

## 万家增强收益债券型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

## § 5 投资组合报告

报告期内基金资产组合情况		金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1 权益投资		9,676,386,000	25.0
其中：股票		9,676,386,000	25.0
2 固定收益投资		352,784,727,000	91.92
其中：债券		352,784,727,000	91.92
资产支持证券		-	-
3 货币市场工具		-	-
4 金融衍生品投资		-	-
5 其他金融工具投资		8,000,000,000	2.08
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		4,311,746,534	1.12
7 其他资产		9,036,178,521	2.36
8 合计		352,899,025,055	100.00

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合		金额(元)	占基金总资产的比例(%)
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	农林、牧、渔业	9,676,386,000	25.0
2	制造业	352,784,727,000	91.92
3	批发零售业	352,784,727,000	91.92
4	金融行业	-	-
5	买入返售金融资产	8,000,000,000	2.08
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	4,311,746,534	1.12
7	其他资产	9,036,178,521	2.36
8	合计	352,899,025,055	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合		金额(元)	占基金总资产的比例(%)
序号	行业类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	农、林、牧、渔业	9,676,386,000	25.0
2	制造业	352,784,727,000	91.92
3	批发零售业	352,784,727,000	91.92
4	金融行业	-	-
5	买入返售金融资产	8,000,000,000	2.08
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	4,311,746,534	1.12
7	其他资产	9,036,178,521	2.36
8	合计	352,899,025,055	100.00

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		金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
1	300072	三聚环保	120,000	0.09
2	000613	丽珠集团	71,500	0.07
3	002002	金利科技	150,000	0.05
4	002508	老板电器	28,000	0.02
5		本基金管理人未持有上述股票。		

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合		金额(元)	占基金总资产的比例(%)
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
1	国家债券	29,071,869,000	7.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,198,000,000	10.51
4	企业债券	40,198,000,000	10.51
5	企业短期融资券	141,210,000,000	36.04
6	中期票据	41,128,000,000	10.76
7	可转债	3,915,800,000	1.02
8	其他	3,079,778,000	0.81
9	合计	352,784,727,000	92.29

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五名贵金属投资明细		金额(元)	占基金总资产的比例(%)		
序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
1	101462009	14国农银	300,000	30,999,000,000	8.11
2	041563013	15新CP001	300,000	33,339,000,000	7.94
3	011690068	15恒产	300,000	32,400,000,000	7.91
4	15国开02	15国开	300,000	30,150,000,000	7.89
5	0103017	13国债17	250,000	25,300,000,000	6.62
6		本基金管理人未持有上述贵金属。			

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股票投资明细		金额(元)	占基金总资产的比例(%)		
序号	股票代码	股票名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
1	101462009	14国农银	300,000	30,999,000,000	8.11
2	041563013	15新CP001	300,000	33,339,000,000	7.94
3	011690068	15恒产	300,000	32,400,000,000	7.91
4	15国开02	15国开	300,000	30,150,000,000	7.89
5	0103017	13国债17	250,000	25,300,000,000	6.62
6		本基金管理人未持有上述股票。			

5.7 本基金合同生效以来基金累计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		阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④
过去三个月	-1.30%	0.22%	2.52%	0.00%	-3.87%	0.16%

注:1.上述业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列示的数字。

2.上表中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。

3.基金净值增长率=净值增长率/(1-申购费率-赎回费率)

4.3.2 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.3 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.4 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.5 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.6 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.7 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.8 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.9 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.10 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.11 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.12 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.13 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.14 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.15 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.16 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.17 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.18 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.19 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.20 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.21 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.22 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.23 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.24 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.25 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.26 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.27 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.28 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.29 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.30 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.31 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.32 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。

4.3.33 本基金报告期各基金期间的净收益及天数如下表所示。