

(上接A39版)

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
 办公地址:北京市西城区金融街9号新成大厦B座4层
 法定代表人:林文相
 电话:(010)66045608
 客户服务热线:(010)68045678
 网址:www.bsecc.com.cn;www.bsecc.com
 (101)财富基金销售有限公司
 注册地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心办公楼层
 办公地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心办公楼层
 法定代表人:罗浩
 电话:(021)-38704818
 传真:(021)-68775878
 客户服务电话:(021)-38794818
 网址:www.c-fund.com
 (102)财富证券股份有限公司
 注册地址:杭州市拱墅区15号嘉华国际商务中心
 办公地址:杭州市拱墅区15号嘉华国际商务中心
 法定代表人:沈卫平
 客服电话:0571-963636
 网址:www.csecc.com
 (103)长城证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区福中一路101号
 办公地址:深圳市福田区福中一路101号
 法定代表人:黄泽华
 电话:(0755)83516094
 传真:(0755)83516199
 客户服务电话:400-6666-888
 网址:www.cgws.com
 (104)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
 注册地址:上海市金山区漕渡港路750号205室
 办公地址:上海市浦东新区银城中路68号8楼
 法定代表人:汪静波
 电话:(021)-38600676
 传真:(021)-38600777
 客户服务电话:400-821-5399
 网址:www.noah-fund.com
 (105)上海天天基金销售有限公司
 注册地址:上海市徐汇区龙田路613号4幢501室
 办公地址:上海市徐汇区龙田路190号4幢东方财富大厦2楼
 法定代表人:其实
 客服电话:400-181-8188
 网址:www.1234567.com
 (106)上海爱基金销售有限公司
 注册地址:上海虹口区中江路969号,397号4号楼404室
 办公地址:上海浦东新区浦东南路1118号903-906室
 法定代表人:杨文斌
 客服电话:4021-68509616
 网址:www.ehowbuy.com
 (107)杭州聚金基金销售有限公司
 注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路2号
 办公地址:浙江省杭州市滨江区长江南路369号12楼
 法定代表人:陈尚清
 客服电话:4000-706-123
 网址:www.fund123.com
 (108)上海长量基金销售有限公司
 注册地址:浦东新区高东路526号2幢220室
 办公地址:上海市浦东新区浦东南路568号裕景国际B座16层
 法定代表人:张振伟
 客服电话:(021)-58788878
 传真:(021)-58787898
 客户服务电话:400-089-1289
 网址:www.e-fund.com
 (109)北京恒指基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区东三环北路2号12号楼6层
 法定代表人:王明杰
 电话:(+86-10)62020088-8802
 客服电话:400-888-6661
 网址:www.yrcfund.com
 (110)中期资产管理有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号中期大厦11层
 办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号中期大厦A座11层
 法定代表人:路颖
 电话:(86162)4008888160,010-59637818,59637828
 网址:010-65807110
 网址:www.cifcofund.com
 (111)万得基金(北京)基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区东四环中路27号路盛达中心P3201单元
 办公地址:北京市朝阳区东四环中路27号路盛达中心P3201单元
 法定代表人:李松林
 客服电话:4008000069
 网址:www.wy-fund.com
 (112)同花顺基金销售有限公司
 注册地址:浙江省杭州市文二路一单元元茂大厦903室
 办公地址:浙江省杭州市文二路元茂大厦903室
 法定代表人:杨涛
 客服电话:0571-88820887 4008-773-772
 电话:(0571)-88208798
 传真:(0571)-88000423
 公司网站:www.5ifund.com
 (113)联讯证券股份有限公司
 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路65号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂三楼
 办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路65号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂三楼
 法定代表人:徐刚
 电话:(0664)4009889029
 公司网站: http://www.lxsec.com
 (114)深圳众禄基金销售有限公司
 注册地址:深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25层11单元
 办公地址:深圳市深南东路6047号深圳发展银行大厦25层

法定代表人:薛峰
 客服电话:4006788887
 网址:www.jwmw.com
 (115)和讯信息科技有限公司
 注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 办公地址:上海市浦东新区东方路15号保利广场18楼
 法定代表人:王利
 联系人:吴卫东
 电话:(021)-206383787
 传真:(021)-206384797
 (二)注册验资机构
 名称:华安基金管理有限公司
 注册地址:上海浦东新区世纪大道1号,上海国金中心二期31-32楼
 法定代表人:李勇
 电话:(021)38699099
 传真:(021)38697962
 客户服务中心电话:40088-50009
 (三)律师事务所和经办律师
 名称:通力律师事务所
 住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 负责人:韩炯
 电话:(021)31258666
 传真:(021)31358900
 联系人:秦悦民
 经办律师:秦悦民、王利民
 (四)会计师事务所和经办注册会计师
 名称:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)
 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号瑞银银行大厦6楼
 首席合伙人:杨绍信
 联系电话:(021)23238888
 传真:(021)23238890
 联系人:魏晓媛
 经办会计师:汪捷、傅琛强

四、基金的名称

五、基金的类型

本基金名称:华安优选优势股票型证券投资基金
 本基金类型:契约型开放式。

六、基金的投资目标
 以优选股票为主,配合少量固定收益类资产,在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益,实现基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向
 本基金为股票型基金,投资范围包括国内依法发行上市股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。其中,投资股票资产不低于基金资产净值的90%。债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的金融工具占基金资产净值的比例范围为0-40%。现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。

此外,如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围;如法律法规或中国证监会允许基金变更投资品种的比例限制,基金管理人可相应调整本基金的投资比例,无需经基金份额持有人大会审议。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略
 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,并利用公司研究开发的数量模型工具,分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合理的资产配置比例。本基金采取对宏观的资产配置策略,一般说来,将根据股票配置比例的变化,动态调整主动仓位调整来应对市场变化的风险。只有当基金管理人通过研究对证券市场的主要因素(宏观经济、政策环境等)发生实质性变化时,才会对资产配置比例进行大幅度的主动调整,影响本基金资产配置的因素主要包括以下几个方面:

(一)宏观经济形势
 宏观经济形势将两个因素影响股市,一是对上市公司的业绩产生影响,二是改变投资者对股市的预期。由于股市往往对宏观经济进行提前反映,因此,基金管理人将重点关注一些宏观先行指标。

(二)政策因素
 本基金管理人将重点关注政策因素包括:财政政策、货币政策和证券市场宏观政策等。

(三)市场波动周期
 市场的变化会呈现出明显的周期性特征,投资进时机的把握对提高投资收益有极为重要的作用。

(四)资金供求因素
 资金供求情况也是决定我国证券市场运行状况的重要因素。

2、股票投资策略
 本基金的投资策略将采用“自下而上”和“自而上”相结合的方法,通过综合分析和投资策略来选股,选股策略包括:在资产配置组合中主要以“自下而上”的优选成长策略为主,即以“自而上”的长期优选策略、强势操作策略,优选具有良好投资潜力的个股,力求基金资产的长期稳定增值。总体股票投资策略包括以下几个方面:

(1)优选成长策略
 我们认为,成长型股票通常都具有持续的高盈利增长的特点,伴随着市场对成长型股票的发现和认识,其股价也将随之上涨,成为基金资产增值的主要来源。因此,本基金将在判断上市公司业绩成长长期趋势的基础上,着重对上市公司的成长性进行分析,即以上市公司过去一年的主营业务收入和利润增长率为基础,预测未来两三年的利润增长率作为核心标准。同时,比较公司价值成长率(P/B)、市净率(P/B)、市盈率(P/E)等辅助指标在行业中的水平作为参考,综合考察上市公司成长性可持续性,根据公司在行业中的地位,将公司分为成长型、成熟型、稳定型三类,优选成长型公司三种类型,并对每类股票公司筛选,精选具有潜力的个股。

(2)稳健成长型公司。对于处在成熟行业生命周期前期、模型型成长公司,我们将关注那些具有特殊机遇的绩优类公司或者那些在资产负债表中隐藏着较高价值资产的资产类公司的投资机会。

(3)稳定成长型公司。对于具有较快收益增长率、股价已基本反映公司稳健增长的稳定型公司,我们将关注这类公司具有较大潜在利润的资产增加对公司收益和利润的投资机会。

(4)快速成长型公司。对于具有较高收益增值潜力的快速成长型公司,我们将在控制风险的基础上,分析其成长性的持续性,选择在未来三年内能保持竞争优势的公司。

(5)主题投资策略
 本基金将采用“主题投资策略”(Thematic Investing Analysis)对宏观经济周期、产业结构、区域周期等宏观因素进行前瞻性的研究和分析,挖掘并投资于集中代表整个市场发展趋势的个股。首先,寻找社会发展的趋势,

分析这些根本性变化背后的内在逻辑;其次,认清该趋势产生和持续的内在驱动机制,挖掘出国内目前和未来宏观大背景下选择具有持续性的投资主题;最后,选择受益于主题的行业;最后筛选出主题行业中的龙头公司进行重点配置。

(三)逆向操作策略
 本基金认为当市场接近高峰和低谷时,大多数投资者对市场走势的看法都是错误的。因此,本基金将予以确认。在逆向操作策略中,我们将逆向操作。具体来说,本基金将通过公开市场信息观测国内股票型投资基金投资组合的比例。一旦季度股票型基金的平均现金比例明显超过上季现金平均比例,本基金就倾向于增加下季度股票资产配置比例;当本季度股票型基金的平均现金比例明显低于上季现金平均比例,本基金就倾向于降低下季度股票资产配置比例。

3、债券投资策略
 本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。基金管理人通过对收益性、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理配置固定收益证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构成债券组合。

在选择国债品种中,本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预期模型构造最佳期限结构的国债组合;在选择金融债、企业债品种时,本基金将重点分析债券的信用等级以及发行人的资质质量。资信品质主要参考发行机构及担保机构的财务状况安全性、历史违约记录情况等。本基金还将关注可转债的价格与其所对应股票价格的相关性,综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资于可转债的品种和比例,捕捉套利机会。

4、权证投资策略
 本基金在实现权证投资时,将通过权证定价和证券基本面分析,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,谨慎地进行投资,以追求较高投资收益。

5、资产支持证券投资策略
 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等策略,在严格控制风险和合理组合基础上,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

6、其他衍生工具投资策略
 本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向,一旦有新的产品推出市场,将在届时相法律法规和框架下,制订符合本基金投资策略的投资策略,同时结合对衍生工具的研究,在充分考虑到衍生产品风险收益特征的前提下,谨慎进行投资。

七、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准:80%×中信标普300指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的投资业绩比较基准的股票指数时,本基金可以在按照中国证监会备案变更后变更业绩比较基准并及时公告。

八、基金的风险收益特征
 本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

九、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十一、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十二、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十三、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十四、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十五、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十六、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十七、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十八、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

十九、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十一、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十二、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十三、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十四、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十五、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十六、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十七、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十八、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

二十九、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十一、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十二、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十三、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十四、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十五、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十六、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十七、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十八、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

三十九、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

四十、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

四十一、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

四十二、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

四十三、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

四十四、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

四十五、基金的投资组合报告
 本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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

4 报告期末按投资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	50,155,000.00	0.69	
2	金融债券	—	—	
3	企业债券	250,525,000.00	3.46	
3	其中:政策性金融债	250,525,000.00	3.46	
4	企业债券	—	—	
5	企业短期融资券	—	—	
6	中期票据	—	—	
7	可转债	—	—	
9	合计	300,680,000.00	4.15	

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)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

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				
序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

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				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

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股指期货投资明细				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

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明细				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

12 报告期末本基金投资的期权投资情况说明				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

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资产支持证券投资明细				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	140212	14附息12	2,000,000	200,340,000.00
2	140429	14农发29	500,000	50,185,000.00
3	140007	14附息07	500,000	50,155,000.00

(一)基金净值表现					
历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较(截止时间2014年6月30日)。					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	<div>①-③</div> <div>②-④</div>