

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2012 第三季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25日

§1 重要提示
基金管理人长盛基金管理有限公司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2012年10月24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,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期内基金资产未发生计提。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛量化红利股票
基金主代码	080005
交易代码	080005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月25日
报告期末基金份额总额	266,087,317.25份
投资目标	本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标,并追求风险调整后的收益最大化,满足投资者长期稳健的投资需求。
投资策略	本基金通过严格的数量化投资组合选择方法生成红利风格股票池,在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合,从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中,大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境(市场估值水平、资金供求)等因素,股票投资中将红利投资策略作为主要,以价值衡量及分红能力作为选择投资对象的核心标准。
业绩比较基准	75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于较高风险、较高回报的基金产品。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-14,918,118.67
2.本期利润	-11,579,539.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0425
4.期末基金资产净值	218,457,078.83
5.期末基金份额净值	0.821

注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。
2.所列数据截至2012年9月30日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.2 本报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.87%	0.82%	-4.50%	0.85%	-0.37%	-0.03%

注:按照本基金合同约定,本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同约定的。截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同约定投资组合中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘斌	本基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛同辉深100等权重指数证券投资基金基金经理,长盛量化红利的基金经理	2009年11月25日	—	6年	男,1979年6月出生,中国国籍,清华大学工学学士,中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛成长价值证券投资基金基金经理等职务。现任长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理(本基金)基金经理,长盛同辉深100等权重指数证券投资基金基金经理。

注:1.上述基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定聘任日期和解聘日期;
2.证券从业年限"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项法律法规、长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同和其他有关规定,遵照诚实信用、勤勉尽责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发生。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:
研究支持:公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权利。
投资授权与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离制度。
交易执行:公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资行为:投资行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监控公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均遵守公平交易。
公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算胜率、贡献率、占比等指标,使用双向90%置信水平对1、3、5、15日的交易片段时间检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易之间,同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的交易共有12次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。
4.4 风控情况及时效分析
报告期内,本基金管理人严格执行了《2009年二季度以来基金、股票和债券市场均出现下探格局,市场表现持续呈高风险化、信息滞滞、政策疲弱、有色金属、医药生物、采掘等行业跌幅较大、交通运输、纺织服装、机械、房地产、商贸贸易、交运设备等行业跌幅较大。从风格角度看,低下行动率、低换手、高成长风格表现相对较好。

4.4.2 基金业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为0.821元,本报告期份额净值增长率为-4.87%,同期业绩比较基准增长率为-4.50%。

率为-4.50%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
未来2-3个季度经济仍处于需求收缩的通道中,经济环比持平略回升,4季度PPI和CPI都将温和回升,企业将出现一轮补库存。中长期看,中国经济将保持长期10%以上的持续高增长,进入以8%为中枢的窄幅波动区间,未来可能出现L型走势。当前的宏观经济形势,通胀水平温和持续回落,工业增加值底部徘徊;政策放松,以及需求降低的影响,流动性将进入逐渐宽松的通道。中期看,受益于流动性宽松以及经济缓慢回升,资本市场将重新进入缓慢上升的通道。

本基金采用数量化选股方法进行股票投资,按照红利价值型策略在价值层面深度挖掘,保持投资风格的长期稳定。

§5 投资组合报告

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	153,357,773.87	69.76
2	其中:股票	153,357,773.87	69.76
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:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	银行存款和结算备付金合计	65,923,815.75	29.99
10	其他资产	545,814.02	0.25
11	合计	219,827,403.64	100.00

§6 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	113,578.00	0.05
B	采掘业	6,075,241.79	2.78
C	制造业	77,886,889.32	35.65
CO	食品、饮料	17,808,428.09	8.15
C1	纺织、服装、皮毛	639,411.40	0.29
C2	木材、家具	120,870.00	0.06
C4	造纸、印刷	1,707,733.00	0.78
C5	化学、化学、塑胶、塑料	639,411.40	0.29
C6	金属、非金属	1,547,044.56	0.71
C7	机械、设备、仪表	23,315,388.69	10.67
C8	医药、生物制品	19,631,804.68	8.99
C99	其他制造业	610,900.00	0.28
D	电力、煤气及水的生产和供应业	307,802.00	0.14
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	12,480,376.87	5.71
G	信息技术业	11,931,403.32	5.46
H	批发和零售贸易	5,375,219.47	2.46
I	金融、保险业	26,475,265.88	12.12
J	房地产业	8,830,987.92	4.04
K	社会服务业	1,369,881.34	0.58
L	传播与文化行业	2,408,445.96	1.10
M	综合类	202,680.00	0.09
合计	—	153,357,773.87	70.20

§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	600016	民生银行	1,239,740	7,004,531.00	3.21
2	600000	浦发银行	750,000	5,535,000.00	2.53
3	000058	五粮液	156,042	5,289,823.80	2.42
4	601008	大秦铁路	760,000	4,636,000.00	2.12
5	600048	保利地产	417,352	4,490,703.52	2.06
6	600030	中信证券	369,781	4,359,717.99	2.00
7	601318	中国平安	103,000	4,319,820.00	1.98
8	600329	中新药业	380,000	4,233,200.00	1.94
9	000895	双汇发展	56,891	3,441,905.50	1.58
10	000002	万科A	404,500	3,409,935.00	1.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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 投资组合报告附注
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 声明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本基金的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。
5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	13,905.00
4	应收利息	12,531.08
5	应收申购款	19,377.04
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	545,814.02

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券。
5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
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。

§6 开放式基金份额变动

报告期初基金份额总额	275,687,906.41
报告期间基金总申购份额	1,819,490.48
减:报告期间基金总赎回份额	11,420,079.14
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
报告期末基金份额总额	266,087,317.75

§7 备查文件目录

1. 备查文件目录
2. 基金管理人:长盛基金管理有限公司
3. 基金托管人:中国工商银行股份有限公司
4. 长盛量化红利策略股票型证券投资基金招募说明书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 基金合同
8. 基金管理人业务资格批件、营业执照
9. 基金管理人业务资格批件、营业执照
10. 基金管理人业务资格批件、营业执照
11. 基金管理人业务资格批件、营业执照
12. 基金管理人业务资格批件、营业执照
13. 基金管理人业务资格批件、营业执照
14. 基金管理人业务资格批件、营业执照
15. 基金管理人业务资格批件、营业执照
16. 基金管理人业务资格批件、营业执照
17. 基金管理人业务资格批件、营业执照
18. 基金管理人业务资格批件、营业执照
19. 基金管理人业务资格批件、营业执照
20. 基金管理人业务资格批件、营业执照
21. 基金管理人业务资格批件、营业执照
22. 基金管理人业务资格批件、营业执照
23. 基金管理人业务资格批件、营业执照
24. 基金管理人业务资格批件、营业执照
25. 基金管理人业务资格批件、营业执照
26. 基金管理人业务资格批件、营业执照
27. 基金管理人业务资格批件、营业执照
28. 基金管理人业务资格批件、营业执照
29. 基金管理人业务资格批件、营业执照
30. 基金管理人业务资格批件、营业执照
31. 基金管理人业务资格批件、营业执照
32. 基金管理人业务资格批件、营业执照
33. 基金管理人业务资格批件、营业执照
34. 基金管理人业务资格批件、营业执照
35. 基金管理人业务资格批件、营业执照
36. 基金管理人业务资格批件、营业执照
37. 基金管理人业务资格批件、营业执照
38. 基金管理人业务资格批件、营业执照
39. 基金管理人业务资格批件、营业执照
40. 基金管理人业务资格批件、营业执照
41. 基金管理人业务资格批件、营业执照
42. 基金管理人业务资格批件、营业执照
43. 基金管理人业务资格批件、营业执照
44. 基金管理人业务资格批件、营业执照
45. 基金管理人业务资格批件、营业执照
46. 基金管理人业务资格批件、营业执照
47. 基金管理人业务资格批件、营业执照
48. 基金管理人业务资格批件、营业执照
49. 基金管理人业务资格批件、营业执照
50. 基金管理人业务资格批件、营业执照
51. 基金管理人业务资格批件、营业执照
52. 基金管理人业务资格批件、营业执照
53. 基金管理人业务资格批件、营业执照
54. 基金管理人业务资格批件、营业执照
55. 基金管理人业务资格批件、营业执照
56. 基金管理人业务资格批件、营业执照
57. 基金管理人业务资格批件、营业执照
58. 基金管理人业务资格批件、营业执照
59. 基金管理人业务资格批件、营业执照
60. 基金管理人业务资格批件、营业执照
61. 基金管理人业务资格批件、营业执照
62. 基金管理人业务资格批件、营业执照
63. 基金管理人业务资格批件、营业执照
64. 基金管理人业务资格批件、营业执照
65. 基金管理人业务资格批件、营业执照
66. 基金管理人业务资格批件、营业执照
67. 基金管理人业务资格批件、营业执照
68. 基金管理人业务资格批件、营业执照
69. 基金管理人业务资格批件、营业执照
70. 基金管理人业务资格批件、营业执照
71. 基金管理人业务资格批件、营业执照
72. 基金管理人业务资格批件、营业执照
73. 基金管理人业务资格批件、营业执照
74. 基金管理人业务资格批件、营业执照
75. 基金管理人业务资格批件、营业执照
76. 基金管理人业务资格批件、营业执照
77. 基金管理人业务资格批件、营业执照
78. 基金管理人业务资格批件、营业执照
79. 基金管理人业务资格批件、营业执照
80. 基金管理人业务资格批件、营业执照
81. 基金管理人业务资格批件、营业执照
82. 基金管理人业务资格批件、营业执照
83. 基金管理人业务资格批件、营业执照
84. 基金管理人业务资格批件、营业执照
85. 基金管理人业务资格批件、营业执照
86. 基金管理人业务资格批件、营业执照
87. 基金管理人业务资格批件、营业执照
88. 基金管理人业务资格批件、营业执照
89. 基金管理人业务资格批件、营业执照
90. 基金管理人业务资格批件、营业执照
91. 基金管理人业务资格批件、营业执照
92. 基金管理人业务资格批件、营业执照
93. 基金管理人业务资格批件、营业执照
94. 基金管理人业务资格批件、营业执照
95. 基金管理人业务资格批件、营业执照
96. 基金管理人业务资格批件、营业执照
97. 基金管理人业务资格批件、营业执照
98. 基金管理人业务资格批件、营业执照
99. 基金管理人业务资格批件、营业执照
100. 基金管理人业务资格批件、营业执照

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

2012 第三季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25日

基金管理人长盛基金管理有限公司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2012年10月24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,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本报告期内基金资产未发生计提。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§1 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券
基金主代码	510080
交易代码	510080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月25日
报告期末基金份额总额	271,187,265.14份
投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略,对各类资产进行合理配置,通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合收益。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§2 主要财务指标和基金净值表现

2.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-9,030,242.34
2.本期利润	-9,399,445.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0338
4.期末基金份额净值	298,751,854.45
5.期末基金份额净值	1.0106

注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。
2.所列数据截至2012年9月30日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.2 本报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.95%	0.24%	-4.54%	0.10%	-2.50%	0.14%

注:按照本基金合同约定,本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同约定的。截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同约定投资组合中规定的各项比例。

§3 管理人报告

3.1基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
梁婷	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛稳健回报债券基金基金经理,长盛中证100指数证券投资基金基金经理	2011年2月15日	—	12年	女,1975年6月出生,中国国籍,中国社会科学院研究生院经济学博士,曾任中国对外经济贸易信托投资公司投资银行部项目经理;2000年10月加入长盛基金管理有限公司,先后担任产品设计经理、社保组合基金经理、固定收益研究员、社保组合基金经理助理、社保组合经理、现任社保组合基金经理助理,社保组合基金经理。长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同辉深100等权重指数证券投资基金基金经理。

注:1.上述基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定聘任日期和解聘日期;
2.证券从业年限"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项法律法规、长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同和其他有关规定,遵照诚实信用、勤勉尽责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发生。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:
研究支持:公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权利。
投资授权与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离制度。
交易执行:公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资行为:投资行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监控公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均遵守公平交易。
公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算胜率、贡献率、占比等指标,使用双向90%置信水平对1、3、5、15日的交易片段时间检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易之间,同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的交易共有12次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。
4.4 风控情况及时效分析
报告期内,本基金管理人严格执行了《2009年二季度以来基金、股票和债券市场均出现下探格局,市场表现持续呈高风险化、信息滞滞、政策疲弱、有色金属、医药生物、采掘等行业跌幅较大、交通运输、纺织服装、机械、房地产、商贸贸易、交运设备等行业跌幅较大。从风格角度看,低下行动率、低换手、高成长风格表现相对较好。

4.4.2 基金业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.0106元,本报告期份额净值增长率为-2.95%,同期业绩比较基准增长率为-4.54%。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。
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 投资组合报告附注
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 声明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本基金的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。
5.8.3 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,279,036.76	1.65
2	其中:股票	7,279,036.76	1.65
3	固定收益投资	388,026,459.70	87.70
4	其中:债券	378,026,459.70	85.44
5	资产支持证券	10,000,000.00	2.26

§4 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	1,233,748.32	0.15
B	采掘业	93,609,438.78	11.34
C	制造业	208,734,097.30	25.39
CO	食品、饮料	68,260,482.80	8.27
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,913,122.32	1.08
C5	电子	2,848,950.72	0.35
C6	金属、非金属	48,895,511.79	5.92
C7	机械、设备、仪表	71,935,534.20	8.72
C8	医药、生物制品	7,591,231.47	0.92
C99	其他制造业	289,264.00	0.0