

(上接B121版)

91	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
92	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
93	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
94	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
95	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
96	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
97	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
98	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
99	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk
100	伊方资产管理(香港)有限公司	伊方资产管理(香港)有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心404号国际大厦2902室 联系人:陈永祥 电话:(+852)25111111 电邮:info@ifaw.com.hk

(二) 登记机构
名称:前海开源基金管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区深南大道7066号万科富春东方大厦22楼
法定代表人:王兆华
联系人:任福利
电话:(0755) 83189010
传真:(0755) 83181211

(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称:广东信达律师事务所
注册地址:深圳市福田区益田路6001号平安金融大厦12楼
办公地址:中国广东省深圳市福田区益田路6001号平安金融大厦12楼
负责人:张利
经办律师:胡杨、胡云云
电话:(0755) 88265288
传真:(0755) 88265537

(四) 会计师事务所(特殊普通合伙)
名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层
法定代表人:杨利军
联系人:程雁
经办会计师:张磊、程源震
电话:(010) 58895588
传真:(010) 58891199

四、基金名称
前海开源沪深深龙头精选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型
混合型

六、基金的操作
开放式

七、基金的投资
(一) 投资目标
本基金主要投资于中国大陆A股市场 and 法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的股票, 通过跨市场资产配置, 重点投资沪深深龙头精选市场各行业中的龙头公司, 在严格控制风险的前提下, 力争获取沪深深龙头精选市场超额收益。

(二) 投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市 的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市交易) 、沪港股票市场交易互联互通机制试点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、地方政府支持债券、地方政府债、可转换债券等)、资产支持证券、债券回购、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、权证、股指期货及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为: 本基金股票投资占基金资产的比例为0-95% (其中投资于国内依法发行上市股票的比例占基金资产的0-95%, 投资于沪港通标的股票的比例占基金资产的0-95%), 投资于龙头精选主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%; 持有全部权证的价值不超过基金资产净值的3%; 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后, 应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金所指的龙头精选主题相关证券是指确定性和定量分析, 筛选出细分行业中市场份额大、营业收入与营业利润在各行业中处于领先地位的龙头公司发行的证券, 具体而言, 龙头公司具有市场领军优势, 盈利能力, 抗风险能力, 增长能力较强, 估值水平相对较低且竞争优势明显等特征。

本基金参与股指期货交易, 应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

(三) 投资策略
本基金参与股指期货策略主要有以下六方面内容:
1. 大类资产配置
本基金综合运用定性和定量的分析方法, 在对宏观经济因素进行充分研究的基础上, 判断宏观经济周期所处阶段, 本基金将根据经济周期理论, 结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内, 本基金资产风险和预期收益率的评估, 制定本基金在沪深A股、港股、债券、现金等各类资产之间的配置比例, 动态调整股票仓位。

2. 股票投资策略
(1) 龙头精选的界定
本基金所指的龙头精选主题相关证券, 是指通过定性和定量分析, 筛选出细分行业中市场份额大、营业收入与营业利润在各行业中处于领先地位的龙头公司发行的证券, 具体而言, 龙头公司具有以下几方面特征:

1. 领先的市场份额: 本基金所选的龙头公司市场份额较大, 其营业收入和营业利润在各行业中所占的比例较高, 市场占有率居前, 通过对上市公司所属行业的营业收入和营业利润进行对比, 精选出目标公司;
2. 较强的盈利能力: 本基金所选的龙头公司盈利能力强, 公司的销售净利率、销售毛利率、资产净利率、净资产收益率等指标明显高出同业水平;
3. 较强的抗风险能力: 本基金所选的各细分行业龙头公司具有相对较强的抗风险能力, 通过比较各行业公司的资产负债率、资产负债率以及资产负债保障倍数等指标来筛选抗风险能力居前的公司;
4. 持续的增长能力: 本基金所选的龙头公司市场竞争优势明显, 持续增长能力较强, 其预收或增长率高, 未来2-3年的复合增长率处于所在行业的较高水平;
5. 较高的估值水平: 本基金所选的龙头公司具有合理的估值水平, 通过PEG、企业价值倍数(EV/EBITDA) 等指标进行比较, 能够充分显示其处于低估状态。

(2) 定性分析方面
a. 公司治理优势
本基金参与治理完善的龙头公司治理结构相对完善, 对公司治理结构的评估, 主要是对上市公司经营决策层面的组织架构与治理的灵活性, 完整性和规范性的全面考察, 包括对所有权和经营权的分离、对股东权益的保护、经营管理的自主性、公司内部控制的制订和执行情况等。

b. 公司治理完善
本基金参与治理完善的龙头公司治理结构相对完善, 对公司治理结构的评估, 主要是对上市公司经营决策层面的组织架构与治理的灵活性, 完整性和规范性的全面考察, 包括对所有权和经营权的分离、对股东权益的保护、经营管理的自主性、公司内部控制的制订和执行情况等。

另外, A股市场和港股市场互联互通机制的开通为港股市场龙头公司的估值提供机遇, 也在股权投资上, 本基金重点关注香港联交所同类A股公司折溢价情况, 精选出具有较大估值优势的龙头股票公司。

本基金选择港股的个股逻辑为: 首先, 根据龙头公司具有市场份额大、持续增长稳定、资产盈利能力较强等特征精选出龙头股票公司, 其次, 采用自由现金流贴现模型、股息贴现模型、市净率法、PEG、EV/EBITDA 等估值方法将香港上市公司和同类A股公司相应指标进行对比, 选择港股中相对低估值的龙头公司。

在债券投资策略方面, 本基金将在综合研判的基础上, 采取积极主动的组合管理, 采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券的分析, 在宏观环境分析方面, 结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析, 根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征, 定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整, 确定不同类属资产的最优配置。

在微观市场定价分析方面, 本基金以中长期利率趋势分析为基础, 结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益水平、流动性信用风险等因素, 重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用资质相匹配的债券品种, 总体投资组合收益高于曲线预期、骑乘策略、息差策略等相对策略投资组合。

4. 衍生品投资策略
本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究结果确定权证的投资价值, 发现市场交易价格与权证投资价值偏离, 利用权证本身具有的特性, 通过权证与证券的组合投资, 来达到改善组合风险收益特征的目的。

5. 资产支持证券投资
本基金通过资产支持证券发行条款的合理设计, 严格控制并提前偿付风险, 信用必要的数量模型来评估资产支持证券的投资价值, 在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下, 谨慎选择信用评级较高的品种进行投资。

6. 股指期货投资策略
本基金参与股指期货投资的目的, 套期保值或交易。
本基金将根据股指期货和标的指数波动, 在充分研究股指期货市场行情的基础上, 结合对宏观经济、行业、市场、估值、流动性、信用、利率、政策、流动性等因素, 制定股指期货的投资策略, 进行套期保值或交易。

(四) 基金的风险控制
1. 决策依据
(1) 投资决策委员会集体决策机制
(2) 研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果, 构建股票备选库, 精选券, 对拟投资对象进行持续跟踪调研, 并提前介入, 提供决策支持。
(3) 基金经理根据投资决策委员会的意见, 设计和调整投资组合, 设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括: 每日基金申购和赎回净现金流量、基金合同的投资限制和比例限制、研究员的投资建议、基金业绩的跟踪判断、绩效归因分析小组的建议等。

(4) 投资决策委员会对基金投资提交的投资方案进行论证分析, 并形成决议。
(5) 根据投资决策委员会的投资决策程序, 制定和调整投资组合方案, 交由交易所执行。

(6) 交易所按有关交易规则执行, 并将有关反馈信息反馈给基金经理。
(7) 基金绩效评估及风险管理部门定期进行基金绩效评估, 并向投资决策委员会提交评估报告和改进方案。

(8) 风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责, 尤其重点关注基金投资组合的风险状况, 是反映香港股市价值趋势最有影响的一种价格指数。本基金选择该指数来衡量港股投资市场的绩效。

(五) 业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×35%+恒生指数收益率×35%+中证全债指数收益率×30%。

业绩比较基准选择理由:
沪深300指数是由中证指数公司编制并发布, 表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场各行业中市值领先企业构成的综合价格指数。其样本覆盖沪深两市总市值约70%左右, 具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量A股投资部分的绩效。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制, 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, 是反映香港股市价值趋势最有影响的一种价格指数。本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

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, 该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成, 中证全债指数每日计算并发布中债指数收盘指数及相应的债券质量指标。该指数的一个重要特点在于异常价格和无效价情况下使用了模型价, 能更为真实地反映债券的实际价值和利率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和资产配置约束, 设定本基金的基础为沪深300指数收益率×35%+恒生指数收益率×35%+中证全债指数收益率×30%, 该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

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, 本基金管理人将以维护持有人合法权益为原则, 与基金托管人协商一致并报监管部门备案履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告, 但不需要召集基金份额持有人大会。

(六) 风险收益特征
本基金为混合型基金, 属于中高风险收益的投资品种, 其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金, 低于股票型基金, 本基金为中长期投资品种, 主要投资于中国大陆A股市场及法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的海外市场, 除了需要承担与国内证券市场类似的市场波动风险外, 本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。

(七) 投资管理
1. 组合管理
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为0-95% (其中投资于国内依法发行上市股票的比例占基金资产的0-95%, 投资于沪港通标的股票的比例占基金资产的0-95%), 投资于龙头精选主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%;

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后, 保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
(3) 本基金持有一家上市公司证券, 其市值(同一家公司在国内和香港同时上市的A+H股合并计算) 不超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券, 不得超过该证券的10%;

(5) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%;

(9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%;

(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过该类资产支持证券规模的10%;

(11) 本基金投资于具有评级为BBB+ (含BBB+) 的资产支持证券, 本基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(12) 本基金财产不得用于担保, 不得用于抵押, 不得用于向他人贷款或提供贷款;
(13) 本基金财产不得用于承销业务, 不得用于从事证券承销业务;

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%; 债券回购最长期限为1年, 债券到期前不得展期;
(15) 本基金投资流通受限证券, 基金管理人应事先根据中国证监会相关规定, 与基金托管人签订书面协议, 明确基金投资受限证券的条件和比例, 根据法律法规、基金合同、基金管理人制订严格的投资决策流程和风险控制制度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(16) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总规模的10%, 并且不得超过基金资产净值的10%;

(17) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%;

(18) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的95%; 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(19) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;

(20) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算) 应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(21) 本基金在任何交易日交易(不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

(22) 本基金总资产不得超过基金资产的140%;

(23) 法律法规中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券品种时, 应当遵循基金财产的投资原则, 并制定严格的授权管理制度和投资决策流程, 基金管理人运用基金财产投资证券品种的具体比例, 应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前, 应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协议。
因其他机构投资者与上市公司合并, 基金规模变动等基金管理人之外的因素导致基金投资组合不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在10个工作日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定, 在上述期间内, 基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准, 但须提前公告, 不需要召开基金份额持有人大会。

2. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1) 承销证券;
(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;
(3) 从事内幕交易、操纵证券交易价格;
(4) 买卖其他基金份额, 但是法律法规或监管部门另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易时, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格交易, 相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事批准。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制, 或以变更后的规定为准, 但须提前公告, 不需要经基金份额持有人大会审议。

(A) 基金管理人代表基金份额持有人利益行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法:
1. 不谋求对上市公司的控股, 不参与对上市公司的经营管理;
2. 有利于基金资产的安全与增值;

3. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利, 保护基金份额持有人的利益;

4. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利, 保护基金份额持有人的利益。

(九) 基金的投资组合报告
基金管理人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。
基金托管人根据本基金合同规定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, 保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告组合报告所载数据截至2017年9月30日(未经审计)。
1. 投资组合报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,296,814,638.07	90.14
2	固定收益	1,296,814,638.07	90.14
3	股指期货投资	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	债券回购	-	-
6	权证	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	130,603,761.96	9.36
8	应收利息	2,238,897.97	0.16
9	合计	1,430,627,397.96	100.00

注: 权益投资中通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为1,296,814,638.07元, 占资产净值的90.33%。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
3. 报告期末按行业分类的港股股票投资组合
4. 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金总资产的比例(%)
农林牧渔	124,062,323.21	8.64
医药生物	-	-
消费者服务	-	-
金融	777,062,202.73	49.99
医药行业	142,269,832.45	9.94
工业	31,948,592.45	2.23
信息技术	296,308,796.40	19.53
公用事业	-	-
合计	1,296,814,638.07	90.33

注: 以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
1	0700	恒隆控股	400,800	140,199,833.63	9.77
2	0289	建设银行	23,360,000	128,659,692.82	8.96
3	2338	广汽集团	6,076,000	124,062,323.21	8.64
4	1288	农业银行	40,970,000	121,567,561.07	8.47
5	3988	中国中铁	29,040,000	94,968,675.85	6.62
6	2018	中国平安	796,300	79,671,183.07	5.50
7	0025	汇川技术	1,144,800	73,605,664.64	5.14
8	0076	中国石化	1,926,000	72,513,022.58	5.06
9	2318	中国平安	1,423,500	72,508,005.55	5.05
10	2318	中国平安	8,522,000	66,106,877.37	4.63

注: 以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
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

注: 报告期内未持有资产支持证券。
4. 报告期内未持有资产支持证券。
5. 报告期末未持有资产支持证券。
6. 报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末未持有资产支持证券。
8. 报告期末未持有资产支持证券。
9. 报告期末未持有资产支持证券。
10. 报告期末未持有资产支持证券。

11. 报告期末未持有资产支持证券。
12. 报告期末未持有资产支持证券。
13. 报告期末未持有资产支持证券。
14. 报告期末未持有资产支持证券。

15. 报告期末未持有资产支持证券。
16. 报告期末未持有资产支持证券。
17. 报告期末未持有资产支持证券。
18. 报告期末未持有资产支持证券。

19. 报告期末未持有资产支持证券。
20. 报告期末未持有资产支持证券。
21. 报告期末未持有资产支持证券。
22. 报告期末未持有资产支持证券。

23. 报告期末未持有资产支持证券。
24. 报告期末未持有资产支持证券。
25. 报告期末未持有资产支持证券。
26. 报告期末未持有资产支持证券。

27. 报告期末未持有资产支持证券。
28. 报告期末未持有资产支持证券。
29. 报告期末未持有资产支持证券。
30. 报告期末未持有资产支持证券。

31. 报告期末未持有资产支持证券。
32. 报告期末未持有资产支持证券。
33. 报告期末未持有资产支持证券。
34. 报告期末未持有资产支持证券。

35. 报告期末未持有资产支持证券。
36. 报告期末未持有资产支持证券。
37. 报告期末未持有资产支持证券。
38. 报告期末未持有资产支持证券。

39. 报告期末未持有资产支持证券。
40. 报告期末未持有资产支持证券。
41. 报告期末未持有资产支持证券。
42. 报告期末未持有资产支持证券。

43. 报告期末未持有资产支持证券。
44. 报告期末未持有资产支持证券。
45. 报告期末未持有资产支持证券。
46. 报告期末未持有资产支持证券。

47. 报告期末未持有资产支持证券。
48. 报告期末未持有资产支持证券。
49. 报告期末未持有资产支持证券。
50. 报告期末未持有资产支持证券。

51. 报告期末未持有资产支持证券。
52. 报告期末未持有资产支持证券。
53. 报告期末未持有资产支持证券。
54. 报告期末未持有资产支持证券。

55. 报告期末未持有资产支持证券。
56. 报告期末未持有资产支持证券。
57. 报告期末未持有资产支持证券。
58. 报告期末未持有资产支持证券。

59. 报告期末未持有资产支持证券。
60. 报告期末未持有资产支持证券。
61. 报告期末未持有资产支持证券。
62. 报告期末未持有资产支持证券。

63. 报告期末未持有资产支持证券。
64. 报告期末未持有资产支持证券。
65. 报告期末未持有资产支持证券。
66. 报告期末未持有资产支持证券。

67. 报告期末未持有资产支持证券。
68. 报告期末未持有资产支持证券。
69. 报告期末未持有资产支持证券。
70. 报告期末未持有资产支持证券。

71. 报告期末未持有资产支持证券。
72. 报告期末未持有资产支持证券。
73. 报告期末未持有资产支持证券。
74. 报告期末未持有资产支持证券。

75. 报告期末未持有资产支持证券。
76. 报告期末未持有资产支持证券。
77. 报告期末未持有资产支持证券。
78. 报告期末未持有资产支持证券。

79. 报告期末未持有资产支持证券。
80. 报告期末未持有资产支持证券。
81. 报告期末未持有资产支持证券。
82. 报告期末未持有资产支持证券。

83. 报告期末未持有资产支持证券。
84. 报告期末未持有资产支持证券。
85. 报告期末未持有资产支持证券。
86. 报告期末未持有资产支持证券。

87. 报告期末未持有资产支持证券。
88. 报告期末未持有资产支持证券。
89. 报告期末未持有资产支持证券。
90. 报告期末未持有资产支持证券。

91. 报告期末未持有资产支持证券。
92. 报告期末未持有资产支持证券。
93. 报告期末未持有资产支持证券。
94. 报告期末未持有资产支持证券。

95. 报告期末未持有资产支持证券。
96. 报告期末未持有资产支持证券。
97. 报告期末未持有资产支持证券。
98. 报告期末未持有资产支持证券。

99. 报告期末未持有资产支持证券。
100. 报告期末未持有资产支持证券。
101. 报告期末未持有资产支持证券。
102. 报告期末未持有资产支持证券。

103. 报告期末未持有资产支持证券。
104. 报告期末未持有资产支持证券。
105. 报告期末未持有资产支持证券。
106. 报告期末未持有资产支持证券。

107. 报告期末未持有资产支持证券。
108. 报告期末未持有资产支持证券。
109. 报告期末未持有资产支持证券。
110. 报告期末未持有资产支持证券。

111. 报告期末未持有资产支持证券。
112. 报告期末未持有资产支持证券。
113. 报告期末未持有资产支持证券。
114. 报告期末未持有资产支持证券。

115. 报告期末未持有资产支持证券。
116. 报告期末未持有资产支持证券。
117. 报告期末未持有资产支持证券。
118. 报告期末未持有资产支持证券。

119. 报告期末未持有资产支持证券。
120. 报告期末未持有资产支持证券。
121. 报告期末未持有资产支持证券。
122. 报告期末未持有资产支持证券。

123. 报告期末未持有资产支持证券。
124. 报告期末未持有资产支持证券。
125. 报告期末未持有资产支持证券。
126. 报告期末未持有资产支持证券。