

(上接B086版)
(六)业绩比较基准
本基金业绩比较基准为每个保本周期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。
本基金为保本混合型基金,保本期为三年,保本但不保证收益。在目前国内金融环境下,银行定期存款类似于保本理财产品,因此,本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,可以合理的衡量本基金保本的有效性,能够客观、理性地评价本基金的风险收益特征。
如果今后市场出现更合适用于本基金业绩比较的指数时,本基金管理人可以与基金托管人协商一致,并经中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
(七)风险收益特征
本基金属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于股票基金和一般混合基金。
(八)投资策略
1.组合策略
本基金在投资策略上兼顾投资回报以及开放式基金的流动性特点,通过将分散投资降低非系统性风险,保持基金组合良好的流动性,基金的投资组合将遵循以下限制:
(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该证券的10%;
(5)本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
(6)本基金在保本期内投资稳健资产占基金资产的比例不低于60%,投资风险资产占基金资产的比例不得超过40%;
(7)本基金投资同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(8)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(11)本基金仅投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。
(12)基金财产中投资于股票资产,本基金申购的金额不超过本基金总资产,本基金所持有的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。
(13)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%。
(14)保持不低于基金资产净值8%的现金或到期日在一年以内的政府债券;
(15)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。
(16)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资比例限制。
如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金可不再受相关限制。
2.资产配置策略
本基金在资产配置上,上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人以外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。
本基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。过渡期间,本基金进入下一个保本期的,基金管理人应当自基金合同到期前30个工作日内使基金投资组合比例符合基金合同的约定,但保本期内投资的比例,基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日开始。

2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或者提供担保;
(3)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(4)从事其他法律及中国证监会禁止的行为。
(五)基金管理人代表基金股东的权利和职责
1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益;
(六)对涉及上市公司控股、不参予所投资上市公司的经营管理;
(七)有利于基金财产的安全与增值;
(八)通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的人第三人牟取任何不当利益。
(十)基金的投资、融券
本基金可以按照国家有关规定进行融资融券。
(十一)基金的投资、融券
本基金投资报告所载数据截至2013年12月31日。
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	46,378.00	0.01
2	其中:股票	46,378.00	0.01
3	固定收益投资	486,294,000.00	84.41
4	其中:债券	486,294,000.00	84.41
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	14,000,000.00	2.43
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	现金类资产	-	-
10	存出保证金和结算备付金	64,735,933.78	11.23
11	其他资产	11,022,748.38	1.91
12	合计	576,199,060.16	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	医药、生物、化学	-	-
2	采矿业	2,232.00	0.00
3	制造业	34,884.00	0.01
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
5	建筑业	-	-
6	交通运输、仓储业	-	-
7	信息传输、软件和信息技术服务业	8,163.00	0.00
8	金融业	-	-
9	房地产业	-	-
10	租赁和商务服务业	-	-
11	科学研究和技术服务业	-	-
12	水利、环境和公共设施管理业	-	-
13	批发和零售业	-	-
14	住宿和餐饮业	-	-
15	教育	-	-
16	卫生和社公事业	-	-
17	文化、体育和娱乐业	-	-
18	综合	1,097.00	0.00
19	合计	46,378.00	0.01

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组合明细

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	000333	隆基股份	100	5,009,000.00	0.00
2	002230	科大讯飞	100	4,785.00	0.00
3	030895	东安发展	100	4,780.00	0.00
4	002065	东安汽车	100	3,380.00	0.00
5	300119	瑞普生物	100	2,542.00	0.00
6	603522	新亚药业	100	2,296.00	0.00
7	601088	中国通海	100	2,232.00	0.00
8	002280	华信科技	100	2,099.00	0.00
9	600271	航天信息	100	2,017.00	0.00
10	600512	康强电子	100	1,919.00	0.00

4.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组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	29,727,000.00	5.25	-
2	央行票据	-	-	-	-
3	金融债券	-	135,108,000.00	23.88	-
4	其中:政策性金融债	-	135,108,000.00	23.88	-
5	企业债券	-	282,179,000.00	49.88	-
6	中期票据	-	39,380,000.00	6.96	-
7	待偿资产	-	-	-	-
8	其他	-	-	-	-
9	合计	-	486,294,000.00	85.96	-

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组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130212	13国债12	1,000,000	98,300,000.00	17.38
2	128007	12国债07	400,000	39,630,000.00	7.01
3	128257	MTN2	400,000	39,380,000.00	6.96
4	125313	12国债31	400,000	39,200,000.00	6.93
5	130240	13国债40	400,000	36,800,000.00	6.51

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金报告期末未持有权证。

8.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

本基金报告期末未持有权证。

9.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

本基金报告期末未持有权证。

10.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

本基金报告期末未持有权证。

11.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

本基金报告期末未持有权证。

12.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

本基金报告期末未持有权证。

13.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

本基金报告期末未持有权证。

14.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

本基金报告期末未持有权证。

15.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

本基金报告期末未持有权证。

16.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

本基金报告期末未持有权证。

17.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

本基金报告期末未持有权证。

18.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

本基金报告期末未持有权证。

19.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

本基金报告期末未持有权证。

20.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

本基金报告期末未持有权证。

21.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

本基金报告期末未持有权证。

22.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

本基金报告期末未持有权证。

23.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

本基金报告期末未持有权证。

24.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

本基金报告期末未持有权证。

25.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

本基金报告期末未持有权证。

26.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

本基金报告期末未持有权证。

27.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

本基金报告期末未持有权证。

28.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

本基金报告期末未持有权证。

29.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

本基金报告期末未持有权证。

30.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

本基金报告期末未持有权证。

31.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

本基金报告期末未持有权证。

32.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

本基金报告期末未持有权证。

33.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

本基金报告期末未持有权证。

34.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

本基金报告期末未持有权证。

35.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

本基金报告期末未持有权证。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、化学	-	-
B	采矿业	2,232.00	0.00
C	制造业	34,884.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息传输、软件和信息技术服务业	8,163.00	0.00
H	金融业	-	-
I	房地产业	-	-
J	租赁和商务服务业	-	-
K	科学研究和技术服务业	-	-
L	水利、环境和公共设施管理业	-	-
M	批发和零售业	-	-
N	住宿和餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社公事业	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	1,097.00	0.00
S	合计	46,378.00	0.01

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组合

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	000333	隆基股份	100	5,009,000.00	0.00
2	002230	科大讯飞	100	4,785.00	0.00
3	030895	东安发展	100	4,780.00	0.00
4	002065	东安汽车	100	3,380.00	0.00
5	300119	瑞普生物	100	2,542.00	0.00
6	603522	新亚药业	100	2,296.00	0.00
7	601088	中国通海	100	2,232.00	0.00
8	002280	华信科技	100	2,099.00	0.00
9	600271	航天信息	100	2,017.00	0.00
10	600512	康强电子	100	1,919.00	0.00

4.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组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	29,727,000.00	5.25	-
2	央行票据	-	-	-	-
3	金融债券	-	135,108,000.00	23.88	-
4	其中:政策性金融债	-	135,108,000.00	23.88	-
5	企业债券	-	282,179,000.00	49.88	-
6	中期票据	-	39,380,000.00	6.96	-
7	待偿资产	-	-	-	-
8	其他	-	-	-	-
9	合计	-	486,294,000.00	85.96	-

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组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130212	13国债12	1,000,000	98,300,000.00	17.38
2	128007	12国债07	400,000	39,630,000.00	7.01
3	128257	MTN2	400,000	39,380,000.00	6.96
4	125313	12国债31	400,000	39,200,000.00	6.93
5	130240	13国债40	400,000	36,800,000.00	6.51

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金报告期末未持有权证。

8.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

本基金报告期末未持有权证。

9.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

本基金报告期末未持有权证。

10.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

本基金报告期末未持有权证。

11.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

本基金报告期末未持有权证。

12.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

本基金报告期末未持有权证。

13.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

本基金报告期末未持有权证。

14.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

本基金报告期末未持有权证。

15.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

本基金报告期末未持有权证。

16.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

本基金报告期末未持有权证。

17.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

本基金报告期末未持有权证。

18.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

本基金报告期末未持有权证。

19.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

本基金报告期末未持有权证。

20.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

本基金报告期末未持有权证。

21.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

本基金报告期末未持有权证。

22.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

本基金报告期末未持有权证。

23.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

本基金报告期末未持有权证。

24.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

本基金报告期末未持有权证。

25.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

本基金报告期末未持有权证。

26.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

本基金报告期末未持有权证。

27.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

本基金报告期末未持有权证。

28.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

本基金报告期末未持有权证。

29.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

本基金报告期末未持有权证。

30.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