

（上接B014版）

注册地址：杭州市西湖区15号嘉华国际商务中心
办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈煜宁
客服电话：0571-96336
网站：www.ctsec.com
(102)上海好客基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号903-906室
法定代表人：杨文斌
电话：400-700-9665
传真：021-68569616
网站：www.ehowbuy.com
(103)上海天天基金销售有限公司
注册地址：浦东新区峨山路613号6幢561室
办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人：其实
电话：4008181888
网站：www.1234567.com.cn
(104)杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3688号12楼
法定代表人：陈柏青
电话：4000-769-123
网站：www.fund123.cn
(105)上海长基金销售有限公司
注册地址：浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路555号裕景国际B座16层
法定代表人：张荻伟
电话：021-58798878
传真：021-58787688
客服电话：400-089-1289
网站：www.e-tich.com.cn
(106)东亚银行（中国）有限公司
注册地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
法定代表人：李国宝
电话：8006930811
网站：www.hkba.com.cn
(107)诺亚正行（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市金山区廊下镇漕康公路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：021-38689777
客户服务电话：400-621-5399
网站：www.noah-fund.com
(108)北京展翼基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东沙路富安街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号楼B座4层
法定代表人：闫振杰
电话：400-888-6661
传真：(+86-10)20120089-8902
客户服务电话：400-8886661
网站：www.myfund.com
(109)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1幢11层
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢2层
法定代表人：路皓
电话：010-65807118, 69633728
传真：010-65807110
客户服务电话：05162, 400-8888-160
网站：www.cifcofund.com
(110)万阳财信（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼A座3201
法定代表人：李志刚
电话：010-56393923
传真：010-56393034
客户服务电话：400-808-0069
网站：www.wy-fund.com
(111)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区深南中路4047号发展银行大厦B座1J单元
办公地址：深圳市福田区深南中路4047号发展银行大厦B座1J单元
法定代表人：薛峰
电话：4006-788-887
传真：0755-82008798
网站：www.zlfund.cn, www.jmmw.com
(112)康同恒基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市滨江区浦沿街道长河社区电子商务产业园2楼
法定代表人：吴静
电话：0571-88020897 4008-773-772
传真：0571-88004423
客户服务电话：400-808-0069
网站：www.wy-fund.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55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂三楼、四座
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂三楼、四座
法定代表人：徐刚
电话：05664, 08808829
网站：www.lxqz.com.cn
(114)和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场6座18F
法定代表人：王莉
联系人：吴卫东
电话：021-20836577
传真：021-20836579
(115)中国银河期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人：王兵
客服电话：95162
公司网站：www.cifco.net
(二)注册登记机构
名称：华安基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层
法定代表人：吴圣章
电话：(021)38690999
传真：(021)33627062
联系人：赵晨
客户服务电话：40088-50069
名称：通方律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩晖
电话：(021)31356666
传真：(021)31356660
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：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展耀银行大厦6楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展耀银行大厦6楼
法定代表人：杨绍辉
联系电话：(021)22323888
传真：(021)22323800
联系人：陈琛
经办会计师：汪敏、傅琛琛

四、基金的名称

本基金名称：华安稳定收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

六、基金的投资目标

在严格控制投资风险的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益及市场价值变动收益，以追求资产持续增值。

七、基金的投资方向

本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行的、上市的国债、金融债、可转换债券、可分离债券、债券回购、央行票据、信用等级为投资级的企业（公司）债，以及股票等权益类品种和经中国证监会认可的基金投资的其它金融工具。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，股票等权益类品种的投资比例为基金资产的0%~20%。本基金权益类资产投资主要通过首次发行以及增发新股投资，并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股形成的股票，不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金还可以持有股票所派发的权证和可分离债券产生的权证。

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。

八、基金的投资策略

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各种数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的风险及风险特征，积极寻找各种可能的价值和价值增长的机会，为基金资产的分配比例。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例占基金资产的80%~100%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；股票等权益类品种的投资比例占基金资产的0%~20%。

2、债券投资策略（不含可转债）

本基金为债券型基金，在投资过程中我们高度重视稳健投资策略的运用。通过宏观层面自上而下的分析，把握宏观经济基本态势和市场利率变动趋势，及时调整组合的平均剩余期限，使基金资产获得稳定的较高收益。

本基金构建债券组合时，将具体采取利率预期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、替代互换策略等策略。收益率利差策略：发现、确认并买入市场上存在的机会，实现组合稳定增值。同时，将根据组合流动性情况调整个券投资，保证核心债券组合的流动性。为了严格控制债券投资风险，本基金将谨慎地投资信用等级为投资级的企业（公司）债。

(1) 利率预期策略

该策略是基于对未来利率走势的预测，改变组合平均剩余期限，以适应利率变化。本策略主要是基于宏观经济环境的变化，预期未来市场利率的变化趋势，并结合基金未来现金流的分析，确定投资组合的平均剩余期限。如果未来利率将有所上升，则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法降低利率风险。相反，如果预测未来利率下降，则延长组合平均剩余期限，赚取利率下降带来的超额收益。

(2) 收益率曲线策略

该策略是通过市场收益率曲线形状的变化来调整组合结构的策略，具体包括子弹策略、两端策略和梯式策略三种。按子弹策略构建的投资组合目的是为了使得组合中证券的到期集中存在收益率曲线的一点；两端策略则是将证券的到期期限分布在两端，梯式策略则是将债券到期期限进行均匀分布。

(3) 替代互换选择策略

该策略是基于不同债券市场间利差而在组合中分配资本的方法。收益率利差包括信用利差、可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差等表现形式。信用利差存在用于不同债券市场，如国债和企业债之间；国债与金融债利差、金融债和企业债利差等；可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差形成的原因是基于利率预期的变动。

(4) 替代互换选择策略

这是以一种证券替换另一种证券，信用质量都相同，但收益率略高的债券来替换组合中的证券。这种互惠关系依赖于资本市场的完善，这种情况的出现一般在暂时性。

(5) 骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，也即短期期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过收益率的下降，来获取较高的资本利得；随着期限的延长，债券的剩余期限将缩短，此时债券的收益成本将下降，将较投资期初有所下降，通过债券收益率的下降，进而获得资本利得收益。

骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度，如果收益率曲线较为陡峭，则骑乘策略运用的可行性将增大，该策略的运用可以获得较高的资本利得；反之，如果收益率曲线比较平坦，则骑乘策略运用的空间就较小，获得资本利得的可能性降低。

3、可转换债券投资策略

可转换债券同时具有债券、股票期权的相关特性，结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益稳定的优势，并有利于从资产整体配置上分散利率风险和降低权益风险。本基金将重点从可转换债券的内在价值（如票面利率、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地

和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究，在公司自行开发的可转换定价分析系统的支持下，充分发掘投资价值，并积极寻找各种套利机会，以获取更高的投资收益。

4、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，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、新股申购投资策略

参照目前国内其他金融品种的投资收益，我们认为参与新股投资将是最具低风险、高收益的投资品种之一。同时，随着股改完成，预计我国证券市场在未来仍将保持一定数量与规模的新股发行。本基金作为固定收益类产品，将在充分依靠公司研究平台和股票估值体系、深入发掘新股内在价值的前提下，积极参与新股的申购。

九、基金的业绩比较基准

中国债券总指数。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场整体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

本基金如有合适的指数推出，基金管理人可以根据本基金的投资目标和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中较高流动性、低风险品种，其预期的风险水平和预期收益低于股票基金、混合基金、高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。本基金期末本基金资产配置情况如下：截至2014年10月31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。

本报告投资组合报告所载数据截至2014年9月30日。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	--	--
其中：股票	--	--	--
2	固定收益投资	334,275,743.86	96.67
其中：债券	334,275,743.86	96.67	
资产支持证券	--	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	3,656,594.42	1.06
7	其他资产	7,868,123.60	2.28
8	合计	345,800,461.88	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金期末未持有股票。

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

本基金期末未持有股票。

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	国债投资	49,730,988.00	18.74
2	央行票据	--	--
3	金融债	9,747,000.00	3.67
其中：政策性金融债	--	--	--
4	企业债	136,372,606.46	51.40
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	49,070,000.00	18.49
7	可转债	89,355,149.40	33.68
8	其他	--	--
9	合计	334,275,743.86	125.99

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	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010107	21国债(7)	291,660	69,960,988.00	11.19
2	1480120	14国债(零)	200,000	21,094,000.00	7.95
3	122749	12国债(2)	200,000	20,500,000.00	7.73
4	019125	11国债(25)	200,000	20,040,000.00	7.55
5	1282181	12国债(MTN1)	200,000	20,024,000.00	7.53

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。

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。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

0.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓量和损益明细

本基金本报告期末没有股指期货投资。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末没有国债期货投资。

10.3 本基金投资国债期货的投资政策

11 投资组合报告附注

11.1 本报告报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资前十大重仓券中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

基金管理人承诺本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	49,582.49
2	应收证券清算款	959,873.36
3	应收股利	--
4	应收利息	6,740,969.96
5	应收申购款	117,097.59
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	7,868,123.60

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	17,036,580.00	6.42
2	110018	国电转债	12,949,200.00	4.88
3	110024	隧道转债	10,508,800.00	3.96
4	113002	工行转债	8,709,600.00	3.28