

(上接B057版)

105.	北京康泰基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区东直门北大街1号银泰中心2122室2507 法定代表人:尹岩 联系人:翟颖 电话:010-61848688 传真:010-61848688 客户服务热线:400 0618 518 网址:http://khtfund.com.cn/
106.	上海基煜基金销售有限公司	注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海浦东经济开发区) 办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室 法定代表人:王翔 联系人:王翔 电话:021-65370077 传真:021-65389309 客服电话:4000253899 网址:www.jiyufund.com.cn
107.	南京途牛基金销售有限公司	注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号 办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号 法定代表人:宋翔 联系人:王超 电话:025-86853969 传真:025-86853960 客服电话:4007-009-929 网址:http://p.tuniu.com
108.	上海恒远汇茂基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区周家渡新场路2号24幢1107室 办公地址:上海市浦东新区通北路379号金耀大厦1402室 法定代表人:杨善喜 联系人:卢敏 电话:021-68676388 传真:021-68676388 客服电话:4001811811 客户服务热线:4006888967 网址:http://www.hytz-fund.com
109.	凤凰金信(银川)基金销售有限公司	注册地址:宁夏回族自治区银川市金凤区凤凰港中央商务区万寿路142号14151402 办公地址:北京朝阳区望京乡望月园10号楼9层901室(北京分公司) 法定代表人:张旭 联系人:陈旭 电话:010-58160168 电话:010-58160170 客户服务热线:400-010-5919 网址:www.fhxdgt.com
110.	北京微动利基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区古城西路113号景山园小区242室 办公地址:北京市朝阳区古城西路113号景山园小区242室 法定代表人:李季 联系人:何静 电话:010-62690666 传真:010-62690666 客户服务热线:400-188-5878 网址:www.weidongli.com
111.	北京掌上基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区东直门北大街701号9层 办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号E01302层 法定代表人:李俊威 联系人:曹庆康 电话:010-59063311 传真:010-68623233 客户服务热线:400-066-8896 网址:www.zs-fund.com
112.	北京肯瑞得财富投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村软件园91号世纪财富中心342室 办公地址:北京市海淀区中关村软件园十一街18号A座17层 法定代表人:陈超 联系人:陈超 电话:4000885114/40088816 电话:010-61918900 客户服务热线:400-811-1120 网址:www.kendry.com
113.	上海明圆上缘基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区上川路977号1幢B座122室 法定代表人:廖晓 联系人:陆佳伟 电话:021-68621100 客户服务热线:4000887172 网址:www.088fund.com
114.	泛华普益基金销售有限公司	注册地址:成都市武侯区建设路9号高迪中心1101室 办公地址:四川省成都市武侯区大街90号平安金融中心2104室125号 法定代表人:于泽群 联系人:王慧 电话:028-64823474 电话:028-64823474 客户服务热线:4006-688-688 网址:http://www.payfund.com
115.	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼B座 办公地址:北京市朝阳区金融大街33号通泰大厦B座10层 法定代表人:李一梅 联系人:李一梅 电话:010-59063622 电话:010-59063624 客户服务热线:400-817-5666 网址:www.huaxiafund.com
116.	上海云湾基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥2路12号3幢6层 办公地址:上海市浦东新区新金桥308号陆家嘴世纪金融广场308号6层606 法定代表人:董浩 联系人:朱永平 电话:021-20633888 电话:021-20633889 客户服务热线:400-320-1515 网址:www.zhongyuanfund.com
117.	上海挖财基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区高南路99号60801_02_03室 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区高南路99号60801_02_03室 法定代表人:王雄英 联系人:王雄英 电话:021-51010857 电话:021-51080276 客户服务热线:021-41001073 网址:www.wacaijijin.com
118.	深圳众安基金销售有限公司	注册地址:深圳市福田区香蜜湖一路1号140201室 办公地址:深圳市福田区三环路2号南方大厦2309 法定代表人:张振林 联系人:张振林 电话:010-64108876 电话:010-64108876 客户服务热线:010-64108876 网址:http://fund.zhaanfund.com
119.	大河财富基金销售有限公司	注册地址:贵州省贵阳市南明区新华南路110-134号中国银大厦20层124号 办公地址:贵州省贵阳市南明区新华南路110-134号中国银大厦20层124号 法定代表人:李伟 联系人:方晓晨 电话:0851-88465599 电话:0851-88465599 客户服务热线:0851-8823678 网址:www.tdrcw.com
120.	天津万家财富资产管理有限公司	注册地址:天津自贸区(中心商务区)滨海岸108号财富金融中心26-2413室 办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层 法定代表人:李伟刚 联系人:李伟刚 电话:010-60123842 电话:021-38906636 客户服务热线:400-14001325 网址:www.wanjiacai.com
121.	北京电盈基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京楼(京广中心11号楼)36层3003室 办公地址:北京市朝阳区望京楼11号楼36层3003室 法定代表人:李博 联系人:李博 电话:010-56176115 电话:010-56176117 客户服务热线:400-100-2391 网址:www.yd-fund.com
122.	通华财富(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区同丰路667号10幢201室 办公地址:上海市浦东新区川沙路656号通华财富大厦7楼 法定代表人:洪文庆 联系人:李俊峰 电话:021-60182849 客户服务热线:400-101-0301 网址:www.tonghuafund.com
123.	晋财期货基金销售有限公司	注册地址:西藏拉萨市柳梧新城柳梧大厦1513室 办公地址:西藏拉萨市柳梧新城柳梧大厦1513室 法定代表人:陈皓 联系人:陈皓 电话:010-56340888 电话:010-88771180 客户服务热线:0801-6177483 网址:www.jcqh.com.cn
124.	济安财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区三环路中甲794号40层4001室 办公地址:北京市朝阳区三环路中甲794号40层4001室 法定代表人:李海峰 联系人:李海峰 电话:010-65061616 电话:010-65330699 客户服务热线:400-673-7010 网址:www.jianfund.com.cn
125.	洪泰财富(青岛)基金销售有限公司	注册地址:山东省青岛市香港东路156号9号楼701室 办公地址:北京市西城区西什大街31号九泰大厦901室 法定代表人:杨善喜 联系人:李慧峰 电话:186-2642-0174 电话:0532-66727591 客户服务热线:4006706983 网址:www.hongtaifund.com
126.	上海有色基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴金融贸易区世纪大道1101号1101室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1101号1101室 法定代表人:林琳 联系人:徐海静 电话:021-60007279 电话:021-60007297 客户服务热线:021-60007278 网址:www.youyifund.com
127.	深圳盈信基金销售有限公司	注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙大厦A-1101-1112 办公地址:深圳市福田区南山街道156号南山1910大厦A3-1 法定代表人:张亮升 联系人:王清田 电话:0411-68888805 电话:0411-68888827 客户服务热线:4007-9003-688 网址:www.yinxinfund.com
128.	民富基金销售有限公司	注册地址:上海黄浦区北京东路666号1区1(东)16楼A31室 办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生美大厦7楼 法定代表人:董晨 联系人:董晨 电话:186-2642-0174 电话:021-50200601 电话:021-50200603 网址:http://www.mifund.com
129.	北京元理代利有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京乡望月园10号楼1101室 办公地址:北京市朝阳区望京乡望月园10号楼1101室 法定代表人:马永健 联系人:马永健 电话:13785290163 电话:021-50701063 客户服务热线:021-50701063 网址:http://www.yzfund.com

基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

二、登记机构
名称:景顺长城基金管理有限公司
住所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
电话:0755-82370388-1646
传真:0755-22381325
联系人:邵恩
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、孙晔
联系人:孙晔
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:毛贲宁
电话:(010) 58153000
传真:(010) 58188298
经办注册会计师:吴翠蓉、高鹤
联系人:吴翠蓉
四、基金名称
景顺长城四季金利债券型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金主要通过投资于固定收益品种,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益,为投资者提供长期稳定的回报。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含分离式可转换债券)、银行存款等。本基金同时投资于股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票)、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证的投资市值不得超过基金资产净值的3%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

八、基金的投资策略
本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置,把握不同经济阶段和各类资产的投资机会,根据宏观经济、基准利率水平等因素,预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平,结合各类资产的波动性以及流动性状况进行配置,进行大类资产配置。

(1)债券类资产配置
基金管理人根据国债、金融债、企业(公)债、分离交易可转债债券部分品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析,主动地增加预期利差收窄的债券类属品种的投资比例,降低预期利差扩大的债券类属品种的投资比例,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

(2)债券投资策略
债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的策略性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

① 利率预期策略
基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行可能情景,预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况进行相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

② 信用策略
基金管理人密切跟踪国债、金融债、企业(公)债等不同债券种类的利差水平,结合各类券种所处阶段、流动性状况以及发行人信用质量状况的分析,评定不同债券品种的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间的配置比例。

个券选择层面,基金管理人自建债券研究资料库,并对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后,进行各券选择。财务分析方面,以企业财务报表为依据,对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分,非财务分析方面(包括管理能力、市场地位和发展前景等指标)则主要通过实地调研和电话会议等形式实施。

③ 时机策略
当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着有着预期的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下降,进而获得资本利得收益。

④ 息差策略
利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

⑤ 套利策略
当两个期限相近的债券的利差分析,从而对利差水平的未来走势做出判断,从而进行相应的债券置换。当前预期利差水平缩小,可以买入收益率高的债券并同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当前预期利差水平扩大,可以买入收益率低的债券并同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。

(3)资产支持证券投资策略
本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时,管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(4)可转债投资策略
① 相对价值分析
基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,判断下一阶段的市场走势,分析可转债股性和债性的相对价值。通过对可转债转股溢价率和Delta系数的度量,筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。

② 基本面研究
基金管理人依据内、外部研究成果,运用景顺长城股票研究数据库(SRD)对可转债标的公司进行多方位、多角度的分析,重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的公司。

③ 估值分析
在基本分析的基础上,运用PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG等相对估值指标以及DCF、DDM等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估。并根据标的股票的当前价格和目标价格,运用期权定价模型进行可转债当前价格和未来目标价格,进行投资决策。
(5)中小企业私募债投资策略
对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金会加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行人的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

3. 权益资产投资策略
(1)股票投资策略
本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略,本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的,在定性分析方面重点关注:

①成长性(growth)。重点关注企业生存和发展的外部环境,企业享有国家相关的优惠政策变化,企业关键技术模仿难易程度,和产品定位等。
②业务价值(Franchise Value)
重点关注拥有高进入壁垒的上市公司,其一般具有以下一种或多种特征:产品定价能力、创新技术、资金密集、优势品牌、健全的销售网络及售后服务、规模经济等。在经济成长时它们能创造持续性的成长,经济衰退时亦能度过难关,享有高于市场平均水平的盈利能力,进而创造高业务价值,达成长期资本增值。
③竞争优势(competitive advantage)。重点关注企业的市占率概况、技术优势、创新体制和开发能力、专利权和法规限制、渠道关系等
④管理能力(Management)
重点关注公司治理、企业的质量管理、公司的销售网络、管理层的稳定性以及管理层的构成、学历、经验等,通过实地考察了解其管理能力以及是否诚信。以及企业的战略实施等。
⑤自由现金流与分红政策(Cash Generation Capability)
重点关注企业创造现金流量的能力以及稳定透明的分红派息政策。衡量企业业绩的最终标准在于投资者的长期现金回报,企业除了需要有良好的利润增长以外,也需要能创造足够现金流以供派息和再投资之用。在会计准则弹性大,盈

利容易被操纵的时候,此标准尤为重要,因为创造现金与分红能力永远是一家企业素质的最好体现。

在定量分析方面重点关注:
①盈利能力。主要指标有资产收益率(ROA)、净资产收益率(ROE)等。
②成长潜力。主要指标有销售收入增长率、净利润增长率等。
③偿债能力。关注目标公司的资产负债结构以及资产负债流动性状况,重点分析的指标有资产负债率、流动比率、货币资金/总资产、利息保障倍数等。
④估值。主要指标有市盈率(P/E)、市盈倍数(PEG)、市净率(P/B)、市现率(PCF)、市销率(PS)、企业价值倍数(EV/EBITDA)等。
对成长、价值、收益三类股票设定不同估值指标。

成长型股票(G):用来衡量成长型上市公司估值水平的主要指标为PEG,即市盈率除以盈利增长率。为了使投资人能够达到长期获利目标,我们在选股时将会谨慎地买进价格与其预期增长速度相匹配的股票。

价值型股票(V):分析股票内在价值的基础是将公司的净资产收益率与其资本成本进行比较。我们在挑选价值型股票时,会根据公司的净资产收益率与资本成本的相对水平判断公司的合理价值,然后选出价格相对于合理价值存在折扣的股票。

收益型股票(I):是依靠分红取得较好收益的股票。我们挑选收益型股票,要求其保持持续稳定的政策,以及较高的股息率水平。

⑤流动性分析。主要指标有市场流通量、股东分散性等。
以上个股考察中不可或缺的部分是合理性分析。因此在研究公司业绩及对公司前景做出预测时,都会对有关公司的业绩强度和科学客观的业绩比较基准适用

于本基金,或者未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,在履行相应程序的前提下对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人(即基金托管人)协商一致,报中国证监会备案,并

报中国证监会备案,并须经基金持有人大会决议。

十、风险收益特征
本基金为债券型货币,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金。

十一、投资组合报告(未经审计)

景顺长城基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。

基金托管人中国农业银行根据基金合同约定,已经复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2019年06月30日,本报告中所有列明数据未经审计。

1. 报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	9,422,510.00	13.55
2	基金投资	9,422,510.00	13.55
3	固定收益投资	58,516,872.52	84.14
4	其中:债券	58,516,872.52	84.14
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	404,212.50	0.58
11	其他资产	1,200,263.11	1.73
12	合计	69,543,940.13	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,748,291.00	9.72
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	-	-
J	金融业	1,889,122.00	2.84
K	房地产业	2,885,097.00	4.27
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	建筑业、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	-	-
S	综合	-	-
合计		9,422,510.00	13.94

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

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	000568	泸州老窖	14,200	1,147,786.00	1.64
2	000661	格力电器	20,100	1,106,500.00	1.57
3	002304	洋河股份	8,700	1,067,572.00	1.79
4	000671	阳光城	157,100	1,018,008.00	1.72
5	601156	新赫股份	21,000	871,838.00	1.47
6	000002	万科A	25,000	696,250.00	1.18
7	000899	赣锋锂业	14,400	623,160.00	1.07
8	002941	华康药业	9,000	620,088.00	1.05
9	000001	平安银行	44,100	613,210.00	1.04
10	000506	吉雷西酒	4,400	521,444.00	0.85

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	2,998,000.00	5.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,151,100.00	51.00
4	企业债券	29,851,000.00	50.49
5	企业短期融资券	18,682,509.10	31.60
6	中期票据	-	-
7	待偿还(银行交易)	6,684,403.42	11.31
8	国债逆回购	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,516,872.52	98.97

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)	占基金资产净值比例(%)
1	190321	18国债11	100,000	10,120,000.00	17.12
2	190323	18国债06	100,000	9,936,000.00	16.81
3	190325	18国债10	100,000	9,796,000.00	16.57
4	112227	19国债01	40,000	4,089,600.00	6.96
5	123007	16国债08	41,270	4,081,603.00	6.90

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
无。

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
无。

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
无。

9. 本基金本报告期末未持有贵金属。

10. 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
无。

11. 本基金本报告期末未持有权证。

12. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1本报告期末本基金未持有股指期货。

9.2本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

9.3本报告期末本基金未持有国债期货。

10. 投资报告附注
10.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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、处罚的情况。
无。

11. 平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”,股票代码:000001)于2018年7月26日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书(银反罚决字(2018)12号),因其未按照监管规定履行客户身份识别义务,违反了《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项规定,中国人民银行对其处以50万元罚款;未按照规定保存客户身份资料和交易记录,违反了《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(二)项规定,处以40万元罚款;未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,违反了《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(三)项规定,处以50万

元罚款,合计处以140万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对平安银行进行了投资。

2. 其余九名证券的发行主体本报告期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

10.2本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,406.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,188,040.24
5	应收申购款	14,907.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,200,353.11

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

8	其他	-
9	合计	1,200,353.11

10.4 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
----	------	------	---------	-----------