

# **瑞达期货-瑞智进取共赢5号集合资产管理计划2020 年年度报告**

**2020年12月31日**

基金管理人：瑞达期货股份有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

# 1、基金产品概况

## 1.1、基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 瑞达期货-瑞智进取共赢 5 号集合资产管理计划 |
| 基金编号       | SJK472                  |
| 基金运作方式     | 开放式                     |
| 基金成立日期     | 2020-01-20              |
| 基金管理人      | 瑞达期货股份有限公司              |
| 基金托管人      | 国泰君安证券股份有限公司            |
| 投资顾问（如有）   | 无                       |
| 报告期末基金份额总额 | 32,833,279.96           |
| 基金到期日期     | 2030-01-19              |

## 1.2、基金产品说明

|            |                                                                                                    |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标       | 在风险适度可控前提下，追求长期、稳定的适度收益。                                                                           |
| 投资策略       | 本产品主策略为追踪市场热点，采用趋势追踪与跨品种套利相结合策略，捕捉确定性较高的投资机会。当系统发出交易信号时，通过调整投资品种结构比例，设置合理的风险控制级别，人机相结合的方式积极参与市场交易。 |
| 业绩比较基准(如有) |                                                                                                    |
| 风险收益特征     | 本计划为 R4（中高）等级产品，适合风险识别、评估、承受能力为 C4（积极）、C5（激进）的合格投资者(本产品不接受风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者认购)             |

## 1.3、基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                 | 基金托管人                  |
|-------------|------|-----------------------|------------------------|
| 名称          |      | 瑞达期货股份有限公司            | 国泰君安证券股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 林毅娜                   | 胡凯                     |
|             | 联系电话 | 0592-3273105          | 021-38917599-5         |
|             | 电子邮箱 | rdqhzg2@163.com       | tgrxp@tg.gtja.com      |
| 传真          |      |                       |                        |
| 注册地址        |      | 厦门市思明区塔埔东路 169 号 13 层 | 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号 |

|       |                                 |                             |
|-------|---------------------------------|-----------------------------|
| 办公地址  | 厦门市思明区桃园路 18 号瑞达国际金融<br>中心 28 楼 | 上海市静安区新闻路<br>669 号博华广场 19 楼 |
| 邮政编码  | 361000                          | 200041                      |
| 法定代表人 | 林志斌                             | 贺青                          |

#### 1.4、信息披露方式

|  |
|--|
|  |
|--|

#### 1.5、其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                             |
|--------|------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） | 厦门市湖里区环岛干道万科云玺 2 号楼<br>B 座 7-9 楼 |
| 注册登记机构 | 国泰君安证券股份有限公司     | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场<br>18 楼      |
| 外包机构   | 国泰君安证券股份有限公司     | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场<br>18 楼      |

## 2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 2.1、主要会计数据和财务指标

| 期间数据和指标          | 2020 年        | 2019 年     | 2018 年     |
|------------------|---------------|------------|------------|
| 本期已实现收益          | 10,819,493.42 | 0.00       | 0.00       |
| 本期利润             | 11,816,510.99 | 0.00       | 0.00       |
| 期末数据和指标          | 2020 年末       | 2019 年末    | 2018 年末    |
| 期末可供分配利润         | 4,242,073.65  | 0.00       | 0.00       |
| 期末可供分配基金份额利<br>润 | 0.1292        | 0.0000     | 0.0000     |
| 期末基金净资产          | 38,414,154.87 | 0.00       | 0.00       |
| 报告期期末单位净值        | 1.1700        | 0.0000     | 0.0000     |
| 累计期末指标           | 2020 年末（%）    | 2019 年末（%） | 2018 年末（%） |
| 基金份额累计净值增长率      | 53.03%        | 0.00%      | 0.00%      |

## 2.2、基金净值表现

| 阶段         | 净值增长率(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准收益率(%) | 业绩比较基准收益率标准差(%) |
|------------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当年         | 53.03    | -           | -            | -               |
| 自基金合同生效起至今 | 53.03    | -           | -            | -               |

注：

净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

表中指标均以不带百分号数值形式表示，一般保留至小数点后2位。

## 2.3、过去三年基金的利润分配情况

| 年度     | 每份基金份额分红数 | 现金形式发放总额     | 再投资形式发放总额    | 年度利润分配合计     | 备注 |
|--------|-----------|--------------|--------------|--------------|----|
| 2020 年 | 0.36      | 5,149,416.42 | 3,441,565.53 | 8,590,981.95 |    |
| 2019 年 | 0.00      | 0.00         | 0.00         | 0.00         |    |
| 2018 年 | 0.00      | 0.00         | 0.00         | 0.00         |    |

## 3、基金份额变动情况

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 16,401,471.66 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 19,472,524.96 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,040,716.66  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00          |
| 报告期期末基金份额总额               | 32,833,279.96 |

注：

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

## 4、管理人报告

一、2020 年 CTA（管理期货）市场表现

2020 年资管产品再现了“收益相对较高、产品回撤较低”的特性，部分地实现了客户财富“稳步增长”的诉求；亦实现了产品策略设计的初衷，通过策略“稳”、“准”、“狠”等性能，在风险可控前提下，尽量提升产品净值。瑞智无忧产品系列、瑞智进取产品系列、瑞智稳健产品系列三大产品系列净值持续创新高，最大回撤基本上控制在较小范围内，产品（策略）综合排名处在行业前列。2020 年资管产品表现优异，资管研发团队策略开发是盈利根本。当然，2020 年市场大波动是驱动业绩关键因素。

截至 2020 年 12 月 31 日，中金所、上期所、大商所、郑商所合计上市期货品种约 68 个，在行业内常分成金融、贵金属、有色、黑色、能源化工、农产品六大板块。在剔除流动性（成交、持仓）不足和合并高度相关品种，共有约 52 个期货品种，涉及到商品市场（商品期货）、权益市场（三大股指期货）和债券市场（三大国债品种）。

2020 年期货市场整体呈现一个符号“√”模式，在年初疫情冲击大幅下挫，之后演绎“v”字反转，大部分品种创新高，铁矿石、焦炭和练豆等年度涨幅 50%以上，原油表现最差，年度下跌近 36%至 300 元/桶（约 50 美元/桶），金融股指（沪深 300）也录得 27.2%收益。品种趋势和振幅高于 2019 年，期货“多空双向”功能优势凸显，尤其是，一季度全球主要资产被重挫情况下，在这“糟糕”一年里，CTA（管理期货）在大波动下资产配置功能逐步被国内投资者所发现、认识至开始有所青睐。

在市场大幅波动下，瑞达资管产品净值得以快速增长。以无忧产品指数样本-以无忧共赢 7 号为例，其他同一产品系列复制该策略。2020 年，无忧共赢 7 号年初净值为 1.1382，年终为 2.0105 年度净值 76.6%，年度最大回撤 4.1%。除 2020 年一月份、九月份外，其他 10 个月份均实现月度交易正收益，月交易最大盈利 15%以上，最大亏损-1.2%以内。季度品种盈亏比 2.5: 1 以上，平均盈亏比高达 3: 1 以上。从具体品种盈亏归因来看，呈现“多品种、多策略”市场中性策略特性，一般持有品种 40 个以上，覆盖市场 80%活跃品种。伴随市场品种大波动，相应地获取不同收益，如，第一季度原油、二三季度股指、四季度焦炭等分别为无忧产品贡献最大盈利，产品亏损较为分散。盈利品种与亏损品种数量（合约）基本持平，为市场中性策略特性。

## 二、2021 年期货市场展望

货币流动性是推动资产价格最主要变量，我们重点关注 2021 年国家货币流动性情况和 CTA 市场本身流动性情况。

### 2.1 货币流动性充裕

按照货币学派创始人弗里德曼曾说过，一切通货膨胀都是货币现象。不难得出，2020 全球货币大幅宽松带来新一轮“通货”和资产价格上涨。在疫情情况下，2020 年各国货币、财政刺激前所未有，甚至超过 2008 年。伴随疫苗疫苗研制突破并将相继应用，疫情对经济的负面影响将逐步消除，疫情放缓，财政与货币政策幅度放缓，但 2021 年货币宽松仍将延续，即使在下半年逐步过度到疫情后时代，宽松力度边际放缓，但货币政策的退出是渐进的，全球范围的低利率水平仍将维持。在全球货币宽松前提下，疫情后经济逐步复苏，宽松货币将逐步传导，货币宽松逐步发散扩展--资产价格水平上涨--企业盈利改善--投资和库存增加--产出增加--利率上升等，流动性相对充裕进一步推高资产价格和抬升 CPI。而且，海外流动性充裕远超中国，未来有很大修复空间，通胀和利率均处于低位，信用扩张有助于推动全球经济走向复苏。中国领先经济复苏和强大的疫情控制能力，将也加大海外资金流入中国。因此，2021 年流动性比较宽松，当实体经济不足于吸收流动性，很大部分将注入商品、股市等虚拟经济。

### 2.2 CTA 市场资金沉淀持续 行情有望持续

具体从股指、商品资金面情况，不管是股指期货还是商品期货，市场资金不断注入的情况下，使得价格的波动率出现明显上升，同时也形成了一定的趋势并推升价格。2021 年上半年，预计沉淀的资金不会轻易褪去，甚至可能还将加入新的资金，这种情况下，价格的波动率将继续维持甚至扩大，而总体的趋势（涨势）也将继续延续，部分品种的上涨势将出现非理性的延续和扩张。

而 2021 年年中至下半年，随着资金的消退，价格可能陷入震荡或反转（下跌），这一点从国债走势的可能变点可以推敲出来，同时价格的波动率也将下降。在国债方面，近年低利率的盛行，使得国债期货转入强势，从当前宏观形势以及“新冠”疫情的影响下，马上利率转变为上行的概率极低，不过随着时间的推移，这种变化可能慢慢出现。因此近期国债期货的小级别转弱是对这种可能变化的一个预期反应。

因此，从历史数据来看，期货市场具有一个赚钱（多头）自我强化效应，预计未来期货市场维持资金大幅流入的态势。

### 三、CTA 策略更加丰富 资产配置仍正当时

因期货本身具有“T+0”、“多空双向”、“保证金交易机制”、“合约自我创造”等特性，使得管理期货（CTA）在资产配置上或策略上更丰富和更具优势。同时，目前期货品种日益丰富，既覆盖黄金白银贵金属，原油、铁矿石、钢铁、煤炭、铜铝镍有色金属、农产品等国际化大宗商品，亦包含着权益类品种的股指期货、国债期货等，可谓是贯穿了股市、债市、商品等大类资产，期货本身优势与品种多样性，进一步增强管理期货（CTA）资产配置优势。而且，CTA 亦是对冲风险主要工具，在股市大幅下挫或债市表现不佳时，CTA 功能优势凸显。

伴随着经济增速放缓，资产回报率（中长期资产回报率等于经济增速）逐步降低，传统的单一资产获利难度越来越低，尤其资管新规以来，打破刚兑与期限错配，使得之前资产、传统型的理财产品、新型的货币基金等收益率有所下降，且不再“低风险”，另外，在诸多政策压制下，房地产资产占比趋于均衡饱和。因此，股、债、以及具有多种功能大宗商品期货市场配置比例越来越高，外加海外资金流入，将大大增加市场流动性，并推动部分资产价格上升。这一特性在疫情后时代将更加凸显，因此，对于 2021 年（上半年），我们对商品、股、债等比较乐观的。根据以上分析，结合瑞达期货年度研究报告和模型，在策略上仍坚持“多策略、多周期和多配置”综合性配置模式，无忧产品系列和稳健产品系列，仍坚持“市场中性”模式。

预计 2021 年超常的政策及流动性支持，叠加经济增长从底部缓慢复苏，主导了全球大类资产表现。在配置上，重点配置在复苏前提下估值驱动下的股指，继续持有股指多头替代股票，在标的选择上，以沪深 300 股指多头配置为主，以上证 50 与中证 500 阶段性涨幅不同的风格对冲套利为辅，为了降低股指多头风险，适当配置与股指相关性较高的能源化工、工业品、金属等空头品种，降低股指与商品对冲敞口（或轧差），以控制风险。另外，在经济复苏和（全球）企业复工后，商品期货品种也会出现分化。基于配置秩序，预计铁矿石、螺纹、焦煤焦炭等配置比例居于第二位，并适当继续提升农产平配置比例。根据历史时期表现，预计黄金白银贵金属波动或将大幅降低，将降低贵金属配置比例。

最后，金融实证研究表明，金融市场波动具有“尖峰厚尾”特性和波动具有聚集特征，大的资产波动后面往往存在更大的波动，如，2014 年牛市，而后接着波澜壮阔的大跌。2020 年“v”字形大波动，2021 市场大波动仍具有连续性，在风险可控前提下，对未来大波动仍可持续大环境下，CTA 策略仍具有较大优势，并对预期充满期待。

## 5、托管人报告

### 5.1、报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

## 5.2、托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

|  |
|--|
|  |
|--|

## 5.3、托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

|  |
|--|
|  |
|--|

# 6、年度财务报表

## 6.1、资产负债表

单位：元

| 资产       | 本期末 2020-12-31 | 上年度末 2019-12-31 |
|----------|----------------|-----------------|
| 资产：      |                |                 |
| 银行存款     | 25.16          | 0.00            |
| 结算备付金    | 31,126,810.73  | 0.00            |
| 存出保证金    | 7,499,779.40   | 0.00            |
| 交易性金融资产  | 0.00           | 0.00            |
| 其中：股票投资  | 0.00           | 0.00            |
| 基金投资     | 0.00           | 0.00            |
| 债券投资     | 0.00           | 0.00            |
| 资产支持证券投资 | 0.00           | 0.00            |
| 贵金属投资    | 0.00           | 0.00            |
| 衍生金融资产   | 0.00           | 0.00            |
| 买入返售金融资产 | 0.00           | 0.00            |
| 应收证券清算款  | 0.00           | 0.00            |
| 应收利息     | 0.00           | 0.00            |
| 应收股利     | 0.00           | 0.00            |
| 应收申购款    | 0.00           | 0.00            |
| 递延所得税资产  | 0.00           | 0.00            |
| 其他资产     | 0.00           | 0.00            |
| 资产总计     | 38,626,615.29  | 0.00            |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2020-12-31 | 上年度末 2019-12-31 |
| 负债：      |                |                 |
| 短期借款     | 0.00           | 0.00            |

|            |               |      |
|------------|---------------|------|
| 交易性金融负债    | 0.00          | 0.00 |
| 衍生金融负债     | 0.00          | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款  | 0.00          | 0.00 |
| 应付证券清算款    | 0.00          | 0.00 |
| 应付赎回款      | 0.00          | 0.00 |
| 应付管理人报酬    | 157,176.02    | 0.00 |
| 应付托管费      | 1,571.78      | 0.00 |
| 应付销售服务费    | 0.00          | 0.00 |
| 应付交易费用     | 0.00          | 0.00 |
| 应交税费       | 51,355.03     | 0.00 |
| 应付利息       | 0.00          | 0.00 |
| 应付利润       | 0.00          | 0.00 |
| 递延所得税负债    | 0.00          | 0.00 |
| 其他负债       | 2,357.59      | 0.00 |
| 负债合计       | 212,460.42    | 0.00 |
| 所有者权益:     |               |      |
| 实收基金       | 32,833,279.96 | 0.00 |
| 未分配利润      | 5,580,874.91  | 0.00 |
| 所有者权益合计    | 38,414,154.87 | 0.00 |
| 负债和所有者权益总计 | 38,626,615.29 | 0.00 |

## 6.2、利润表

单位：元

| 项目               | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|------------------|-------------------------|-------------------------|
|                  | 2020-01-20 至 2020-12-31 | 2019-01-01 至 2019-12-31 |
| 一、收入             | 14,380,905.27           | 0.00                    |
| 1.利息收入           | 6,915.71                | 0.00                    |
| 其中：存款利息收入        | 6,915.71                | 0.00                    |
| 债券利息收入           | 0.00                    | 0.00                    |
| 资产支持证券利息收入       | 0.00                    | 0.00                    |
| 买入返售金融资产收入       | 0.00                    | 0.00                    |
| 其他利息收入           | 0.00                    | 0.00                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 13,439,841.96           | 0.00                    |
| 其中：股票投资收益        | 0.00                    | 0.00                    |
| 基金投资收益           | 0.00                    | 0.00                    |
| 债券投资收益           | 0.00                    | 0.00                    |
| 资产支持证券投资收益       | 0.00                    | 0.00                    |
| 贵金属投资收益          | 0.00                    | 0.00                    |
| 衍生工具收益           | 13,439,841.96           | 0.00                    |
| 股利收益             | 0.00                    | 0.00                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以   | 1,000,880.66            | 0.00                    |



|                  |                      |             |
|------------------|----------------------|-------------|
| “-”填列)           |                      |             |
| 4.汇兑收益（损失以“-”填列） | 0.00                 | 0.00        |
| 5.其他收入（损失以“-”填列） | -66,733.06           | 0.00        |
| <b>减：二、费用</b>    | <b>2,564,394.28</b>  | <b>0.00</b> |
| 1.管理人报酬          | 477,826.20           | 0.00        |
| 其中：固定管理费         | 477,826.20           | 0.00        |
| 业绩报酬             | 0.00                 | 0.00        |
| 2.托管费            | 4,778.30             | 0.00        |
| 3.销售服务费          | 0.00                 | 0.00        |
| 4. 外包服务费         | 7,167.44             | 0.00        |
| 5.交易费用           | 2,062,751.26         | 0.00        |
| 6.利息支出           | 0.00                 | 0.00        |
| 其中：卖出回购金融资产支出    | 0.00                 | 0.00        |
| 7.其他费用           | 11,871.08            | 0.00        |
| <b>三、利润总额</b>    | <b>11,816,510.99</b> | <b>0.00</b> |
| 减:所得税费用          | 0.00                 | 0.00        |
| <b>四、净利润</b>     | <b>11,816,510.99</b> | <b>0.00</b> |

### 6.3、所有者权益变动表

单位：元

| 项目                                     | 本期<br>2020-01-20 至 2020-12-31      |               |               |
|----------------------------------------|------------------------------------|---------------|---------------|
|                                        | 实收基金                               | 未分配利润         | 所有者权益合计       |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 16,401,471.66                      | 0.00          | 16,401,471.66 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0.00                               | 11,816,510.99 | 11,816,510.99 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 16,431,808.30                      | 2,355,345.87  | 18,787,154.17 |
| 其中：1.基金申购款                             | 19,472,524.96                      | 2,969,040.57  | 22,441,565.53 |
| 2.基金赎回款                                | -3,040,716.66                      | -613,694.70   | -3,654,411.36 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | 0.00                               | -8,590,981.95 | -8,590,981.95 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 32,833,279.96                      | 5,580,874.91  | 38,414,154.87 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019-01-01 至 2019-12-31 |               |               |
|                                        | 实收基金                               | 未分配利润         | 所有者权益合计       |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 0.00                               | 0.00          | 0.00          |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0.00                               | 0.00          | 0.00          |

|                                        |      |      |      |
|----------------------------------------|------|------|------|
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其中：1.基金申购款                             | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 2.基金赎回款                                | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

## 7、期末投资组合情况

### 7.1、期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占资产总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 0.00          | 0.00         |
|    | 其中：普通股            | 0.00          | 0.00         |
|    | 存托凭证              | 0.00          | 0.00         |
| 2  | 基金投资              | 0.00          | 0.00         |
| 3  | 固定收益投资            | 0.00          | 0.00         |
|    | 其中：债券             | 0.00          | 0.00         |
|    | 资产支持证券            | 0.00          | 0.00         |
| 4  | 金融衍生品投资           | 0.00          | 0.00         |
|    | 其中：远期             | 0.00          | 0.00         |
|    | 期货                | 0.00          | 0.00         |
|    | 期权                | 0.00          | 0.00         |
|    | 权证                | 0.00          | 0.00         |
| 5  | 买入返售金融资产          | 0.00          | 0.00         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00          | 0.00         |
| 6  | 货币市场工具            | 0.00          | 0.00         |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 31,126,835.89 | 80.58        |
| 8  | 其他                | 7,499,779.40  | 19.42        |
|    | 合计                | 38,626,615.29 | 100.00       |

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。 本报“其他”项中列示的主要包括期货交易保证金、各类应收款等，具体情况见《其他资产构成报表》。

## 7.2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

| 序号 | 行业类别             | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 0.00 | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 0.00 | 0.00         |
| C  | 制造业              | 0.00 | 0.00         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 0.00 | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 0.00 | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 0.00 | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 0.00 | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 0.00 | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 0.00 | 0.00         |
| J  | 金融业              | 0.00 | 0.00         |
| K  | 房地产业             | 0.00 | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 0.00 | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 0.00 | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 0.00 | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | 0.00 | 0.00         |
| P  | 教育               | 0.00 | 0.00         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 0.00 | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 0.00 | 0.00         |
| S  | 综合               | 0.00 | 0.00         |
|    | 合计               | 0.00 | 0.00         |

### 7.2.2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

| 行业类别    | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例(%) |
|---------|-----------|--------------|
| 基础材料    | 0.00      | 0.00         |
| 消费者非必需品 | 0.00      | 0.00         |
| 消费者常用品  | 0.00      | 0.00         |
| 能源      | 0.00      | 0.00         |
| 金融      | 0.00      | 0.00         |

|      |      |      |
|------|------|------|
| 医疗保健 | 0.00 | 0.00 |
| 工业   | 0.00 | 0.00 |
| 信息技术 | 0.00 | 0.00 |
| 电信服务 | 0.00 | 0.00 |
| 公用事业 | 0.00 | 0.00 |
| 房地产  | 0.00 | 0.00 |
| 合计   | 0.00 | 0.00 |

注：

以上分类采用全球行业标准 (GICS)。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

## 附：其他资产构成报表

金额单位：元

| 序号  | 名称         | 金额           |
|-----|------------|--------------|
| 1   | 交易保证金      | 7,499,779.40 |
| 1.1 | 其中：期货交易保证金 | 7,499,779.40 |
| 2   | 应收证券清算款    | 0.00         |
| 3   | 应收股利       | 0.00         |
| 4   | 应收基金红利     | 0.00         |
| 5   | 应收利息       | 0.00         |
| 6   | 应收申购款      | 0.00         |
| 7   | 其他应收款      | 0.00         |
| 8   | 待摊费用       | 0.00         |
| 9   | 其他         | 0.00         |
| 10  | 合计         | 7,499,779.40 |