

国联安保本混合型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

重要提示
基金管理人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2014年7月16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预示其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	国联安保本混合
基金代码	000058
交易代码	000058
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月23日
报告期末基金份额总额	180,377,483.43
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争基金资产净值实现高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance)恒定比例投资组合保险策略,严格控制投资组合的风险,通过资产配置和个股选择,实现基金资产的长期增值。同时,本基金还通过积极管理降低投资组合的波动率,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	税后三年期银行定期存款利率×1.2
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金,属证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	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(2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益	2,853,330.85
2.本期利润	12,254,796.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0632
4.期末基金份额净值	1.0891,197.50
5.期末基金份额净值	1.052

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,包含停牌股票按公允价值调整的损益。
2.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益将低于所列数字。

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	业绩比较基准收益率②	净值比较基准收益率③	①-②	①-③
过去三个月	6.48%	0.26%	1.27%	0.01%	3.21%
自基金合同生效以来至本报告期末	6.48%	0.26%	1.27%	0.01%	0.25%

3.2.2 自基金合同生效以来至本报告期末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

国联安保本混合型证券投资基金
基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年4月23日至2014年6月30日)

注:1.本基金业绩比较基准为税后三年期银行定期存款利率×1.2。在本基金成立之初,上述“三年期定期存款利率”指“基金合同”生效当日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”,其后的每个自然年,“三年期定期存款利率”指当年第一个工作日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。

2.本基金合同自2013年4月23日生效。
3.本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,2013年10月22日建仓期结束当日除现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例被动低于合同约定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定。本基金已于2013年10月23日及时调整策略,使建仓期在一年以内的政府债券的投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
张利	基金经理	2013年4-23	7年(自2007年起)	曾任国联安基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理、基金经理。2012年9月加入国联安基金,2012年10月担任国联安保本混合基金基金经理,2013年4月担任国联安保本混合基金基金经理,2014年6月担任国联安保本混合基金基金经理。

注:1.基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;
2.证券从业年限的标准按证券行业的工作经历年限。
4.2 管理人及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《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安保本混合型证券投资基金合同》及相关法律法规,法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合法律法规和基金合同的约定,无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
本基金管理人遵照相关法律法规和内部规定,制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”),用以规范包括投资策略、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实际效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.4 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.5 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.6 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.7 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.8 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.9 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.10 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.11 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.12 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.13 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.14 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.15 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.16 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.17 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.18 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.19 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.20 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.21 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.22 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.23 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.24 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.25 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.26 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.27 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.28 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.29 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.30 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.31 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.32 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.33 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.34 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.35 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.36 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.37 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.38 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

4.3.39 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待所有投资组合,确保各投资组合在获得信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会;在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则执行交易;如遇持仓比例相同或持仓比例不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公允价值系统对不投资资产的交易价差进行定期分析;对投资流程各环节进行复核等。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	35,208,339.41	14.55
1.1	其中:股票	35,208,339.41	14.55
2	固定收益投资	185,281,268.00	76.56
2.1	其中:债券	185,281,268.00	76.56
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	15,084,797.80	6.61
7	其他负债	5,522,926.87	2.28
8	合计	240,017,332.08	100.00

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	-	-
B	矿业	-	-
C	制造业	30,411,759.41	16.03
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	建筑业	4,796,600.00	2.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	住宿和餐饮业	-	-
P	教育、文体和娱乐业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		35,208,339.41	18.56

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	002475	艾派克	380,279	15,087,945.62	7.95
2	002008	大族激光	400,000	6,589,200.00	3.47
3	000625	长安汽车	400,000	4,920,400.00	2.60
4	000022	万科A	580,000	4,796,600.00	2.53
5	600089	特变电工	419,976	3,566,536.24	1.88
6	002726	北大医药	7,518	128,257.68	0.07
7	000872	中钢国际	10,941	116,740.47	0.06

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	地方政府债	-	-
4	企业债券	119,614,600.00	63.06
5	公司债券	59,250,000.00	31.24
6	中期票据	6,414,668.00	3.38
7	短期融资券	-	-
8	合计	185,281,268.00	97.68

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十名债券投资明细

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	129291	10国债07	200,000	20,740,000.00	10.93
2	138025	13国债08	200,000	20,500,000.00	10.65
3	122928	09国债07	200,000	20,370,000.00	10.74
4	130312	13国债07	200,000	20,200,000.00	10.68
5	10135300	13国债MTN001	200,000	20,060,000.00	10.54

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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 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持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。
5.11.2 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.3 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.4 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.5 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.6 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.7 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.8 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.9 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.10 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.11 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.12 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.13 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.14 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.15 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.16 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.17 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.18 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.19 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.20 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.21 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.22 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12国债02外,没有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、处罚的情形。

5.11.23 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体