



国泰估值优势股票型证券投资基金 (LOF)

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	国泰估值优势股票 (LOF) (场内简称:国泰估值)
基金代码	160212
交易代码	160212
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月10日
报告期末基金份额总额	146,411,311.84份

投资目标

坚持价值投资的理念,力争在有效控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。

1. 资产配置

本基金资产配置策略主要通过对市场经济状况、宏观经济和政策、国家产业政策以及资本市场估值水平、重点行业估值水平、使用相对 Valuation 模型和资产配置策略,确定资产配置方案。

2. 行业配置

本基金行业配置主要利用 BOC 的特性进行周期性轮动,来优化配置相应的行业。BOC 投资策略主要,是评估资本投入后能取得有效的回报,该指标主要用于资本投入后能取得有效回报的行业,企业长期盈利能力,也是衡量企业综合能力的指标。在宏观经济处于周期性的波动时,应选 BOC 处于上升阶段的行业,在宏观经济处于下行阶段时,应选 BOC 处于下降阶段的行业,在宏观经济处于上升阶段时,应选 BOC 处于上升阶段的行业,在宏观经济处于下行阶段时,应选 BOC 处于下降阶段的行业。

3. 个股选择策略

本基金个股选择主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

5. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

6. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

7. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

8. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

9. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

10. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

11. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

12. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

13. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

14. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

15. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

16. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

17. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

18. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

19. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

20. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

21. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

22. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

23. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

24. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

25. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

26. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

27. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

28. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

29. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

30. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

31. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

32. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

33. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

34. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

35. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

36. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

37. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

38. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

39. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

40. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

41. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

42. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

43. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

44. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

45. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

46. 资产配置策略

本基金资产配置策略主要采取“由下而上”的策略,通过对企业的基本面和市场交易价格进行分析,重点考察具有竞争优势和估值合理的上市公司股票,在严格的风险管理手段的基础上,获取持续稳定的超额收益。

47. 风险控制策略

通过对投资组合在标的证券和组合收益进行分析的基础上,主要用下控制收益和风险控制。

本基金在2013年四季度的净值增长率为2.20%,同期业绩比较基准收益率为-3.03%。

4.8 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的判断

回顾过去一年的投资经历,我国宏观经济复苏的步伐还需要观察,下一阶段我们将重点关注新兴产业的机遇和节奏,国内外部环境经济态势,房地产行业调控的持续性,市场利率利率的变化情况以及经济结构调整和转型的具体政策等等。我们将于下一阶段的市场环境保持一定的灵活性,同时关注以下几个方面投资机会:(1)具有核心竞争力、估值水平合理的优质消费品行业龙头;(2)行业地位突出、估值合理的优质企业;(3)未来市场空间广阔、成长性好的新兴产业龙头企业;(4)符合国家产业结构调整方向、在产业升级过程中受益的强势装备制造企业。

本基金将一如既往地恪守审慎原则,在价值投资理念的指导下,精选个股,注重组合的流动性,力争在有效控制风险的情况下为投资者创造最大的价值。

5.3 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	125,578,828.36	90.26
2	其中:股票	125,578,828.36	90.26
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和拆入资金	11,276,792.25	8.24
10	其中:其他货币资金	2,062,731.29	1.51
11	合计	136,815,351.90	100.00

5.2 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	99,259,187.37	72.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	5,659,716.84	4.16
G	住宿和餐饮业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	12,599,580.40	9.25
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	4,286,743.75	3.15
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	医药和生物制品	1,773,600.00	1.30
N	教育、体育和娱乐业	-	-
O	其他	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
T	其他	-	-
U	其他	-	-
V	其他	-	-
W	其他	-	-
X	其他	-	-
Y	其他	-	-
Z	其他	-	-
合计		123,578,828.36	90.74

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

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	600012	招商银行	1,009,269	11,475,388.53	8.43
2	600518	中航工业	520,000	9,340,000.00	6.87
3	600009	中信证券	841,000.00	6,447,000.00	4.74
4	600887	新亚股份	220,000	8,597,600.00	6.16
5	600587	新华医疗	120,000	8,389,200.00	6.11
6	600276	恒顺达	199,860	7,590,682.80	5.57
7	601766	中国南车	1,470,000	7,340,700.00	5.41
8	600597	光明乳业	300,000	6,660,000.00	4.89
9	000005	双汇发展	138,453	6,345,362.24	4.79
10	002410	广联达	200,000	6,300,000.00	4.63

5.4 报告期末按基金品种分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

报告期内,本基金未参与期权交易。

5.11 报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

报告期内,本基金未参与贵金属交易。

5.12 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.13 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.14 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.15 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.16 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.17 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.18 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.19 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.20 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.21 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.22 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.23 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.24 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.25 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.26 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.27 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.28 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.29 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.30 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.31 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.32 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.33 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.34 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.35 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.36 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.37 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.38 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.39 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.40 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.41 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.42 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.43 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.44 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.45 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.46 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.47 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.48 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.49 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.50 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.51 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.52 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.53 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.54 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.55 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.56 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.57 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.58 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.59 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.60 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.61 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.62 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.63 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.64 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.65 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.66 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.67 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.68 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.69 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.70 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.71 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.72 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.73 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.74 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.75 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.76 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.77 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.78 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.79 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.80 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.81 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.82 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.83 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.84 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.85 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.86 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.87 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.88 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.89 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.90 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.91 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.92 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.93 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.94 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.95 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.96 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.97 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.98 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.99 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.100 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

报告期内,本基金未参与期权交易。

5.11 报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

报告期内,本基金未参与贵金属交易。

5.12 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.13 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.14 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.15 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.16 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.17 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.18 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.19 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.20 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.21 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.22 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.23 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.24 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.25 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.26 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.27 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.28 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.29 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.30 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.31 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.32 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.33 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.34 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.35 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.36 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.37 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.38 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.39 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

报告期内,本基金未参与衍生品交易。

5.40 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明