

# 清水源 20 号 A 证券投资基金 2020 年年度报告

## 1、基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

|                          |                   |
|--------------------------|-------------------|
| 基金名称                     | 清水源 20 号 A 证券投资基金 |
| 基金编码                     | S28116            |
| 基金运作方式                   | 开放式               |
| 基金成立日期                   | 2015 年 04 月 07 日  |
| 基金管理人                    | 深圳清水源投资管理有限公司     |
| 基金托管人（如有）                | 招商证券股份有限公司        |
| 投资顾问（如有）                 | -                 |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 2,573.311454      |
| 基金到期日期                   | 9999 年 12 月 31 日  |

### 1.2 基金产品说明

|            |                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标       | （1）本基金的投资目标为“清水源 20 号证券投资基金”；（2）“清水源 20 号证券投资基金”的投资目标为：本基金以绝对收益为目标，在风险有效控制的基础上，主动投资于具有良好流动性的金融工具，力争投资资产的稳健增值。                                                                                                                                             |
| 投资策略       | 本基金的投资策略为将基金资产定向投资于“清水源 20 号证券投资基金”。“清水源 20 号证券投资基金”的投资策略为：本基金投资组合将采取动态优化的投资策略，根据宏观经济的基本情况、证券市场走势、主流研究机构看法及市场热点等情况及时优化组合配置。股票配置关注各板块或行业的历史估值、现在估值及基本面的发展趋势。个股选择主要考虑公司发展和盈利的稳定性、成长性和目前估值的合理性。在遵守基金合同约定和坚持公司投资理念的大方向基本上，坚持稳健进取的原则，坚持定性分析和定量分析，追求本计划资产的稳定增值。 |
| 业绩比较基准（如有） | -                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 风险收益特征     | 本基金具有较高收益、较高风险的特征。                                                                                                                                                                                                                                        |

### 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      | 深圳清水源投资管理有限公司 | 招商证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名            | 田建         |
|         |               | 韩鑫普        |

|       |      |                                     |                      |
|-------|------|-------------------------------------|----------------------|
|       | 联系电话 | 0755-83453162                       | 0755-82943666        |
|       | 电子邮箱 | tianjian@qsyfunds.com               | tgb@cmschina.com.cn  |
| 传真    |      | 0755-82028895                       | 0755-82960794        |
| 注册地址  |      | 深圳市福田区福田街道福安社区民田路 178 号华融大厦 5 层 501 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 办公地址  |      | 深圳市福田区福田街道福安社区民田路 178 号华融大厦 5 层 501 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 邮政编码  |      | 518000                              | 518000               |
| 法定代表人 |      | 冯文光                                 | 霍达                   |

#### 1.4 信息披露方式

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

#### 1.5 其他相关资料（如有）

| 项目     | 名称         | 办公地址                 |
|--------|------------|----------------------|
| 会计师事务所 | -          | -                    |
| 注册登记机构 | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 外包机构   | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| ---    | -          | -                    |

### 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      | -2,799,429.63  | -4,516,357.78  | -11,058,920.72 |
| 本期利润         | 2,408,642.68   | 6,828,219.90   | -7,660,860.39  |
| 期末数据和指标      | 2020 年末        | 2019 年末        | 2018 年末        |
| 期末可供分配利润     | -24,686,131.70 | -32,415,877.60 | -37,385,874.03 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.9593        | -0.8660        | -0.7586        |
| 期末基金净资产      | 19,578,414.68  | 24,961,415.68  | 24,607,722.65  |
| 报告期期末单位净值    | 0.7608         | 0.6668         | 0.4993         |
| 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  | -23.92%        | -33.32%        | -50.07%        |

## 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         | 14.10    | -           | -            | -               |
| 自基金合同生效起至今 | -23.92   | -           | -            | -               |

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

## 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 | 0.00      | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 2019 | 0.00      | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 2018 | 0.00      | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |

## 3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 3,743.296455 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 0.00         |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,169.985001 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00         |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额          | 2,573.311454 |

## 4、管理人说明的其他情况

### 1、报告期内高管、基金经理及其关联基金经验

现投资经理为冯文光。

董事长冯文光，中山大学金融学硕士，11年基金从业经验，曾在诺安基金、金鹰基金、大成基金任职，多年担任基金经理。拥有丰富的基金管理经验，经历市场牛熊历练，业绩优异，排名靠前。

### 2、基金运作合规守信情况：

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募基金投资监督管理办法》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 3、基金投资策略和业绩表现：

本基金的投资策略为将基金资产定向投资于“清水源20号证券投资基金”，“清水源20号证券投资基金”的股票配置中，在板块和行业选择中主要看各板块或行业的历史估值、现在估值及基本面的发展趋势。并对历史估值和现在估值进行纵向对比分析、对各行业间的估值进行横向比较分析，对基本面发展变化进行敏感性分析后再做出最终的配置选择；个股选择时主要考虑公司发展和盈利的稳定性与否、成长性高低和目前估值的合理性与否等问题。在遵守产品合同规定和坚持公司投资理念的大方向基础上，考虑上市公司的素质以及市场所依存的环境、现阶段市场特征、

市场的投资者结构，坚持稳健进取原则，坚持定性分析和定量分析，追求管理资产的稳定增值。季度业绩表现参见本报告前述净值数据。

#### 4、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：

2020年2季度，我们认为在前所未有的黑天鹅事件的冲击之后，中国A股将维持震荡向上的走势；具备核心技术的科技企业及医疗医药、消费板块有望获得较高超额收益。主要理由及逻辑如下：（1）在深化改革开放及工程师红利的大背景下，中长期保持战略看好中国经济及资本市场的积极思维；（2）新冠肺炎疫情对全球经济金融的冲击前所未有，海外疫情目前形势非常严峻，事件进展仍需密切跟踪；（3）消费、医药等核心资产由于稳定增长的业绩最有希望走出长期慢牛的行情，电动车、半导体、5G、云计算、人工智能等科技成长类产业受益政策支持想象空间巨大；（4）为应对疫情对全球经济的负面冲击，各国经济政策将较为友好；（5）中国资本市场将继续加大开放力度，对国际资本而言，长期增加中国A股的战略性配置仍是大势所趋。

我们认为从长期看，中国将继续大力支持战略新兴产业的发展以提高经济发展质量，具备核心技术的科技龙头公司将有望长期获得较高超额收益；中国多年改革开放所积累的强大国力及形成的庞大内需消费市场，消费、医药行业将长期成为海内外资金关注的重点板块。地产、基建等低估值高分红的蓝筹股，有望受益稳增长的刺激政策迎来较好的配置机会。结构层面，我们中长期看好科技、消费、医药等行业的投资机会，同时也会自下而上寻找有超额收益的个股。

#### 5、内部基金监察稽核工作、基金估值程序（见基金合同“基金的估值”章节）、基金运作情况和运用杠杆情况：

2019年一季度，A股大幅上涨，首先中国政策继续变化以求稳增长；2018年全年中国股市下跌幅度较大，市场整体估值处于极低水平；消费行业由于稳定增长的业绩将迎来估值切换机会，科技成长类产业受益政策支持想象空间巨大。另外，中美贸易战的利好预期以及美联储加息步伐的减缓，都有利于A股的做多情绪。产品方面，我们从年初以来，逐步加仓，从半仓左右上升到7-8成左右，取得了一定的涨幅。配置层面，以TMT为代表的科技成长类行业，消费行业，金融地产等低估值高分红的蓝筹股，是我们重点关注的板块。

二三季度，A股出现较大幅度的回调。主要在于，年初在内外政策刺激下估值回升行情之后基本面没有跟上；同时中美贸易摩擦持续发酵，对投资者情绪造成影响，市场保持低迷导致；经过一季度的大幅反弹之后，外资流入中国资本市场的速度有所放缓，甚至会出现阶段性的卖出。产品方面，我们在股市回调一定幅度后开始逐步减仓，导致年初以来的涨幅有一定的回撤，二季度维持在半仓左右，三季度后期市场探底后，开始小幅加仓，产品维持在6-7成仓位左右。

进入四季度，A股整体上保持震荡上行的态势。前半期的震荡主要由于中美关于贸易战的不断博弈，使市场承压，投资者的风险偏好降低，加之科技等板块涨幅巨大，面临部分抛售压力，后半期随着中美贸易争端趋于明朗化，其对中国股市的边际影响越来越小，同时中国资本市场将继续加大开放力度，国际资本不断流入，市场风险偏好明显增加。

产品方面，我们在股市震荡时维持6-7成左右仓位，12月份继续加仓至8-9成，并维持较高的仓位。配置层面，主要围绕金融、地产的龙头公司及科技、消费行业的优质公司进行配置。

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。本基金无杠杆操作。

#### 6、投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期末未进行利润分配，无损失承担情况发生，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 7、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可存在的利益冲突等：

本基金合同未约定预警线和止损线，也不存在利益冲突。

## 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

本报告期，本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本托管人按照基金合同的约定，对本基金报告期的基金资产净值进行了复核；同时依据法律法规和基金合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反基金合同约定的事项。报告期内，本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。

### 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

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

## 6、年度财务报表

### 6.1 资产负债表

金额单位：元

| 资产       | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|----------|------------|------------|
| 资产：      |            |            |
| 银行存款     | 66,030.83  | 34,380.98  |
| 结算备付金    | 0          | 0.00       |
| 存出保证金    | 0          | 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       | 19,655,168.95 | 25,147,301.80  |
| 资产总计       | 19,721,199.78 | 25,181,682.78  |
| 负债和所有者权益   | 2020-12-31    | 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    | 33,924.52     | 42,208.76      |
| 应付托管费      | 7,269.55      | 9,044.72       |
| 应付销售服务费    | 99,167.86     | 165,998.70     |
| 应付交易费用     | 0.00          | 0.00           |
| 应交税费       | 0.00          | 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       | 2,423.17      | 3,014.92       |
| 负债合计       | 142,785.10    | 220,267.10     |
| 所有者权益:     |               |                |
| 实收基金       | 25,733,114.54 | 37,432,964.55  |
| 未分配利润      | -6,154,699.86 | -12,471,548.87 |
| 所有者权益合计    | 19,578,414.68 | 24,961,415.68  |
| 负债和所有者权益总计 | 19,721,199.78 | 25,181,682.78  |

注：1、其他资产：未被统计进前列分类的资产科目，主要包括其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

2、其他负债：未被统计进前列分类的负债科目，主要包括应付外包服务费、应付投资顾问费、应付咨询服务费等。

3、6.1 资产负债表中“股票投资”统计所有股票（含新三板股票）投资市值，7.1 章节中“股票投资”统计除新三板投资和上市公司定向增发股票投资以外的市值，新三板投资和上市公司定向增发股票投资有单独指标统计。

4、6.1 资产负债表中“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”单独列示，“其他资产”是总资产与已列示明细资产项的轧差项，7.1 期末基金资产组合情况中“其他资产”中除总资产与已列示明细资产项的轧差项外，还包含“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”。

## 6.2 利润表

金额单位：元

| 项目                     | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                        | 2020年01月01日至2020年12月31日 | 2019年01月01日至2019年12月31日 |
| 一、收入                   | 2,717,742.52            | 7,207,733.97            |
| 1. 利息收入                | 231.67                  | 166.54                  |
| 其中：存款利息收入              | 231.67                  | 166.54                  |
| 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）      | -2,490,561.46           | -4,137,010.25           |
| 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                 | 0.00                    | 0.00                    |
| 股利收益                   | 0.00                    | 0.00                    |
| 其他收益                   | -2,490,561.46           | -4,137,010.25           |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 5,208,072.31            | 11,344,577.68           |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | 0.00                    | 0.00                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 0.00                    | 0.00                    |
| 减：二、费用                 | 309,099.84              | 379,514.07              |
| 1. 管理人报酬               | 135,192.52              | 165,998.70              |
| 其中：固定管理费               | 135,192.52              | 165,998.70              |
| 业绩报酬                   | 0.00                    | 0.00                    |
| 2. 托管费                 | 28,969.80               | 35,571.14               |
| 3. 销售服务费               | 135,192.52              | 165,998.70              |
| 4. 运营服务费               | 9,656.51                | 11,857.04               |
| 5. 交易费用                | 0.00                    | 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                | 88.49                   | 88.49                   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    | 2,408,642.68            | 6,828,219.90            |
| 减：所得税费用                | 0                       | 0                       |

|                   |              |              |
|-------------------|--------------|--------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 2,408,642.68 | 6,828,219.90 |
|-------------------|--------------|--------------|

注：其他收益：未被统计进前列分类的损益类科目，主要包括投资于其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等产生的投资收益。

### 6.3 所有者权益变动表

金额单位：元

| 项目                                     | 本期<br>2020年01月01日至2020年12月31日      |                |               |
|----------------------------------------|------------------------------------|----------------|---------------|
|                                        | 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）                        | 37,432,964.55                      | -12,471,548.87 | 24,961,415.68 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0.00                               | 2,408,642.68   | 2,408,642.68  |
| 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）      | -11,699,850.01                     | 3,908,206.33   | -7,791,643.68 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 0.00                               | 0.00           | 0.00          |
| 2. 基金赎回款                               | -11,699,850.01                     | 3,908,206.33   | -7,791,643.68 |
| 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）                        | 25,733,114.54                      | -6,154,699.86  | 19,578,414.68 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019年01月01日至2019年12月31日 |                |               |
|                                        | 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）                        | 49,285,750.17                      | -24,678,027.52 | 24,607,722.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0.00                               | 6,828,219.90   | 6,828,219.90  |
| 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）      | -11,852,785.62                     | 5,378,258.75   | -6,474,526.87 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 0.00                               | 0.00           | 0.00          |
| 2. 基金赎回款                               | -11,852,785.62                     | 5,378,258.75   | -6,474,526.87 |
| 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                              | 37,432,964.55                      | -12,471,548.87 | 24,961,415.68 |

|        |  |  |  |
|--------|--|--|--|
| (基金净值) |  |  |  |
|--------|--|--|--|

## 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

| 项目                | 金额                  |
|-------------------|---------------------|
| 现金类资产             | 66030.83            |
| 银行存款              |                     |
| 股权投资              | 0                   |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资   |                     |
| 其中：优先股            | 0                   |
| 其他股权类投资           |                     |
| 上市公司定向增发投资        | 0                   |
| 上市公司定向增发股票投资      |                     |
| 新三板投资             | 0                   |
| 新三板挂牌企业投资         |                     |
| 境内证券投资规模          |                     |
| 结算备付金             | 0                   |
| 存出保证金             | 0                   |
| 股票投资              | 0                   |
| 债券投资              | 0                   |
| 其中：银行间市场债券        | 0                   |
| 其中：利率债            | 0                   |
| 其中：信用债            | 0                   |
| 资产支持证券            | 0                   |
| 基金投资（公募基金）        | 0                   |
| 其中：货币基金           | 0                   |
| 期货及衍生品交易保证金       | 0                   |
| 买入返售金融资产          | 0.00                |
| 其他证券类标的           |                     |
| 资管计划投资            |                     |
| 商业银行理财产品投资        |                     |
| 信托计划投资            |                     |
| 基金公司及其子公司资产管理计划投资 |                     |
| 保险资产管理计划投资        |                     |
| 证券公司及其子公司资产管理计划投资 |                     |
| 期货公司及其子公司资产管理计划投资 |                     |
| 私募基金产品投资          | S28115#19655168.95; |
| 未在协会备案的合伙企业份额     |                     |
| 另类投资              | 0                   |
| 另类投资              |                     |
| 境内债权类投资           |                     |
| 银行委托贷款规模          |                     |
| 信托贷款              |                     |
| 应收账款投资            |                     |
| 各类受（收）益权投资        |                     |
| 票据（承兑汇票等）投资       |                     |

|        |         |   |
|--------|---------|---|
|        | 其他债权投资  |   |
| 境外投资   | 境外投资    | 0 |
| 其他资产   | 其他资产    |   |
| 基金负债情况 | 债券回购总额  | 0 |
|        | 融资、融券总额 | 0 |
|        | 其中：融券总额 | 0 |
|        | 银行借款总额  |   |
|        | 其他融资总额  |   |

## 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<br>(%) |
|----|------------------|------|------------------|
| 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（如有）

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|------|-----------|------------------|
|------|-----------|------------------|

|         |      |      |
|---------|------|------|
| 能源      | 0.00 | 0.00 |
| 基础材料    | 0.00 | 0.00 |
| 工业      | 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 |
| 医疗保健    | 0.00 | 0.00 |
| 金融      | 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 |



