

长信中短债证券投资基金

【2013】第四季度报告

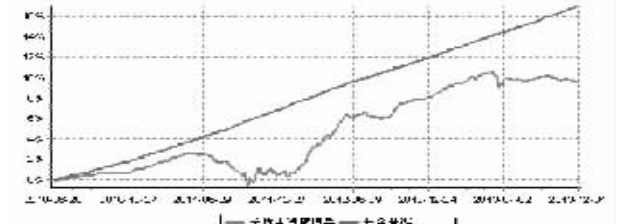
基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构在本报告中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。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

基金简称		长信中短债债券
基金主代码	519085	
交易代码	519085	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年6月28日	
报告期末基金资产总额	38,262,744.56份	
投资目标	本基金把投资组合的久期控制在三年以内,在追求本金安全和保持基金资产流动性的基础上,力争实现超越比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金为中长期债券基金,采用积极管理型的投资策略,将投资组合的久期控制在三年以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益率。	
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于低风险的基础品种。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)	
1.本期已实现收益	175,034.98	
2.本期利润	-219,247.24	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	
4.期末基金资产净值	41,949,508.26	
5.期末基金份额净值	1.0964	
注:1、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;		
2、所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(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。		
3.2 基金净值表现		
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较		
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②
过去三个月	-0.37%	0.04%
过去六个月	-0.73%	0.09%
过去一年	-1.46%	0.04%

注:1、本基金合同生效以来基金基金份额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



注:1、图示日期为2011年6月28日至2013年12月31日。
2、按基金合同规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介		任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
姓名	职务	任职日期	离任日期	
张文明	本基金基金经理、长信利鑫分级证券投资基金基金经理、长信利息收益分级证券投资基金基金经理、固定收益部副总监	2010年6月28日	19年	高级工商管理硕士,上海财经大学EMBA毕业,具有基金从业资格,曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业部经理、固定收益部交易员等职。2004年9月加入长信基金管理有限责任公司,历任长信利息收益基金交易员、基金助理、现任固定收益部副总监、本基金、长信利鑫分级证券投资基金基金经理、固定收益部副总监。

注:1、曾任基金经理任职日期以本基金成立之日为准;新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。
2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本基金管理人在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,《长信中短债证券投资基金合同》的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。
本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚信、勤勉、尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外,其余各投资组合均未参与交易所公开竞价交易,不涉及成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形,未发现异常交易行为。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2013年四季度,央行维持资产面平衡的态度更加明确,债券市场再次恐慌性下跌。2013年10月,基本面和资金面对于债市的影响均偏空,再加上债券市场供给压力增大,多数资金开始减持中短期债券,收益率曲线平坦化上移,期限利差不断收窄;中债-综合净价指数继续自2013年6月份以来的下跌,且跌幅明显再次扩大。2013年11月,公开市场回购回款

次停发导致市场情绪紧张,带动长端SHIBOR利率持续上行,债券市场大幅下挫,各类券种全线回调,上半月主要是利率债下跌,下半月利率债企稳信用债加速下行。2013年12月,年末资金面趋紧,债券收益率维持高位运行。
2013年四季度,我们根据市场变化,被动减持了部分中长期仓位,一定程度上减少了组合亏损。
4.4.2 2014年一季度市场展望和投资策略
2014年全球经济预期会出现温和稳定的复苏。以美国为代表的发达经济体复苏的趋势已经形成,全球流动性收缩成为影响2014年债券市场的主要因素之一。
2014年中国新一轮经济体制改革是重点,一系列相关措施将围绕利率市场化、货币国际化、国际资本化等展开,预期国内宏观经济出口前相对改善,房地产和基建投资受政策影响投资缓慢回升,整体消费保持平稳,总体经济可能呈现稳中趋降的态势。CPI相对稳定,货币政策将继续执行稳健的货币政策,同时可能朝着小步收紧的方向运行,预计只有在宏观经济出现严重下行风险时,央行才有可能放松货币政策。
从以上分析来看,2014年一季度债券市场延续熊市基调概率较大,收益率高位运行,熊牛转换的条件尚需进一步观察,利率债收益率大幅拉升的阶段已经结束,后市趋稳上行的空间不大,信用债调整压力犹存。
我们将采取谨慎的态度进行投资,积极防范流动性风险,密切关注国内外经济形势变化,需要重点规避信用风险,努力抓住市场结构性机会和波段行情。在基金的日常管理中,将继续秉承诚信、专业、负责的精神,密切关注政策节奏,更好地把握投资机会,争取为基金份额持有人谋求最大利益。
4.5 报告期内基金的投资表现
截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.0964元,份额累计净值为1.0964元。本报告期内本基金净值增长率为-0.37%,同期业绩比较基准收益率为1.09%。

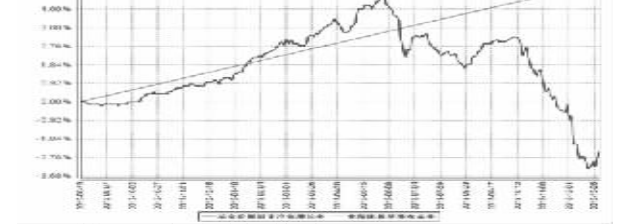
基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构在本报告中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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17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。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

基金简称		东吴保本混合
基金主代码	582003	
交易代码	582003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月13日	
报告期末基金资产总额	306,598,692.03份	
投资目标	本基金主要通过投资组合保险策略的运作,在确保保本周期到期时本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳健增长。	
投资策略	本基金遵循保本增值的投资理念,根据恒定组合投资保险策略原理进行资产配置,保证保本周期到期时本金安全,同时通过精选个股和个券实现基金资产的稳健增长。	
业绩比较基准	银行三年定期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
基金投资	中国投资担保有限公司	

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)	
1.本期已实现收益	2,077,361.71	
2.本期利润	-18,389,038.43	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0580	
4.期末基金资产净值	298,080,975.84	
5.期末基金份额净值	0.972	
注:1、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;		
2、上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。		
3.2 基金净值表现		
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较		
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②
过去三个月	-5.63%	0.25%
过去六个月	-10.73%	0.51%
过去一年	-16.70%	0.24%

注:1、本基金合同生效以来基金基金份额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



注:1、比较基准=银行三年定期存款利率(税后)。

次停发导致市场情绪紧张,带动长端SHIBOR利率持续上行,债券市场大幅下挫,各类券种全线回调,上半月主要是利率债下跌,下半月利率债企稳信用债加速下行。2013年12月,年末资金面趋紧,债券收益率维持高位运行。
2013年四季度,我们根据市场变化,被动减持了部分中长期仓位,一定程度上减少了组合亏损。
4.4.2 2014年一季度市场展望和投资策略
2014年全球经济预期会出现温和稳定的复苏。以美国为代表的发达经济体复苏的趋势已经形成,全球流动性收缩成为影响2014年债券市场的主要因素之一。
2014年中国新一轮经济体制改革是重点,一系列相关措施将围绕利率市场化、货币国际化、国际资本化等展开,预期国内宏观经济出口前相对改善,房地产和基建投资受政策影响投资缓慢回升,整体消费保持平稳,总体经济可能呈现稳中趋降的态势。CPI相对稳定,货币政策将继续执行稳健的货币政策,同时可能朝着小步收紧的方向运行,预计只有在宏观经济出现严重下行风险时,央行才有可能放松货币政策。
从以上分析来看,2014年一季度债券市场延续熊市基调概率较大,收益率高位运行,熊牛转换的条件尚需进一步观察,利率债收益率大幅拉升的阶段已经结束,后市趋稳上行的空间不大,信用债调整压力犹存。
我们将采取谨慎的态度进行投资,积极防范流动性风险,密切关注国内外经济形势变化,需要重点规避信用风险,努力抓住市场结构性机会和波段行情。在基金的日常管理中,将继续秉承诚信、专业、负责的精神,密切关注政策节奏,更好地把握投资机会,争取为基金份额持有人谋求最大利益。
4.5 报告期内基金的投资表现
截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.0964元,份额累计净值为1.0964元。本报告期内本基金净值增长率为-0.37%,同期业绩比较基准收益率为1.09%。

5.1 报告期末基金资产组合情况		金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1 权益投资	-	-	-
其中:股票	-	-	-
2 基金投资	-	-	-
3 固定收益投资	37,026,978.40	84.09	
其中:债券	37,026,978.40	84.09	
资产支持证券	-	-	-
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	6,238,517.07	14.17	
7 其他资产	765,036.99	1.74	
8 合计	44,030,532.46	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
5.4 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	29,886,000.00	71.24	
2 央行票据	-	-	-
3 金融债券	-	-	-
其中:政策性金融债	-	-	-
4 企业债券	7,140,978.40	17.02	
5 企业短期融资券	-	-	-
6 中期票据	-	-	-
7 可转债	-	-	-
8 其他	-	-	-
9 合计	37,026,978.40	88.27	

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	130014	13国债(14)	300,000	29,886,000.00	71.24
2	122020	09复地债	20,000	2,004,000.00	4.78
3	122028	09华安债	20,000	2,000,000.00	4.77
4	122810	11华平债	19,790	1,840,470.00	4.39
5	111064	11长债	8,108	788,908.40	1.88

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。
5.7 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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、处罚的情形。
5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1 存出保证金	8,370.89	
2 应收证券清算款	-	-
3 应收股利	-	-
4 应收利息	720,266.10	
5 应收申购款	36,400.00	
6 其他应收款	-	-
7 待摊费用	-	-
8 其他	-	-
9 合计	765,036.99	

5.10.4 报告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。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
5.10.6 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,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动
单位:份
报告期初基金份额总额 77,141,555.57
报告期间基金总申购份额 77,415,774.55
减:报告期间基金总赎回份额 116,294,585.56
报告期间基金净申购/赎回份额(份额减少以“-”填列) -
报告期末基金份额总额 38,262,744.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
§8 备查文件目录
1. 中国证监会批准设立基金的文件;
2. 《长信中短债证券投资基金合同》;
3. 《长信中短债证券投资基金招募说明书》;
4. 《长信中短债证券投资基金托管协议》;
5. 报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿;
6. 长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。
3.2 存放地点
基金管理人住所。
3.3 查阅方式
长信基金管理有限责任公司网站: <http://www.cxfund.com.cn>
长信基金管理有限责任公司
二〇一四年一月二十二日

长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)

【2013】第四季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构在本报告中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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月10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。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

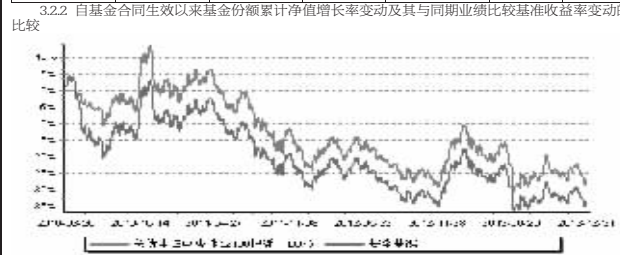
基金简称		长信中证中央企业100指数(LOF)
基金主代码	163001	
交易代码	163001	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2010年3月26日	
报告期末基金资产总额	75,831,142.19份	

本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证中央企业100指数中的基准权重构建指数化投资组合。并根据标的指数的成分股及其权重的变化进行相应的调整。
当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数的时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,使跟踪误差控制在限定的范围之内。
中证中央企业100指数收益率*95%+银行间同业存款收益率*5%
本基金为股票型指数基金,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险特征的证券投资基金产品,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。
基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标		报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)	单位:人民币元
主要财务指标			
1.本期已实现收益		-2,396,503.20	
2.本期利润		-1,367,776.13	
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0176	
4.期末基金资产净值		55,637,721.41	
5.期末基金份额净值		0.734	
注:1、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;			
2、所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(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。			

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额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



注:1、图示日期为2010年3月26日至2013年12月31日。
2、按基金合同规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例符合基金合同中的约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介		任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
姓名	职务	任职日期	离任日期	
胡皓	本基金基金经理、长信量化先锋证券投资基金基金经理、金融工程副总监	2011年9月21日	12年	经济学博士,上海财经大学世界经济专业博士研究生毕业,具有基金从业资格,曾先后担任海通证券股份有限公司研究所分析师、高级分析师、首席分析师、金融工程部门负责人等职务。2010年5月加入长信基金管理有限责任公司,担任金融工程副总监,负责量化投资管理研究工作,现兼任本基金和长信量化先锋证券投资基金的基金经理。

注:1、曾任基金经理任职日期以本基金成立之日为准;新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。
2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本基金管理人在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。
本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚信、勤勉、尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外,其余各投资组合均未参与交易所公开竞价交易,不涉及成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形,未发现异常交易行为。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
我们建立了涵盖宏观、流动、市场结构特征、交易特征等多个层面的择时模型来监测市场可能存在的结构性风险和发生的变化。从宏观层面看,市场与宏观经济之关联度在下降,对经济前景的感知感不又稳定。上市公司经营层面仍然在低位徘徊,很难看到恶化的迹象,但亦缺乏足够的证据证明微观层面已经走出困境。宏观与微观层面亦正徘徊的状态,加大了板块之间个股选中的重要性,而投资者的情绪也在这一过程中扮演着重要的角色。展望未来,我们倾向于认为,中国乃至全球经济的走向仍有待进一步判断,而中国宏观经济政策的效果仍有待观察,并将对股市产生重大的影响,市场结构性分化格局也将因此而持续且更为复杂。
作为一只指数基金,我们将按照基金合同的约定,严守指数基金被动化投资的目标,通过严格的投

代		行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-	-
B	采矿业	-	-	-
C	制造业	23,674,474.07	7.94	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
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业	-	-	-
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	-	-	-
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	-	-	-
S	综合	-	-	-
合计	-	-	23,674,474.07	7.94

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

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	002317	众生药业	499,990	9,849,803.00	3.30
2	000915	山大华特	264,917	8,135,601.07	2.73
3	602507	涪陵榨菜	130,150	4,919,670.00	1.65
4	000872	中恒高新	50,000	568,500.00	0.19
5	600499	科达股份	10,000	200,900.00	0.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 国债债券	34,198,500.00	11.47	
2 央行票据	-	-	-
3 金融债券	-	-	-
其中:政策性金融债	-	-	-
4 企业债券	380,923,502.70	127.79	
5 企业短期融资券	-	-	-
6 中期票据	116,477,000.00	39.08	
7 可转债	15,825,128.20	5.31	
8 其他	-	-	-
9 合计	547,424,130.90	183.65	

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	122214	12大债	400,000	39,112,000.00	13.12
2	124315	13国债(15)	400,000	37,600,000.00	12.61
3	1382102	13国债(10)	300,000	28,983,000.00	9.72
4	1080051	10大债	300,000	28,977,000.00	9.72
5	122710	12国债(10)	231,850	23,335,702.50	7.83

5.6 报告期末按公允价值占基金