

(上接B118版)
3)利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略等。

②本基金将在充分考虑收益性、流动性及风险特征的基础上,积极运用监管机构允许基金投资的其他金融工具,以期降低组合风险,锁定既有收益,在一定程度上实现基金资产的保值、增值。

十、基金的业绩比较基准
80%×沪深300指数+20%中证综合债券指数

本基金作为股票型基金,股票资产占基金资产的比例范围为60%~95%,固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%~40%,所以采用股票指数和债券指数加权平均的方法作为业绩比较基准。由于沪深300指数反映了沪深两市股票综合表现的场内成份股,中证综合债券指数是反映债券投资区间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,两者均具有良好的市场代表性,因此选择沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准,同时,选取中证综合债券指数作为债券投资部分的比较基准。

如果指数编制人停止计算有关指数或更改指数名称或今后市场出现更适用于本基金的指数,本基金可以在取得基金管理人同意,报中国证监会备案后变更业绩比较基准,并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金是主动投资的股票基金,预期风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

十二、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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。

①报告期末基金资产组合情况

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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,189,291.10	3.59
B	采掘业	17,992,734.00	5.77
C	制造业	178,041,257.33	57.12
D	消费品、饮料	80,306,627.68	25.83
E	纺织、服装、皮革	7,493,500.00	2.49
F	木材、家具	-	0.00
G	造纸、印刷	-	0.00
H	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
I	电子	-	0.00
J	金属、非金属	32,585,364.96	10.45
K	机械、设备、仪表	29,407,309.09	9.43
L	医药、生物制品	28,048,455.60	9.00
M	其他	-	0.00
合计		275,829,837.70	84.89

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明细

④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债券投资

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十名权证投资

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

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十名股票支持证券投资

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十名权证投资

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十名资产支持证券投资

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十名权证投资

⑪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

⑫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权证投资

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十名资产支持证券投资

⑭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权证投资

⑮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

⑯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权证投资

⑰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

⑱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权证投资

⑲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

⑳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权证投资

㉑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

㉒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权证投资

㉓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

㉔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权证投资

㉕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

㉖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权证投资

㉗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

㉘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权证投资

㉙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

㉚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权证投资

㉛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

㉜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权证投资

㉝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

㉞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权证投资

㉟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

㉟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权证投资

㉟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

㉟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权证投资