

(上接B006版)

本基金构建和管理信用债券投资组合时主要考虑以下因素：
①信用评级与评级变化的变化。
②不同信用等级信用债券，以及同一信用等级不同标的的债券之间的信用评级变化。
③资产支持证券 资产收益计划 投资策略
本基金将通过宏观研究、提前还款率、资产违约情况及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款、预测提前偿付率变化对标的的久期与收益的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益的影响。
④运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究流动性管理，选择风险调整后的收益最高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
7 同转换债券投资策略
可转换债券属于介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征。本基金对于可转换债券特性的研究将完全集中于公司投资团队对标的股票的研究，在此基础上量化投资部分利用可转换债券定价模型，充分分析转债发行后目标转债转股对股票股价波动率可能出现的反应，对目标转债的发行进行合理定价。
对于本基金可转换债券特性的研究，将借鉴公司信用债券信用评级指标体系，对可转换债券的发行主体及标的债券的信用评级进行，并在信用评级的基础上为其进行合理定价。
通过对标的转债股性与伦理性的合理定价，力求寻找被市场低估的品种，构建本基金可转换债券的投资组合。

3. 股票投资策略
0 前瞻投资策略
本基金将通过分析影响股票一级市场资金面的相关市场风险收益特征的变化、股票发行政策取向 如“容”容条、发行市盈率与二级市场市盈率的差距、预期新股一级市场供求关系的变化，并据此进一步预测新股发行节奏和新的收益增长点趋势。同时，借助公司投资团队研究，对新股发行节奏、预期新股发行收益率进行预测，确定合理规模的资金后精选个股进行申购，并与其可上市交易或流通受限解禁后，在控制组合波动性的前提下根据对市场 and 个股的判断选择合适的时机出售，以期提升基金的收益水平。
0 股票二级市场投资策略
本基金主要运用交银施罗德股票研究分析方法等投资分析工具，在把握宏观经济运行趋势和股票市场行情走势的基础上，充分利用公司投资团队对行业“自下而上”的主动选股能力，与具有良好增长前景的行业中精选具有投资潜力的股票构建投资组合。具体分以下两个层次进行股票挑选：
0 行业选择和配置
国民经济快速增长的背后蕴涵了不同行业对GDP增长贡献率的差异，而不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构因素的影响将表现在不同时期表现存在具有明显差异。本基金将挑选具有良好增长前景的行业进行重点投资。
本基金管理采用多因素的定性定量相结合的分析法和预测方法，确定宏观及行业经济变量变动对不同类型的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资机会，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会。

0 个股精选
本基金在前述行业优选的基础上，根据下述标准挑选出其中具有投资潜力的上市公司构建股票组合并从中筛选个股。公司股票池的股票投资评级必须在3级（含3级）以上，且满足以下要求：
① 主营业务清晰并在产品、技术、营销、营运、成本控制等某一方面具有较强竞争优势，销售收入或利润超过行业平均水平；
② 商业模式特点主要清晰，行业发展环境良好；
③ 具有较明确可预期的盈利增长前景；
④ 盈利质量较高，经营性现金流加投资收益应该超过净利润（特殊理由除外）；
⑤ 较好的公司治理结构，财务报表和信息披露较为透明、规范。
0 股票估值具有吸引力，或符合一定时期内的投资主题，可现价买入。
4. 权证投资策略
本基金的投资权证以投资标的的市场价值为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动性的科学投资管理手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征以选择权证的买入时机，追求稳定的当期收益。

九. 基金的业绩比较标准
本基金的整体业绩比较基准采用：
中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
如果上述基金业绩比较基准指数发生重大变更，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且能够更好表征本基金风险收益特征的数据，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

十. 基金的风险收益特征
本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十一. 基金投资组合报告
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法律责任。
本基金经理人中国建设银行根据本基金合同规定，于2013年7月18日提交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。
本报告期内于2013年4月1日至2013年6月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

1. 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)
1 权益投资 68,216,645.00 10.77
其中：股票 68,216,645.00 10.77
2 固定收益投资 522,047,000.15 82.43
其中：债券 522,047,000.15 82.43
资产支持证券 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -
其中：买入返售金融资产 - -
5 其他资产 24,566,342.21 3.88
其中：应收利息 506,481.92 0.29
6 合计 633,366,469.28 100.00

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、渔业 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 46,886,365.00 13.52
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -
E 建筑业 2,977,200.00 0.86
F 批发和零售业 2,143,200.00 0.62
G 交通运输、仓储和邮政业 - -
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息、软件和信息技术服务业 1,843,700.00 0.39
J 金融业 7,177,600.00 2.51
K 房地产业 1,777,500.00 0.51
L 租赁和商务服务业 - -
M 批发和零售业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 4,370,880.00 1.26
O 居民服务、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和医药工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 - -
S 综合 - -
合计 68,216,645.00 19.66

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 002079 苏州园林 1,700,000 7,582,000.00 2.19
2 600703 三爱富 250,000 6,874,000.00 1.98
3 600596 新安股份 553,200 5,836,260.00 1.68
4 000049 盛润电子 196,869 5,392,140.00 1.55
5 000223 荣利股份 126,000 5,260,480.00 1.52
6 300070 中国重汽 116,000 4,370,880.00 1.26
7 601318 中国平安 136,000 4,171,200.00 1.20
8 000100 TCL 集团 1,500,000 3,405,000.00 0.98
9 600422 中江地产 116,000 3,074,000.00 0.89
10 002140 东信软件 120,000 2,977,200.00 0.86

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 19,886,000.00 5.73
2 央行票据 19,886,000.00 5.73
3 金融债 216,044,700.00 62.42
4 企业债 30,990,000.00 8.93
5 中期票据 254,526,300.15 73.37
6 可转债 - -
7 合计 522,047,000.15 150.48

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转股投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 111003 重庆钢铁 308,000 33,670,560.00 9.71
2 110015 石化转债 268,000 26,751,760.00 7.71
3 110016 川投转债 210,000 25,768,000.00 7.51
4 110013 川投转债 24,200,700.00 6.98
5 110020 南化转债 22,979,300.00 6.62
6 110018 南化转债 21,496,000.00 6.20
7 110022 石化转债 16,643,000.00 4.75
8 110022 石化转债 15,586,650.00 4.49
9 113001 中广核转债 10,811,880.00 3.12
10 110012 惠誉转债 10,252,760.00 2.96
11 110017 中广核转债 7,442,614.20 2.15
12 110011 中广核转债 6,839,000.00 1.97
13 127001 惠誉转债 3,353,430.00 0.97
14 110007 中广核转债 3,127,000.00 0.90
15 125089 惠誉转债 2,430,000.00 0.66
16 110010 恒泰转债 1,056,380.80 0.30
17 121887 中广核转债 781,991.49 0.23

6. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。
7. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
8. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
9. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
10. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
11. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
12. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
13. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
14. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
15. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
16. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
17. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
18. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
19. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
20. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
21. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
22. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
23. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
24. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
25. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
26. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
27. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
28. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
29. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
30. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
31. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
32. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
33. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
34. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
35. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
36. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
37. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
38. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
39. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
40. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
41. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
42. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
43. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
44. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
45. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
46. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
47. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
48. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
49. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
50. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
51. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
52. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
53. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
54. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
55. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
56. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
57. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
58. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
59. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
60. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
61. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
62. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
63. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
64. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
65. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
66. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
67. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
68. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
69. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
70. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
71. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
72. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
73. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
74. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
75. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
76. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
77. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
78. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
79. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
80. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
81. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
82. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
83. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
84. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
85. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
86. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
87. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
88. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
89. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
90. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
91. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
92. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
93. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
94. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
95. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
96. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
97. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
98. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
99. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
100. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况

1. 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)
1 权益投资 68,216,645.00 10.77
其中：股票 68,216,645.00 10.77
2 固定收益投资 522,047,000.15 82.43
其中：债券 522,047,000.15 82.43
资产支持证券 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -
其中：买入返售金融资产 - -
5 其他资产 24,566,342.21 3.88
其中：应收利息 506,481.92 0.29
6 合计 633,366,469.28 100.00

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、渔业 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 46,886,365.00 13.52
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -
E 建筑业 2,977,200.00 0.86
F 批发和零售业 2,143,200.00 0.62
G 交通运输、仓储和邮政业 - -
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息、软件和信息技术服务业 1,843,700.00 0.39
J 金融业 7,177,600.00 2.51
K 房地产业 1,777,500.00 0.51
L 租赁和商务服务业 - -
M 批发和零售业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 4,370,880.00 1.26
O 居民服务、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和医药工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 - -
S 综合 - -
合计 68,216,645.00 19.66

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 002079 苏州园林 1,700,000 7,582,000.00 2.19
2 600703 三爱富 250,000 6,874,000.00 1.98
3 600596 新安股份 553,200 5,836,260.00 1.68
4 000049 盛润电子 196,869 5,392,140.00 1.55
5 000223 荣利股份 126,000 5,260,480.00 1.52
6 300070 中国重汽 116,000 4,370,880.00 1.26
7 601318 中国平安 136,000 4,171,200.00 1.20
8 000100 TCL 集团 1,500,000 3,405,000.00 0.98
9 600422 中江地产 116,000 3,074,000.00 0.89
10 002140 东信软件 120,000 2,977,200.00 0.86

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 19,886,000.00 5.73
2 央行票据 19,886,000.00 5.73
3 金融债 216,044,700.00 62.42
4 企业债 30,990,000.00 8.93
5 中期票据 254,526,300.15 73.37
6 可转债 - -
7 合计 522,047,000.15 150.48

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转股投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 111003 重庆钢铁 308,000 33,670,560.00 9.71
2 110015 石化转债 268,000 26,751,760.00 7.71
3 110016 川投转债 210,000 25,768,000.00 7.51
4 110013 川投转债 24,200,700.00 6.98
5 110020 南化转债 22,979,300.00 6.62
6 110018 南化转债 21,496,000.00 6.20
7 110022 石化转债 16,643,000.00 4.75
8 110022 石化转债 15,586,650.00 4.49
9 113001 中广核转债 10,811,880.00 3.12
10 110012 惠誉转债 10,252,760.00 2.96
11 110017 中广核转债 7,442,614.20 2.15
12 110011 中广核转债 6,839,000.00 1.97
13 127001 惠誉转债 3,353,430.00 0.97
14 110007 中广核转债 3,127,000.00 0.90
15 125089 惠誉转债 2,430,000.00 0.66
16 110010 恒泰转债 1,056,380.80 0.30
17 121887 中广核转债 781,991.49 0.23

6. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。
7. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
8. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
9. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
10. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
11. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
12. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
13. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
14. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
15. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
16. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
17. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
18. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
19. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
20. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
21. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
22. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
23. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
24. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
25. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
26. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
27. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
28. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
29. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
30. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
31. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
32. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
33. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
34. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
35. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
36. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
37. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
38. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
39. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
40. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
41. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
42. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
43. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
44. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
45. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
46. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
47. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
48. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
49. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
50. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
51. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
52. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
53. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
54. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
55. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
56. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
57. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
58. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
59. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
60. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
61. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
62. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
63. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
64. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
65. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
66. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
67. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
68. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
69. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
70. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
71. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
72. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
73. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
74. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
75. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
76. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
77. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
78. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
79. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
80. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
81. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
82. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
83. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
84. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
85. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
86. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
87. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
88. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
89. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
90. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
91. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
92. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
93. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
94. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
95. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
96. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
97. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
98. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
99. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
100. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况

1. 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)
1 权益投资 68,216,645.00 10.77
其中：股票 68,216,645.00 10.77
2 固定收益投资 522,047,000.15 82.43
其中：债券 522,047,000.15 82.43
资产支持证券 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -
其中：买入返售金融资产 - -
5 其他资产 24,566,342.21 3.88
其中：应收利息 506,481.92 0.29
6 合计 633,366,469.28 100.00

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、渔业 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 46,886,365.00 13.52
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -
E 建筑业 2,977,200.00 0.86
F 批发和零售业 2,143,200.00 0.62
G 交通运输、仓储和邮政业 - -
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息、软件和信息技术服务业 1,843,700.00 0.39
J 金融业 7,177,600.00 2.51
K 房地产业 1,777,500.00 0.51
L 租赁和商务服务业 - -
M 批发和零售业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 4,370,880.00 1.26
O 居民服务、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和医药工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 - -
S 综合 - -
合计 68,216,645.00 19.66

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 002079 苏州园林 1,700,000 7,582,000.00 2.19
2 600703 三爱富 250,000 6,874,000.00 1.98
3 600596 新安股份 553,200 5,836,260.00 1.68
4 000049 盛润电子 196,869 5,392,140.00 1.55
5 000223 荣利股份 126,000 5,260,480.00 1.52
6 300070 中国重汽 116,000 4,370,880.00 1.26
7 601318 中国平安 136,000 4,171,200.00 1.20
8 000100 TCL 集团 1,500,000 3,405,000.00 0.98
9 600422 中江地产 116,000 3,074,000.00 0.89
10 002140 东信软件 120,000 2,977,200.00 0.86

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 19,886,000.00 5.73
2 央行票据 19,886,000.00 5.73
3 金融债 216,044,700.00 62.42
4 企业债 30,990,000.00 8.93
5 中期票据 254,526,300.15 73.37
6 可转债 - -
7 合计 522,047,000.15 150.48

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转股投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 111003 重庆钢铁 308,000 33,670,560.00 9.71
2 110015 石化转债 268,000 26,751,760.00 7.71
3 110016 川投转债 210,000 25,768,000.00 7.51
4 110013 川投转债 24,200,700.00 6.98
5 110020 南化转债 22,979,300.00 6.62
6 110018 南化转债 21,496,000.00 6.20
7 110022 石化转债 16,643,000.00 4.75
8 110022 石化转债 15,586,650.00 4.49
9 113001 中广核转债 10,811,880.00 3.12
10 110012 惠誉转债 10,252,760.00 2.96
11 110017 中广核转债 7,442,614.20 2.15
12 110011 中广核转债 6,839,000.00 1.97
13 127001 惠誉转债 3,353,430.00 0.97
14 110007 中广核转债 3,127,000.00 0.90
15 125089 惠誉转债 2,430,000.00 0.66
16 110010 恒泰转债 1,056,380.80 0.30
17 121887 中广核转债 781,991.49 0.23

6. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。
7. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
8. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
9. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
10. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
11. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
12. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
13. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
14. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
15. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
16. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
17. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
18. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
19. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
20. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
21. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
22. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
23. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
24. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
25. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
26. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
27. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
28. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
29. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
30. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
31. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
32. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
33. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
34. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
35. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
36. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
37. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
38. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
39. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
40. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
41. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
42. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
43. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
44. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
45. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
46. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
47. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
48. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
49. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
50. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
51. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
52. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
53. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
54. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
55. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
56. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
57. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
58. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
59. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
60. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
61. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
62. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
63. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
64. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
65. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
66. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
67. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
68. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
69. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
70. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
71. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
72. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
73. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
74. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
75. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
76. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
77. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
78. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
79. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
80. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
81. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
82. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
83. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
84. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
85. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
86. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
87. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
88. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
89. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
90. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
91. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
92. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
93. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
94. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
95. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
96. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
97. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
98. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
99. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况
100. 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况

2 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。

十二. 基金的费用与税收
基金业绩截止日为2013年6月30日，所载财务数据未经审计师审计。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有投资，投资者在做投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 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② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-③
A/B类 2013年度(自2013年1月1日至2013年12月31日)
过去三个月 1.93% 0.83% -1.08% 0.20% -0.85% 0.63%
2013年度(自2013年1月1日至2013年12月31日)
过去三个月 5.59% 0.76% -0.51% 0.18% 6.10% 0.58%
2013年度(自2013年1月1日至2013年12月31日)
过去三个月 9.37% 0.40% 1.25% 0.13% 8.12% 0.27%
C类 2013年度(自2013年1月1日至2013年12月31日)
过去三个月 -2.04% 0.84% -1.08% 0.20% -0.96% 0.64%
2013年度(自2013年1月1日至2013年12月31日)
过去三个月 5.44% 0.76% -0.51% 0.18% 5.95% 0.58%
2013年度(自2013年1月1日至2013年12月31日)
过去三个月 8.66% 0.40% 1.25% 0.13% 7.41% 0.27%

2. 自基金建仓以来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变动的比较
交银施罗德永利债券证券投资基金
份额累计