财务状况、抗风险能力等的变化将对信用级别产生影响。

本基金管理人将利用内部评级系统来对信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差等方面进行综合分析,该系统包含信用评级、定量化打分以及条款分析等多个不同层面,定性评估主要关注股权结构、股东实力、行业风险、历史违约及或有负债等;定量化打分系统主要考察企业财务实力、目前基金管理人共制定了包括煤炭、钢铁、电力、化工等24个行业定量化财务打分法,对不同发债主体的财务质量进行量化的分析评估;条款分析系统主要针对有担保的长期债券,通过分析担保条款、担保主体的长期信用水平,并结合担保的情况下对款项做出综合评估。

4.回购套利策略
回购套利策略是本基金重要的操作策略之一,把信用产品投资和回购交易结合起来,基金管理人根据信用产品的特征,在信用风险和流动性风险控制的前提下,或者通过回购融资来赚取超额收益,或者通过回购不断滚动来收取信用债收益率和资金成本。

5.中小企业私募债投资策略
本基金中小企业私募债投资主要围绕久期、流动性和信用风险三个方面展开,中期控制方面,根据宏观经济运行状况的分析和研判,灵活调整组合的久期,信用风险控制方面,对个券信用资质进行详尽的分析,对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考虑,尽可能地降低信用风险暴露,流动性控制方面,要根据中小企业私募债整体的流动性情况来调整持仓规模,在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

6.定期存款利率(税后)1+1%
如果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,或在市场上出现更合适用于本基金的业绩基准时,本基金管理人依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上予以公告,无需召开基金份额持有人大会。

7.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

8.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

9.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

10.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

11.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

12.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

13.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

14.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

15.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

16.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

17.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

18.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

19.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

20.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

21.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

22.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

23.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

24.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

25.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

26.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

27.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

28.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

29.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

30.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

31.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

32.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

33.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

34.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

35.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

36.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

37.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

38.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

39.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

40.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

41.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

42.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

43.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

44.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

45.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

46.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

47.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

48.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

49.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

50.其他策略
本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并,可以根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预期,动态调整债券投资组合。

第十部分 风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较低的品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

第十一部分 投资组合报告
本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法律责任。

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2017年7月14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。

本报告投资数据截至2017年6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

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	-	-
其中:股票	-	-	-
2	固定收益投资	4,121,163.60	89.18
其中:债券	4,121,163.60	89.18	
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入金融资产投资	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	386,314.16	8.40
8	其他资产	11,879.72	2.42
9	合计	4,629,357.48	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期末未持有股票。

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	国债券	549,398.00	12.00
2	央行票据	-	-
3	金融债	2,020,038.00	44.13
其中:政策性金融债	2,020,038.00	44.13	
4	企业债	1,351,727.60	33.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他债	-	-
9	合计	4,121,163.60	90.04

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	018002	国开1302	19,700	2,020,038.00	44.13
2	019546	16国债18	5,500	549,398.00	12.00
3	128290	11国债09	4,166	426,691.20	9.32
4	128570	14国债09	4,000	415,640.00	9.18
5	128289	11国债09	4,066	410,060.00	8.96

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.其他
本基金本报告期末未持有其他。

10.其他
本基金本报告期末未持有其他。

11.其他
本基金本报告期末未持有其他。

12.其他
本基金本报告期末未持有其他。

13.其他
本基金本报告期末未持有其他。

14.其他
本基金本报告期末未持有其他。

15.其他
本基金本报告期末未持有其他。

16.其他
本基金本报告期末未持有其他。

17.其他
本基金本报告期末未持有其他。

18.其他
本基金本报告期末未持有其他。

19.其他
本基金本报告期末未持有其他。

20.其他
本基金本报告期末未持有其他。

21.其他
本基金本报告期末未持有其他。

22.其他
本基金本报告期末未持有其他。

23.其他
本基金本报告期末未持有其他。

24.其他
本基金本报告期末未持有其他。

25.其他
本基金本报告期末未持有其他。

26.其他
本基金本报告期末未持有其他。

27.其他
本基金本报告期末未持有其他。

28.其他
本基金本报告期末未持有其他。

29.其他
本基金本报告期末未持有其他。

30.其他
本基金本报告期末未持有其他。

31.其他
本基金本报告期末未持有其他。

32.其他
本基金本报告期末未持有其他。

33.其他
本基金本报告期末未持有其他。

34.其他
本基金本报告期末未持有其他。

35.其他
本基金本报告期末未持有其他。

36.其他
本基金本报告期末未持有其他。

37.其他
本基金本报告期末未持有其他。

38.其他
本基金本报告期末未持有其他。

39.其他
本基金本报告期末未持有其他。

40.其他
本基金本报告期末未持有其他。

41.其他
本基金本报告期末未持有其他。

42.其他
本基金本报告期末未持有其他。

43.其他
本基金本报告期末未持有其他。

44.其他
本基金本报告期末未持有其他。

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
1.报告期末未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)本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型对其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

11.投资组合报告附注
根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

(1) 本报告期末本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或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。