

信息披露 Disclosure

(上接B020版)

电话:0571-56029620
传真:0571-56899710
客户服务电话:4000680068
公司网站: <http://www.jincheng-fund.com/>
(115) 久富财富
注册地址:上海市浦东新区莱阳路2819号1幢1015室
办公地址:上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人:王惠德
联系人:徐金华
电话:021-66868525
传真:021-66862257
客户服务电话:400-821-9898
公司网站: www.fcteam.com
(116) 钱银财富
注册地址:上海市嘉定区丹桂路610号9层1008-1012
办公地址:上海市浦东新区丹桂路610号9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:蒋冲
电话:010-67418929
传真:010-67563671
客户服务电话:400-606-5095
公司网站: www.niuji.net
(117) 鼎正行
注册地址:上海市虹口区虹飞路306弄9号3724室
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼
法定代表人:汪静波
联系人:王霞
电话:021-36600735
传真:021-36509777
客户服务电话:400-821-5399
公司网站: www.noah-fund.com
(118) 上海长量
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢2202室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道55号裕景国际B座16层
法定代表人:张庆伟
联系人:单伟峰
电话:021-60801935
传真:021-20681861
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com
(119) 深圳银兰德
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:上海市西城区金融大街35号国金大厦2层9层
法定代表人:陈鼎
联系人:王正文
电话:010-58325356
传真:010-58325282
客户服务电话:4008627771
公司网站: <https://t.ji.com>
(120) 晟视天下
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座29层
法定代表人:蒋煜
联系人:徐长江、崔乐东
电话:01058170543/01058170949
传真:01058170900
客户服务电话:4008188866
公司网站: www.shengshiview.com
(121) 天基金
注册地址:杭州市余杭区仓前文一路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏松
联系人:李翰
联系电话:021-60897840
客户服务电话:4000-766-123
传真:0571-22639713
公司网站: <http://www.fund123.cn/>
(122) 天天基金
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3层310楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
联系电话:021-54509998
客户服务电话:400-1818-189
传真:021-64385308
网址: www.1234567.com.cn
(123) 同花顺
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:胡蝶
联系电话:0571-88918118
传真:0571-88928097/4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com
(124) 万联财富
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大厦C201
联系人:陶海斌
电话:010-59393923
传真:010-59393974
客服电话:400-808-0069
公司网站: <http://www.wy-wfund.com>
(125) 一路财富
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
法定代表人:吴雪涛
联系人:阮京磊
电话:010-88312877
传真:010-88312885
客户服务电话:400-400-1566
公司网站: www.yilucaifu.com
(126) 宜信普泽
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:李庆伟
联系人:程刚
电话:010-59484265
客户服务电话:400-6099-200
公司网站: www.yixinfund.com
(127) 展恒基金
注册地址:北京市朝阳区义顺后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:周振杰
联系人:崔飞
电话:010-56029620
传真:0571-56899710
客户服务电话:4000680068
公司网站: <http://www.jincheng-fund.com/>
(115) 久富财富
注册地址:上海市浦东新区莱阳路2819号1幢1015室
办公地址:上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人:王惠德
联系人:徐金华
电话:021-66868525
传真:021-66862257
客户服务电话:400-821-9898
公司网站: www.fcteam.com
(116) 钱银财富
注册地址:上海市嘉定区丹桂路610号9层1008-1012
办公地址:上海市浦东新区丹桂路610号9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:蒋冲
电话:010-67418929
传真:010-67563671
客户服务电话:400-606-5095
公司网站: www.niuji.net
(117) 鼎正行
注册地址:上海市虹口区虹飞路306弄9号3724室
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼
法定代表人:汪静波
联系人:王霞
电话:021-36600735
传真:021-36509777
客户服务电话:400-821-5399
公司网站: www.noah-fund.com
(118) 上海长量
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢2202室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道55号裕景国际B座16层
法定代表人:张庆伟
联系人:单伟峰
电话:021-60801935
传真:021-20681861
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com
(119) 深圳银兰德
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:上海市西城区金融大街35号国金大厦2层9层
法定代表人:陈鼎
联系人:王正文
电话:010-58325356
传真:010-58325282
客户服务电话:4008627771
公司网站: <https://t.ji.com>
(120) 晟视天下
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座29层
法定代表人:蒋煜
联系人:徐长江、崔乐东
电话:01058170543/01058170949
传真:01058170900
客户服务电话:4008188866
公司网站: www.shengshiview.com
(121) 天基金
注册地址:杭州市余杭区仓前文一路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏松
联系人:李翰
联系电话:021-60897840
客户服务电话:4000-766-123
传真:0571-22639713
公司网站: <http://www.fund123.cn/>
(122) 天天基金
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3层310楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
联系电话:021-54509998
客户服务电话:400-1818-189
传真:021-64385308
网址: www.1234567.com.cn
(123) 同花顺
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:胡蝶
联系电话:0571-88918118
传真:0571-88928097/4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com
(124) 万联财富
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大厦C201
联系人:陶海斌
电话:010-59393923
传真:010-59393974
客服电话:400-808-0069
公司网站: <http://www.wy-wfund.com>
(125) 一路财富
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
法定代表人:吴雪涛
联系人:阮京磊
电话:010-88312877
传真:010-88312885
客户服务电话:400-400-1566
公司网站: www.yilucaifu.com
(126) 宜信普泽
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:李庆伟
联系人:程刚
电话:010-59484265
客户服务电话:400-6099-200
公司网站: www.yixinfund.com
(127) 展恒基金
注册地址:北京市朝阳区义顺后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:周振杰
联系人:崔飞
电话:010-56029620
传真:0571-56899710
客户服务电话:4000680068
公司网站: <http://www.jincheng-fund.com/>

[illegible][illegible]

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	600583	海油工程	72,920,000	545,070,000.00	8.91	
2	002400	广生股份	15,180,000	487,760,000.00	7.94	
3	300315	宝德科技	12,887,373	432,141,283.14	6.74	
4	300228	富星特科	6,599,300	389,397,405.00	6.36	
5	300017	网宿科技	3,700,000	380,796,000.00	6.35	
6	000049	誉衡药业	6,562,000	349,437,380.00	5.63	
7	002456	欧菲光	7,600,000	319,960,000.00	5.23	
8	601012	隆基股份	22,000,000	289,300,000.00	4.73	
9	002605	东华软件	6,719,967	271,217,868.12	4.43	
10	300273	汇金股份	6,769,795	228,299,776.60	3.68	
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五名债券投资明细						
序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	国债逆回购		--	--	--	
2	央行票据		--	--	--	
3	金融债券		299,678,000.00	4.90		
4	其他非金融企业债务融资工具		96,620,488.80	0.60		
5	中期票据		--	--	--	
6	中期票据		--	--	--	
7	可转债		1,446,246.40	0.02		
8	其他		--	--	--	
9	合计		337,744,735.20	5.52		
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	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	130403	13国开43	1,800,000	179,766,000.00	2.94	
2	130236	13国开36	500,000	49,945,000.00	0.82	
3	130218	13国开18	400,000	40,000,000.00	0.65	
10	121218	12金融债	379,200	36,420,000.00	0.60	
5	130808	13国开08	300,000	29,907,000.00	0.49	
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明细						
本基金本报告期末未持有资产支持证券。						
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						
本基金本报告期末未持有贵金属。						
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						
本基金本报告期末未持有权证。						
9. 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。						
10. 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。						
11. 投资组合报告附注						
(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。						
(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。						
(3) 其他各项资产构成						
序号	资产名称	金额(元)				
1	存出保证金	1,715,543.12				
2	应收证券清算款	30,483,153.43				
3	应收账款	--				
4	应收利息	7,586,640.93				
5	应收申购款	12,861,987.07				
6	其他应收款	--				
7	待摊费用	--				
8	其他	--				
9	合计	52,647,326.55				
(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(%)		
1	110122	同仁转债	1,446,246.40	0.02		
(5) 报告期末前十名股票受调研情况的说明						
序号	股票代码	股票名称	披露受调研后公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	披露受调研情况说明	
1	300273	汇金股份	228,299,776.60	3.68	董事、高级管理人员通过调研	
2	600583	海油工程	161,652,000.00	2.64	非公开调研、行业访谈	
十二、基金的投资组合报告						
本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预示其未来业绩表现,投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等全面评估是否认						
自基金合同生效以来(截至2007年12月31日)的资产配置及与同期基准的比较如下表所示:						
阶段	净值增长 率①	净值增长 率②	净值比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率④	①-③	②-④
2007年12月18 日至2007年12月31日	10.78%	0.83%	7.98%	0.89%	2.80%	-0.06%
200						

(2) 基金托管人的托管费；
(3) 基金的证券交易费用；
(4) 信息披露费用；
(5) 基金份额持有人大会费用；
(6) 会计师事务所审计费；
(7) 在中国证监会有关规定的前提下，基金管理人按照有关规定收取的基金托管费；
(8) 银行汇划手续费；
(9) 按照国家有关规定在基金合同约定中可以列入的其他费用。
上述费用从基金财产中支付，按实际支付金额从基金财产净值中扣除。
2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(1) 基金管理人管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：
$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、公休日等，可顺延支付。
(2) 基金托管人托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、公休日等，可顺延支付。
(3) 销售服务费
本基金管理人根据基金投资人长期持有或未来长期持有导致的使用支出或损失的损失，使用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
3. 不列入基金费用的项目
基金管理人及基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。
4. 基金费用的调整
基金管理人可根据基金申购和赎回的情况调整基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须遵守新的费率实施前2日在至少一种媒体上刊登公告。
5. 与基金销售有关的费用
1. 申购费
(1) 申购费率
本基金申购费率如下表所示：
申购金额(含申购费) 申购费率
M≥100万 按收取金额/1000元
50万≤M<100万 0.005%
10万≤M<50万 0.12%
M<10万 0.15%
其他投资者通过基金销售机构的申购费率：
申购金额(M) (含申购费) 申购费率
M≥100万 按收取金额/1000元
50万≤M<100万 0.3%
10万≤M<50万 0.2%
M<10万 1.5%
(2) 申购费收取方式和用途
本基金申购费采取前端收费，前端收费的形式收取申购费用，投资者在一天之内如多次申购，适用费率按申购费率分别计算。
本基金的申购费用由申购人承担，由本基金的市场推广、销售、注册登记等费用，不列入基金资产。
2. 赎回费
(1) 赎回费率
本基金的赎回费率根据持有期限的不同分为三档。持有期限的起始日为基金赎回日。

持有时间(天)	赎回费率
0~364	0.50%
365~729	0.25%
730及以上	0.00%

注：对于投资者在基金退市前持有的原科讯基金份额，持有期限自赎回前最后一个交易日开始计算。对于集中申购所得的基金份额，持有期限自集中申购结束后开始计算并登记过户确认之日起计算。
(2) 赎回费的收取和用途
本基金赎回费由赎回人承担，赎回费的25%归基金资产，其余用于支付注册登记费和必要的业务费。
3. 转换费率
目前，基金管理人已开通了本基金与旗下部分开放式基金之间的转换业务，具体转换费率，请具体投资者于网站上查询。
4. 投资者通过本公司网上交易系统(www.fundsc.com.cn)进行申购、赎回和基金转换业务，请具体投资者于网站上查询申购、赎回和基金转换业务。
5. 基金管理人有权根据基金合同中的约定，对持有基金的持续持有期限和基金份额持有人，具体办法按中国证监会有关规定执行。
6. 基金管理人可在基金合同规定的范围内调整上述费率，上述费率如发生变更基金管理人应最迟于变更前2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。
7. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的前提下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式(如网上交易、电话交易、手机交易)和特定交易行为制定相应的费率优惠计划，定期或不定期开展基金促销活动，具体费率优惠方案届时另行公告。
(二) 赎回费说明基金赎回后的说明
1. 在“二、释义”部分，更新了部分表述
2. 在“基金管理人”部分，更新了部分内容
3. 在“四、基金服务机构”部分，根据最新业务进行了更新
4. 在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构信息
5. 在“六、基金转换”部分，更新了部分表述
6. 在“十二、基金的投资”部分，补充了本基金2014年第1季度投资组合报告的内容
7. 在“十三、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩数据。
8. 在“二十二、其他应披露事项”部分，根据相关公告内容进行了更新。
易方达基金管理有限公司
2014年06月10日

()

上海E017版

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城2座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程莉
电话：010-52866713
传真：010-52866285
客户服务热线：400-6398-200
公司网站：www.yixindun.com
(11) 新源盛昌
注册地址：北京市顺义区沙岭乡顺安镇新街号
法定代表人：王吉明
联系人：王吉明
联系人：董飞
联系电话：010-62000089
客户服务热线：400-888-6661
电话：010-62002026
公司网站：www.mzfund.com
(12) 明裕投资
注册地址：北京市朝阳区南礼士路66号B1楼建大1208室
办公地址：北京市朝阳区南礼士路66号B1楼建大1208-1209室
法定代表人：孙晓强
联系人：孙晓强
联系人：陈瑞
电话：010-67000088
客户服务热线：400-001-8811
公司网站：www.zwccom.com
(13) 中恒信实
注册地址：北京市朝阳区建国路198号光合14号楼1层、2层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区建国路198号光合14号楼1层、2层、11层、12层
法定代表人：王兵
联系人：孟强
电话：010-58563661
电话：010-58563806
客户服务热线：010-6126
公司网站：http://www.wcdtsonet/
(12) 中恒信实
注册地址：北京市朝阳区建国路198号光合14号楼11楼1103号
办公地址：北京市朝阳区建国路198号光合14号楼11楼
法定代表人：张勇
联系人：侯保强
电话：010-68807995
电话：010-68807864
客户服务热线：010-68807609
(12) 众联基金
注册地址：深圳市福田区深南东路6047号发展银行大厦25层11单元
办公地址：深圳市福田区深南东路6047号发展银行大厦25层11单元
法定代表人：薛峰
联系人：李海阳
电话：0755-33227950
电话：0755-12080780
客户服务热线：400-788-887
公司网站：www.21fund.com www.jmmw.com
(一) 基金投资顾问机构
名称：北京泛基资产管理有限责任公司
注册地址：广东深圳市福田区深南东路4004号404-404B
办公地址：广州市天河区珠江新城华夏东路30号广州国际大厦404-404楼
法定代表人：李海阳
电话：4008818008
电话：020-37876249
联系人：李海阳
(三) 律师事务所和经办律师
名称：上海浦东律师事务所
住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人：李海阳
联系电话：(021) 35115038
传真：(021) 35115038
联系人：李海阳
经办律师：梁国忠、刘佳
(四) 会计师事务所和基金会计
会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区东长安路1号东方广场6楼A1701-12楼
负责人：李海阳、Albert Kong 冯英 冯瑞平
电话：010-58130030
传真：010-58130288
经办注册会计师：曹宁、周刚

[illegible]

及支付的费用；		序号		债券代码	债券名称
1. 信用评级：信用评级高的品种进行投资；		1	122616	12鄂铁债	
2. 分散投资：分散投资于不同品种、不同行业、不同地区、不同期限、不同发行主体的债券；		2	110024	隧道转债	
3. 风险控制：建立风险控制体系及风险管理制度，对人所投资品种的信用风险、利率风险、流动性风险等进行评估、监控；		3	113003	重工转债	
4. 基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选		4	130242	13国开42	
择长期、市场容量大、信用等级高、参考票面利率的可转债及		5	130218	13国开18	
风险等因素的因素分析，判断其具备投资价值时，采用		6. 报告期内未兑付的可转债占基金资产净值的比例			
进行定价分析，确定可转换债券的投资策略。		序号	证券代码	证券名称	
5. 转换风险控制：基金管理人将严格执行风险控制制度，		1	119032	瀚润J1	
防范下跌风险作为首要因素进行考虑，并严格控制		2	119031	瀚润J3	
持仓的大小，并根据过往新进的持仓数及上市日报		7. 报告期内未兑付的可转债占基金资产净值的比例			
告的变化，及时调整持仓比例。		本基金本报告期末未持有可转债。			
6. 分散投资：分散投资于不同品种、不同行业、不同地区、不同期限、不同发行主体的债券；		8. 报告期内未兑付的可转债占基金资产净值的比例			
7. 风险控制：建立风险控制体系及风险管理制度，对人所投资品种的信用风险、利率风险、流动性风险等进行评估、监控；		本基金本报告期末未持有可转债。			
8. 基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选		9. 报告期内未兑付的可转债占基金资产净值的比例			
择长期、市场容量大、信用等级高、参考票面利率的可转债及		本基金本报告期末未持有可转债。			
风险等因素的因素分析，判断其具备投资价值时，采用		10. 报告期内未兑付的可转债占基金资产净值的比例			
进行定价分析，确定可转换债券的投资策略。		本基金本报告期末未持有可转债。			
9. 转换风险控制：基金管理人将严格执行风险控制制度，		11. 报告期内未兑付的可转债占基金资产净值的比例			
防范下跌风险作为首要因素进行考虑，并严格控制		本基金本报告期末未持有可转债。			
持仓的大小，并根据过往新进的持仓数及上市日报		本基金本报告期末未持有可转债。			
告的变化，及时调整持仓比例。		本基金本报告期末未持有可转债。			
10. 分散投资：分散投资于不同品种、不同行业、不同地区、不同期限、不同发行主体的债券；		本基金本报告期末未持有可转债。			
11. 风险控制：建立风险控制体系及风险管理制度，对人所投资品种的信用风险、利率风险、流动性风险等进行评估、监控；		本基金本报告期末未持有可转债。			
12. 基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选		本基金本报告期末未持有可转债。			
择长期、市场容量大、信用等级高、参考票面利率的可转债及		本基金本报告期末未持有可转债。			
风险等因素的因素分析，判断其具备投资价值时，采用		本基金本报告期末未持有可转债。			
进行定价分析，确定可转换债券的投资策略。		本基金本报告期末未持有可转债。			
13. 转换风险控制：基金管理人将严格执行风险控制制度，		本基金本报告期末未持有可转债。			
防范下跌风险作为首要因素进行考虑，并严格控制		本基金本报告期末未持有可转债。			
持仓的大小，并根据过往新进的持仓数及上市日报		本基金本报告期末未持有可转债。			
告的变化，及时调整持仓比例。		本基金本报告期末未持有可转债。			
14. 分散投资：分散投资于不同品种、不同行业、不同地区、不同期限、不同发行主体的债券；		本基金本报告期末未持有可转债。			
15. 风险控制：建立风险控制体系及风险管理制度，对人所投资品种的信用风险、利率风险、流动性风险等进行评估、监控；		本基金本报告期末未持有可转债。			
16. 基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选		本基金本报告期末未持有可转债。			
择长期、市场容量大、信用等级高、参考票面利率的可转债及		本基金本报告期末未持有可转债。			
风险等因素的因素分析，判断其具备投资价值时，采用		本基金本报告期末未持有可转债。			
进行定价分析，确定可转换债券的投资策略。		本基金本报告期末未持有可转债。			
17. 转换风险控制：基金管理人将严格执行风险控制制度，		本基金本报告期末未持有可转债。			
防范下跌风险作为首要因素进行考虑，并严格控制		本基金本报告期末未持有可转债。			
持仓的大小，并根据过往新进的持仓数及上市日报		本基金本报告期末未持有可转债。			
告的变化，及时调整持仓比例。		本基金本报告期末未持有可转债。			
18. 分散投资：分散投资于不同品种、不同行业、不同地区、不同期限、不同发行主体的债券；		本基金本报告期末未持有可转债。			
19. 风险控制：建立风险控制体系及风险管理制度，对人所投资品种的信用风险、利率风险、流动性风险等进行评估、监控；		本基金本报告期末未持有可转债。			
20. 基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选		本基金本报告期末未持有可转债。			
择长期、市场容量大、信用等级高、参考票面利率的可转债及		本基金本报告期末未持有可转债。			
风险等因素的因素分析，判断其具备投资价值时，采用					

数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
400,000	40,400,000.00	8.94
371,600	38,436,462.90	8.51
308,550	32,292,843.90	7.15
300,000	30,132,000.00	6.67
300,000	30,000,000.00	6.64

报告期内前十名资产支持证券投资明细

面值(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
230,000.00	23,000,000.00	5.09
90,000.00	9,000,000.00	1.99

报告期内前五名贵金属投资明细

报告期内前五名权证投资明细

报告期内所有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、或处于被监管处罚的违规股票清单。

金额(元)
227,186.17
6,048,273.01
-
8,302,723.82
30,362,689.13
-
-
44,940,872.13

名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
	38,436,462.90	8.51
	32,292,843.90	7.15
	20,106,024.96	4.45
	15,140,681.00	3.35
	15,012,195.84	3.32
	12,486,258.30	2.76
	10,722,251.10	2.37
	10,237,000.00	2.27
	7,083,602.09	1.57
	3,056,818.82	0.68

(3) 基金的证券组合
 ① 按行业分类
 本基金资产配置
 本基金管理人
 本基金管理理人
 $H = R \times 0.70\%$
 I 为每日应付指
 按前一日的基
 基金管理费每
 日计提一次。
 管理人后续于次月支付。
 延。

(2) 基金托管人
 本基金托管费
 $H = R \times 0.20\%$
 I 为每日应付指
 按前一日的基
 基金托管费每
 日计提一次。
 (3) 销售服务费
 本基金A类基
 金基金份额持
 前值服务费的
 $H = R \times 0.40\%$
 I 为B类基金份
 E 为B类基金份
 基金申购费用
 后于次月首日起扣
 始计算。基金管
 理人应就本基
 前值服务费的
 基金托管人使
 用不纳入基金
 下列内容：(1)
 ①基金管理人
 ②基金管理人
 GIV 基金合同
 ④其他法律相
 A基金管理人
 基金管理人承
 费率。
 ③基金管理人
 托管费率或由
 基金管理人必
 (二)与基金销
 1. 申购费：
 本基金对通过
 特定投资群体
 首次认购或申
 如将来出现以
 基金管理人可
 通过基金管理
 其部投资者出
 现。

水基金类基金
 (2) 申购费及
 在申购费按金

(基金费用)可以在基金资产净值中列支的其他费用。

基金费用,按实际支出金额从基金财产中逐日扣除。

赎回费支付方式:

①基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:

数

管理费

②自计提至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托
管工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

数

③基金资产净值的0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下:

数

托管费

④自计提至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托
管工作日内从基金财产中一次性支付。遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

收取的销售服务费:A类基金份额的销售服务费率年为0.40%。

①-均按基金资产净值0.40%/年费率计提。如下:

数

基金财产净值

基金销售服务费

A类基金份额净值

基金管理人向基金托管人向基金托管人发送基金销售服务费支付指令,经基金托管人复核从基
金财产中一次性划出,由注册登记机构代收,注册登记机构和收到后按相关合同约定支付予注册
登记人(公会和券商),支付日期顺延。

基金销售服务费,以及基金管理人或基金管理人广告、促销活动费、基金份额持有人服务费等,
均由基金承担并在其中使用。

基金其他各项费用,根据有关法律法规及相应协议约定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基
金中其他款项列支。

因:
①管理人未履行或未完全履行义务导致的使用支出或基金财产的损失;
②他人处理与基金财产无关的事项造成的损失;
③不可抗力,包括但不限于战争、自然灾害、会计系统故障、信息数据泄露等等费用;
④和中国证监会的有关规定不列入基金费用的项目。

为协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率,基金托管费率,基金销售费率等相关
费率。须经基金份额持有人大会审议通过;调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率,基
金管理人无须召开基金份额持有人大会。

基金费用

基金费用

申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

本基金基金,依法设立的基本养老金账户,依法制定退休基金计划并筹集的资金及其投资运
营收益,在符合法律法规的前提下,可投资于本基金。其投资所获得的利益将作为社会保障基金
的公共积累,享受税收优惠的个人养老帐户,经证券监管部门认可的新的养老基金类型,
以及其他符合规定的养老基金品种。

其中,申报基金A类基金份额的特定投资群体申购费率见表:

A类基金份额申购金额M(元)	A类基金份额申购费率
M<100万	0.8%
10万≤M<500万	0.04%
1万≤M<100万	0.01%
M≥1000万	1000元/笔

A类基金份额的申购费率表主表:

A类基金份额申购金额M(元)	A类基金份额申购费率
M<100万	0.8%
10万≤M<500万	0.4%
1万≤M<100万	0.1%
M≥1000万	1000元/笔

申购费

申购费

如果投资者多次申购,申购费用用单笔申购金额对应的费率。