

(上接B065版)

办公地址:长春市自由大路138号
法定代表人:李福春
电话:0431-8500617
电话:0431-85006795
联系人:安岩岩
网址:www.nesc.cn
客户服务电话:96360
(72) 南京证券股份有限公司
住所:江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址:江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人:孙国刚
客户服务电话:400-828-5888
传真:025-83364032
联系人:石疆
网址:www.njzq.com.cn
(73) 上海证券有限责任公司
住所:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
电话:021-61539888
传真:021-65217206
联系人:张瑾
网址:www.962518.com
客户服务电话:400-891-8918
(74) 新时代证券有限责任公司
住所:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝安
电话:010-83561149
传真:010-83561094
联系人:孙旭
网址:www.xsdz.cn
客户服务电话:400-698-9998
(75) 大同证券经纪有限责任公司
住所:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座P12、F13
法定代表人:董祥
电话:0351-4130322
传真:0351-41529033
联系人:薛萍
网址:www.dtsbc.com.cn
客户服务电话:400-712-1212
(76) 国联证券股份有限公司
住所:无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
办公地址:无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
法定代表人:姚志勇
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:徐欣
网址:www.glsc.com.cn
客户服务电话:96670
(77) 浙商证券股份有限公司
住所:浙江杭州杭州钱江新城1号黄龙世纪广场A6-7
办公地址:浙江省杭州市钱江路1号黄龙世纪广场A6-7
法定代表人:吴承根
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
联系人:谢梅群
网址:www.ztc.com.cn
客户服务电话:96345
(78) 平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区中心区益田路4038号平安大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区中心区益田路4038号平安大厦16-20层
法定代表人:谢永林
电话:021-38801117
传真:021-38303356
联系人:石静宇
网址:www.pingan.com
客户服务电话:95511-8
(79) 华安证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路190号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人:李工
电话:0651-65161666
传真:0651-65161600
联系人:甘霖
网址:www.haqq.com
客户服务电话:96318, 400-809-6518
(80) 国海证券股份有限公司
住所:广西桂林市辅星路13号
办公地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人:何春梅
电话:0755-83709350
传真:0755-83704850
联系人:牛志宇
网址:www.gtzq.com.cn
客户服务电话:95663
(81) 财富证券有限责任公司
住所:长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心20楼
办公地址:长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27、28楼
法定代表人:蔡一兵
电话:0731-4403349
传真:0731-4403349
联系人:郭嘉
网址:www.cfzq.com
(82) 东莞证券股份有限公司
住所:东莞市莞城区可园南路1号金源中心
办公地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
电话:0769-22115712,0769-22119348
传真:0769-22119423
联系人:李英、苏雄
网址:www.dgzq.com.cn
客户服务电话:0769-961130
(83) 中原证券股份有限公司
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅宇斌
电话:0371-69098922
传真:0371-66585899
联系人:程月梅、范春香
网址:www.ccnew.com
客户服务电话:96377
(84) 国都证券股份有限公司
住所:北京东城区东直门内大街2号国都证券投资大厦9层、10层
办公地址:北京东城区东直门内大街2号国都证券投资大厦9层、10层
法定代表人:常浩
电话:010-84183389
传真:010-84183311-3389
联系人:黄静
网址:www.guodu.com
客户服务电话:400-818-8118
(85) 东海证券股份有限公司
住所:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:李科敏
电话:021-30233333
传真:021-60488825
联系人:王一彦
网址:www.longone.com.cn
客户服务电话:95631, 400-888-8888
(86) 中银国际证券有限责任公司
住所:上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:钱卫
电话:021-50372474
传真:021-50372474
联系人:王玮婷
网址:www.bocichina.com.cn
客户服务电话:400-620-8888
(87) 恒泰证券股份有限公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:贾志军
电话:021-68406273
传真:021-68405181
联系人:张同庆
网址:www.cnhb.com.cn
客户服务电话:0471-4961269
(88) 国盛证券有限责任公司
住所:南昌市北京西路98号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路98号江信国际大厦4层
法定代表人:曾小锋
电话:0791-86283080
传真:0791-86281305
联系人:俞翀
网址:www.gsstock.com
客户服务电话:0791-8285237
(89) 华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市陕西路239号
办公地址:四川省成都市陕西路239号
法定代表人:杨锦祥
电话:010-52723273
传真:028-96150040
联系人:李慧灵
网址:www.hx168.com.cn
客户服务电话:400-888-8818
(90) 中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市市中区经七路96号
办公地址:山东省济南市市中区经七路96号
法定代表人:李勇
电话:0531-68889185
传真:0531-68889185
联系人:吴阳
网址:www.zts.com.cn
客户服务电话:96538
(91) 世纪证券有限责任公司
住所:深圳市福田区福华大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:卢长才
客户服务电话:400-832-3000
联系人:何宇辉
网址:www.csco.com.cn
(92) 第一创业证券股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:深圳市福田区福华一路15号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
电话:0755-25331754
传真:0755-23983750
联系人:毛诗莉
网址:www.firstcapital.com.cn
客户服务电话:400-888-1888
(93) 金元证券有限责任公司
住所:海口市南滨路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025622
传真:0755-83025625
联系人:马贤清
网址:www.jyzzq.com
客户服务电话:400-888-8228
(94) 中航证券有限公司
住所:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A栋41层
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A栋41层
法定代表人:王宜四
电话:0791-86768681

传真:0791-86770178
联系人:戴璐
网址:www.wjzsc.com
客户服务电话:400-886-6667
(95) 华林证券有限责任公司
住所:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6层
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6、6层
法定代表人:薛荣年
电话:0755-82707855
传真:0755-23613761
联系人:杨玲
网址:www.chinalions.com
客户服务电话:400-189-3888
(96) 德邦证券股份有限公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南华大楼
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人:姚文平
电话:021-68761616-8522
传真:021-68767032
联系人:叶菁
网址:www.tebon.com.cn
客户服务电话:400-888-8128
(97) 西部证券股份有限公司
住所:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
法定代表人:刘建武
电话:029-87471723
传真:029-87424426
联系人:刘霞
网址:www.westsecu.com
客户服务电话:96682
(98) 华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
联系人:张勇
网址:www.hfzq.com.cn
客户服务电话:0591-96326(99) 华龙证券有限责任公司
住所:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
电话:0931-4890100
联系人:李舒宁
网址:www.hljzq.com
客户服务电话:0931-4890619, 4890618, 4890100
(100) 中国国际金融股份有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:金立群
电话:010-65051104
传真:010-65058905
联系人:罗睿、武明明
网址:www.cicc.com.cn
客户服务电话:010-65051166
(101) 财富证券股份有限公司
住所:杭州市杭大路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:沈强宁
电话:0571-87926129
传真:0571-87818329
联系人:夏吉慧
网址:www.ctsec.com
客户服务电话:0571-86236
(102) 华泰证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4012号安联大厦2层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号
法定代表人:俞洋
电话:021-54967203
传真:021-54967293
联系人:王迪
网址:www.htsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999, 029-68918888, 400-109-9918
(103) 瑞银证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程志江
电话:010-58323148
传真:010-58323742
联系人:牟冲
网址:www.ubssecurities.com
客户服务电话:400-387-8827
(104) 中投证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、10层至11层
法定代表人:高涛
电话:0755-82032442
传真:0755-82029393
联系人:刘爽
网址:www.china-invs.cn
客户服务电话:400-600-8008, 95532
(105) 中山证券有限责任公司
住所:深圳市南山区科技中一路西华强高新研发大楼7楼、8层
办公地址:深圳市福田区科苑中路一路西华强高新研发大楼7楼、8层
法定代表人:黄扬录
电话:0755-82965086
传真:0755-82960582
联系人:罗艺琳
网址:www.zszq.com
客户服务电话:400-102-2011
(106) 江海证券有限责任公司
住所:拉萨市北京中路101号
办公地址:上海市永和路118弄东方企业园24号
法定代表人:贾绍刚
电话:021-39633016
传真:021-39633017
联系人:王伟光
网址:www.jhzq.com.cn
客户服务电话:400-666-2288
(109) 国金证券股份有限公司
住所:成都市青羊区东城根上街95号
办公地址:成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86680007
传真:028-86660126
联系人:刘一宏
网址:www.gjzq.com.cn
客户服务电话:95106111(四川地区)、400-660-0109(全国)
(110) 中国民族证券有限责任公司
住所:北京西城区金融街5号新大厦B座6层-9层
办公地址:北京西城区金融街5号新大厦A座6层-9层
法定代表人:赵大洪
电话:010-59359411
传真:010-66563791
联系人:李薇
网址:www.e6618.com
客户服务电话:400-889-5618
(111) 华安证券有限责任公司
住所:上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址:上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人:陈林
电话:021-50122128
传真:021-50122388
联系人:徐方亮
网址:www.cnhbstock.com
客户服务电话:400-820-9898
(112) 长城国瑞证券有限公司
住所:福建福州福州市连江路2号嘉富大厦十七层
办公地址:福建省福州市连江路2号嘉富大厦十七层
法定代表人:王勇
电话:0692-5161642, 15880287470
传真:0592-5161140
联系人:卢金文
网址:www.wjzq.com.cn
客户服务电话:0592-5163588
(113) 毅康证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人:钱华
电话:021-32229888
传真:021-62978753
联系人:王璇
网址:www.ykzq.com
客户服务电话:400-196-2502
(114) 华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京西城区金融大街8号A座3层、5层
法定代表人:祝献忠
电话:010-58568235
传真:010-58568265
联系人:卢文文
网址:www.hrsc.com.cn
客户服务电话:010-58581818
(115) 天风证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
电话:027-87161882
传真:027-87161893
联系人:董耀
网址:www.tfzq.com
客户服务电话:028-86711410, 027-87618882
(116) 宏信证券有限责任公司
住所:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉明
电话:028-96199278
传真:028-96199382
联系人:郝俊杰
网址:www.hxzq.com
客户服务电话:400-836-6366
(117) 太平洋证券股份有限公司
住所:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址:北京西城区北大街甲18号华远企业中心D座300F
法定代表人:李长伟
电话:010-88221717, 18500560235
传真:010-88221763
联系人:唐丹丹
网址:www.tpyzq.com

客户服务电话:400-665-0999
3. 场内申购机构
投资者可以通过具有“上证基金通”基金业务资格的证券公司办理申购业务。
4. 基金管理人可根据有关法律法规,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告,销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。
(二) 登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系电话:010-50938870
传真:010-50938907
联系人:陈鸿雁
(三) 律师事务所
名称:上海锦天城律师事务所
住所:上海市浦东新区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人:朱小华
联系电话:010-57763888
传真:010-57767777
联系人:杨科
经办律师:吴冠雄、杨科
(四) 会计师事务所
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号星展银行大厦9楼
办公地址:上海市静安区南京西路202号企业天地2号楼普华永道中天11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:021-22288889
传真:021-22238800
联系人:许康华、洪磊
经办注册会计师:许康华、洪磊

四、基金的名称
五、基金的类型
六、基金的投资目标
七、基金的投资方向

本基金的名称为:华夏平稳增长混合型证券投资基金。
本基金类型:契约型开放式。
本基金的投资目标:在运用TTP投资策略组合保险策略进行风险预算管理的基础上,通过实施主动资产配置,精选优质投资标的,进行具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金的投资范围:限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
其中,本基金资产配置比例范围如下:
1. 股票资产投资比例范围70%-95%;
2. 债券资产投资比例范围0-30%;
3. 资产支持证券投资比例范围0-20%;
4. 现金以及到期日在一年以内的国债、政策性金融债等短期金融工具的资产比例不低于5%。
此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人可在履行适当程序后,可将其纳入本基金的投资范围,如法律法规和中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。
八、基金的投资策略
积极投资策略的运用是基金取得超额收益的主要来源,而严格执行风险和回报投资程序的执行是实现基金业绩持续、稳健增长的主要保证。
(一) 资产配置策略
1. 本基金将基于对宏观经济/政策、证券市场估值/趋势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置。
2. 本基金将运用TTP策略(时间不变性投资组合保险策略),对股票资产配置的风险进行监控。TTP策略的基本公式如下:

$$F_t = \frac{V_t - V_t^*}{V_t} \times (1 - \alpha_t) \times \beta_t$$

$$\alpha_t = \min(\alpha_t^*, \alpha_t^*)$$

$$\beta_t = \frac{V_t - V_t^*}{V_t} \times \beta_t^*$$

其中,β表示可投资于风险资产的上限;M表示风险乘数;A表示投资组合的资产净值;F表示安全底线;而A-F则表示可投资于风险资产的数量。
TTP策略主要用于根据投资者对风险回报的要求设定风险控制水平(α),此后,安全底线(F)不随时间调整,而根据投资组合价值(A)的变化而调整,在投资组合价值上升时,F上升,锁定部分收益,在投资组合价值下跌时,F不变,保证组合安全。
在实际操作中,将主要通过M和A参数的设定,计算股票投资比例上限的参考值,在此基础上调整股票资产配置策略,追求在严格控制下行风险的基础上,在不同市场情况下获得稳定的回报。
(二) 股票投资策略
本基金采取多种积极管理策略,通过严谨、深入的基本面分析,追求具有健康、可持续增长潜力的股票,同时结合估值水平分析和基本面分析,追求合理买入价格和最佳买入时机,从而在控制风险的基础上实现超额回报。
基本面分析的主要因素包括:产品销量及增长率、营业利润率(分解为产品结构以及价格变动趋势、营运杠杆、规模经济、成本控制)、管理效率(决定长期投资带来的盈利增长)、管理(体现在新产品研发、营销战略、客户信息管理、销售网络、环保、社会责任、人才激励、品牌和品质等)、宏观经济和产品生命周期、进出口需求和下游行业、现有行业和公司产能利用率以及新增产能利用率等。
对于重点关注的事项,我们将跟踪其估值水平,并与市场、同行业估值水平进行比较,结合市场成交量、换手率、分析师指数等技术指标,为基金寻找最佳的买入、卖出时机,以降低投资成本同时控制下行风险。
(三) 债券投资策略
本基金采取多种积极管理策略,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,为组合增加收益。
1. 久期调整策略
根据对市场利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。
2. 收益策略调整策略
在明确预期的基础上,根据对收益率曲线形状变化的预期,采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的价格变化中获利。如预期收益率曲线扁平化或下降时,将更多地配置短期债券;预期收益率曲线变陡时,将更多地配置长期债券。
(四) 其他投资策略
根据国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被低估的债券品种,减持相对高估的债券品种,借以取得较高收益。其中,随着债券市场的发展,本基金将加大对企业债、可转债、资产支持证券等新品种的投资,主要通过信用风险、内含选择权的风险分析和管理,获取超额收益。
(五) 其他投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化估值模型其合理定价的基础上,把握个股的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
本基金还将积极参与与低风险且可控的新股申购、债券回购等投资,以增加收益。

九、基金的投资比较基准
本基金股票投资的业绩比较基准为:中证中国A600指数, 债券投资的业绩比较基准为中债综合指数(财富)。本基金整体业绩比较基准构成如下:
本基金业绩比较基准=中证中国A600指数收益率×50%+中债综合指数(财富)收益率×50%
中证中国A600指数涵盖市值最大的600只股票,中债综合指数涵盖国债、政策性金融债和企业债,市场代表性较强,适合作为本基金的业绩比较基准。
(四) 其他投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化估值模型其合理定价的基础上,把握个股的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
本基金还将积极参与与低风险且可控的新股申购、债券回购等投资,以增加收益。
十、基金的投资收益特征
本基金是混合型基金,风险高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。
十一、基金投资组合报告
以下内容摘自本基金2015年第4季度报告:

6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,327,979,430.66	93.54
2	其中:股票	2,327,979,430.66	93.54
3	固定收益投资	73,668,392.00	2.96
4	其中:债券	73,668,392.00	2.96
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	其他各项资产	5,140,142.96	0.21
10	合计	2,488,746,926.44	100.00

6.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,269,951,178.46	51.73
D	电力、热力、燃气及生产供应业	30,715,462.47	1.26
E	建筑业	31,378,157.24	1.28
F	批发和零售业	214,893,632.00	8.76
G	交通运输、仓储和邮政业	93,024,283.64	3.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	452,924,083.74	18.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	167,998,619.06	6.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	67,104,033.56	2.73
S	综合	-	-
T	合计	2,327,979,430.66	94.83

6.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	002930	美亚光电	5,537,300	223,433,686.50	9.10
2	002561	奥翔医疗	6,165,696	203,282,008.02	8.28
3	000893	东凌粮油	8,256,660	137,308,256.80	5.59
4	300070	鲁通能源	2,596,353	134,413,194.81	5.48
5	001696	宗申动力	8,360,035	115,536,683.70	4.71
6	002467	二三六	5,170,661	108,532,174.39	4.42
7	300226	三六五网	1,928,486	95,652,906.60	3.90
8	600936	中海海盛	5,752,892	93,024,283.64	3.79
9	002189	新嘉科	1,693,650	75,262,742.50	3.07
10	300188	美亚红杉	1,399,968	70,978,377.60	2.89

6.4 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,033,000.00	2.04
4	其中:政策性金融债	50,033,000.00	2.04
5	企业短期融资券	23,635,392.00	0.96
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	合计	73,668,392.00	3.00

6.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	150403	15农发03	30,060,000.00	1.22	
2	122149	12石化01	23,040	23,635,392.00	0.96
3	150301	15进出01	100,000	10,909,000.00	0.41
4	090408	09农发08	100,000	9,664,000.00	0.41
5	-	-	-	-	-

6.7 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。
6.8 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。
6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
6.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。
6.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货投资。
6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
6.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
6.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
6.10.3 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
6.11 投资组合报告附注
6.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
6.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
6.11.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币元
1	存出保证金	1,644,833.70	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	1,767,478.60	-
5	应收申购款	1,728,130.56	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,140,142.86	-

6.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
6.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
6.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
七、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2006年8月9日至2006年12月31日	44.74%	1.02%				