

## 久嘉证券投资基金

## 【2013】第三季度报告

基金管理人:长城基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示  
本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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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。

本报告中所载资料未经审计。  
本报告自2013年07月01日起至09月30日止。

| § 2 基金产品概况 |                   |            |
|------------|-------------------|------------|
| 基金简称       | 长城久嘉封闭            | 基金久嘉(场内简称) |
| 交易代码       | 184722            |            |
| 基金主代码      | 184722            |            |
| 基金运作方式     | 契约型封闭式            |            |
| 基金合同生效日    | 2002年7月5日         |            |
| 报告期末基金份额总额 | 2,000,000,000.00份 |            |

为投资减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求长期稳定的收益。

根据中国证券市场的特点,本基金将极其注重对市场整体趋势的把握,重视对投资的市场时机选择。本基金将注重研判与挖掘不同类别投资市场的整体风险与收益,在不同类别资产和基金资产中投资,债券、现金的分配比例对股票的投资。本基金将采取有效的积极的操作策略。本基金将在对国家宏观经济政策、行业发展方向及动态、上市公司内在价值深入研究的基础上,根据不同上市公司股票的市场流动性、市场集中度及风险收益结构构建投资组合。我们将根据对市场发展的不同阶段的判断与把握,上市公司本身的发展态势及二级市场价格走势适时调整个股及股票组合在整个基金资产的比例以获取收益及控制风险。

业绩比较基准  
选取上证A股指数为业绩比较基准。  
中性的风险偏好,力争实现年度内基金单位资产净值在市場下跌时跌幅不高于比较基准跌幅的60%,在市場上涨时增幅不低于比较基准的70%。  
长城基金管理有限公司  
基金托管人  
中国农业银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

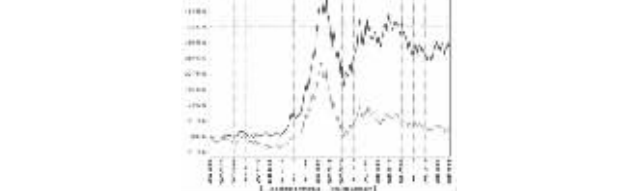
| 3.1 主要财务指标     |                           |  | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|--|---------|
| 主要财务指标         | 报告期(2013年7月1日—2013年9月30日) |  |         |
| 1.本期已实现收益      | 27,454,731.66             |  |         |
| 2.本期利润         | 119,631,686.95            |  |         |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0598                    |  |         |
| 4.期末基金资产净值     | 1,765,646,820.11          |  |         |
| 5.期末基金份额净值     | 0.8828                    |  |         |

注:①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。  
②上述基金业绩指标不包括持有入交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

| 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③ | 业绩比较基准标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|--------|-----------|-----------|------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 7.27%  | 1.04%     | 9.90%     | 1.98%      | -2.63% | -0.94% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同约定:①本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,本基金投资于国债债券的比例不低于本基金资产净值的20%。

### 4.1 基金经理 魏基经小组 简介

| 姓名  | 职务                             | 任本基金基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--------------------------------|------------|--------|-----|
|     |                                | 任职日期       | 离任日期   |     |
| 魏基经 | 基金久嘉、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2012年3月7日  | -      | 15年 |

4.2 基金经理的从业经历  
注:①上述任职日期,指任日期根据公司公告做出的决定之任日期。  
②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。  
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资组合的利益得到了公平对待。  
4.3.2 异常交易行为的专项说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资组合的利益得到了公平对待。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责导致财产不当导致基金资产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 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、渔业        |      | 21,090,726.00    | 1.19         |
| B 采矿业             |      | 27,883,288.50    | 1.58         |
| C 制造业             |      | 614,659,987.71   | 34.81        |
| D 电力、热力、燃气及生产和供应业 |      | -                | -            |
| E 建筑业             |      | 15,817,144.00    | 0.90         |
| F 批发和零售业          |      | 76,590,202.32    | 4.34         |
| G 交通运输、仓储和邮政业     |      | -                | -            |
| H 住宿和餐饮业          |      | -                | -            |
| I 信息传输、软件和信息技术服务业 |      | 105,898,258.49   | 6.00         |
| J 金融业             |      | 209,349,157.83   | 11.86        |
| K 房地产业            |      | 52,041,695.14    | 2.95         |
| L 租赁和商务服务业        |      | 45,598,868.62    | 2.58         |
| M 科学研究和技术服务业      |      | 11,303,519.58    | 0.64         |
| N 水利、环境和公共设施管理业   |      | 17,400,000.00    | 0.99         |
| O 居民服务、修理和其他服务业   |      | -                | -            |
| P 教育              |      | -                | -            |
| Q 卫生和社会工作         |      | -                | -            |
| R 文化、体育和娱乐业       |      | -                | -            |
| S 综合              |      | -                | -            |
| 合计                |      | 1,197,632,848.19 | 67.83        |

### 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  | 601166 | 兴业银行 | 7,625,000 | 85,171,250.00 | 4.82         |
| 2  | 600406 | 国电南瑞 | 5,825,014 | 84,171,432.30 | 4.77         |
| 3  | 601169 | 北京银行 | 6,500,000 | 52,455,000.00 | 2.97         |
| 4  | 002035 | 华信股份 | 4,339,099 | 49,475,088.60 | 2.80         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 362,202   | 49,237,739.88 | 2.79         |
| 6  | 600138 | 中青旅  | 2,710,991 | 45,598,868.62 | 2.58         |
| 7  | 601126 | 四方股份 | 2,365,926 | 43,438,401.36 | 2.46         |
| 8  | 300079 | 数码视讯 | 1,443,717 | 38,599,560.69 | 2.17         |
| 9  | 600066 | 宇通客车 | 1,984,531 | 36,515,370.40 | 2.07         |
| 10 | 600690 | 青岛海尔 | 2,538,900 | 33,818,148.00 | 1.92         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种    | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------------|--------------|
| 1  | 国债债券    | -              | -            |
| 2  | 央行票据    | -              | -            |
| 3  | 金融债券    | 386,113,000.00 | 21.87        |
| 4  | 企业债券    | 386,113,000.00 | 21.87        |
| 5  | 企业短期融资券 | -              | -            |
| 6  | 中期票据    | -              | -            |
| 7  | 可转债     | -              | -            |
| 8  | 其他      | -              | -            |
| 9  | 合计      | 386,113,000.00 | 21.87        |

### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 100230 | 国债03   | 1,000,000 | 99,330,000.00 | 5.63         |
| 2  | 110407 | 11农交07 | 1,000,000 | 98,490,000.00 | 5.58         |
| 3  | 110212 | 11国开12 | 900,000   | 88,857,000.00 | 5.03         |
| 4  | 100236 | 10国开36 | 700,000   | 69,475,000.00 | 3.93         |
| 5  | 130232 | 13国开36 | 300,000   | 29,961,000.00 | 1.70         |

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  
注: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  
注: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  
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金股指期货投资的投资政策  
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
5.9.1 本期国债期货投资政策  
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
注:本基金本报告期末未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价  
注:本基金本报告期末未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注  
5.10.1  
本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 291,271.62   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收利息    | -            |
| 4  | 应收股利    | 3,317,947.08 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,609,218.70 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于