

(上接A38版)

客户服务电话: 400-897-8927
(91) 中国证券有限责任公司
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01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
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、18层至21层
法定代表人: 陈共炎
电话: 0755-82623432
0755-82625449
联系人: 刘娜
网址: www.china-inv.cn
客户服务电话: 400-600-8008、365332
(92) 中国证监会有限责任公司
住所: 深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址: 深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人: 吴培彬
电话: 0755-82570886
0755-82600682
联系人: 李静
网址: www.csrc.com.cn
客户服务电话: 400-102-2011
(93) 西南证券股份有限公司
住所: 拉萨市北京中路101号
办公地址: 上海市北京东路118弄东方企业广场24号
法定代表人: 吴伟
电话: 021-36533017
021-36533017
联系人: 王艳光
网址: www.swsec.com.cn
客户服务电话: 400-881-1177
(94) 中信证券有限责任公司
住所: 呼和浩特市新城区锡林南路10号
办公地址: 呼和浩特市新城区锡林南路10号
法定代表人: 孔凡欣
电话: 010-88086830-730、010-88086830-737
010-66412537
联系人: 陈希彤、朱晓光
网址: www.citics.com.cn
客户服务电话: 400-666-2288
(96) 国泰君安证券股份有限公司
住所: 中国上海市浦东新区东城路8号
办公地址: 上海市浦东新区东城路8号
法定代表人: 陈兵
电话: 022-86690126
022-86690126
联系人: 刘一
网址: www.gtja.com.cn
客户服务电话: 95105111 (四川地区)、400-660-0109 (全国)
(97) 中国民族证券有限责任公司
住所: 北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层
办公地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人: 赵大建
电话: 010-59356941
010-59356941
联系人: 李娜
网址: www.e518.com.cn
客户服务电话: 400-889-5618
(98) 华宝证券有限责任公司
住所: 上海市浦东新区世纪大道1668号27楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1668号27楼
法定代表人: 陈林
电话: 021-50122128
021-50122338
联系人: 徐方华
网址: www.cmbstock.com
客户服务电话: 400-820-9898
(99) 厦门证券有限公司
住所: 厦门市莲前西路2号莲前大厦十一楼
办公地址: 厦门市莲前西路2号莲前大厦十一楼
法定代表人: 陈林
电话: 021-50122128
021-50122338
联系人: 陈林
网址: www.xmzq.com.cn
客户服务电话: 021-63340678
(101) 华融证券股份有限公司
住所: 北京市西城区月坛南街26号
办公地址: 北京市西城区金融大街A座3层、5层
法定代表人: 宋广文
电话: 010-56562625
010-56562625
联系人: 董明
网址: www.hrsec.com.cn
客户服务电话: 010-56561818
(102) 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: 027-87188663
027-87188663
联系人: 董明
网址: www.tfzq.com.cn
客户服务电话: 028-86711410、027-87618882

3. 场内代销机构
4. 基金管理人可以通过具有“证券基金”基金业务资格的证券公司办理申购业务。
5. 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。销售机构可以根据实际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7号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街7号
法定代表人: 周明
联系电话: 010-57763898
联系传真: 010-50938870
联系人: 陈桐桐
(三) 律师事务所
名称: 北京炜天律师事务所
住所: 北京市西城区丰盛胡同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: 王立华
联系电话: 010-23228868
联系传真: 010-57763777
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号展展大厦2楼
执行事务合伙人: 杨绍信
联系电话: 021-23228868
联系传真: 021-23238800
联系人: 许康祺、洪洪
经办注册会计师: 许康祺、洪洪

基金名称: 华夏平衡增长混合型证券投资基金
基金类型: 混合型基金

本基金的投资目标: 在运用TTP投资策略和风险控制策略的基础上, 通过实施主动资产配置, 精选证券投资、金融衍生工具投资等多种积极策略, 追求基金资产的持续、稳健增值。

本基金的投资范围: 限于具有良好流动性的金融工具, 包括但不限于依法公开发行的上市股票、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, 本基金股票投资比例范围为70%-95%, 权证投资比例范围为0%-3%; 债券投资比例范围为0%-30%, 资产支持证券投资比例范围为0%-20%; 现金以及到期日在1年以内的国债、政策性金融债和短期融资券的投资比例不低于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, 将其纳入本基金的投资范围; 如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券投资的比例限制的, 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。

积极投资政策的运用是基金取得超额收益的主要来源, 而严格风险控制和规范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. 定量分析的主要指标包括GDP增长率、消费者价格指数(CPI)增长率、A股市场主要指数增长率、A股市场收益率、国债基准利率、A股市场平均市盈率及其变化趋势、各市场成交量及其变化趋势等; 定性分析重点关注国家财政、货币政策、汇率政策及证券市场政策, 以及经济和行业景气周期等。

2. 本基金将运用TTP策略(时间不变性投资组合保险策略), 对股票资产配置的波动进行监控。
TTP策略的基本公式如下:

其中, E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表示安全垫; 而A、E和M均可受投资组合的风险控制水平影响。
TTP策略是指, 期初根据投资者对风险和回报的要求设定风险控制水平(A), 此后, 安全垫(F)不随时间调整, 而是随着投资组合价值(A)的变动而调整。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不受, 保证组合安全。

本基金在实际操作中, 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, 在此基础上调整积极资产配置策略, 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
本基金以价值投资理念为基础, 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; 同时结合估值水平和技术面分析, 追求合理买入价格和最佳卖出时机, 从而在控制风险的前提下实现超额收益。
本基金分析的主要因素包括: 产品品质及增长率、营业利润率(分解为产品附加值及价格变动趋势、营运效率、成本控制等)、投资资本(过去年度经营带来的盈利增长)、管理(体现在产品研发、客户信息管理、销售网络、环保、社会形象、人才激励、品牌和质量等)、宏观经济和商品生命周期、需求和下游市场、现有行业和公司产能利用及以新增产能利用率等。
对于重点关注的股票, 我们将通过跟踪其他估值水平、与市场、同行业估值水平进行比较, 结合市场成交量、换手率、分析师评级等技术指标, 为基金寻找最佳的买入、卖出时机, 以降低投资组合成本同时控制下行风险。

(三) 债券投资策略
本基金将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. 收益曲线配置策略
在久期调整的基础上, 根据对收益曲线形状变化的预测, 采用子弹型策略、哑铃型策略或梯型策略。在长期、中期和短期债券间进行配置, 以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。预期中期和短期债券将发生移动或变化时, 将采取哑铃型策略, 跟踪收益曲线变动, 将采取子弹型策略。
3. 债券类属配置策略
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, 增持价值被相对低估的债券板块, 减持价值被相对高估的债券板块, 以期获得超额收益。其具体策略包括: 在预期利率下降时, 增持长期债券; 在预期利率上升时, 增持短期债券; 在预期利率不变时, 增持中期债券。

(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, 在采用成本化估值模型的前提下, 根据对权证发行价格的预期, 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风险低且可预期的新股申购、债券回购等投资, 以增加收益。

基金
本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国A600指数, 债券投资的业绩比较基准为中债综合指数(财富)。基金整体业绩比较基准构成:
基金收益参考=富时中国A600指数收益率×50%+中债综合指数(财富)收益率×50%
富时中国A600指数是市值最大的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。
未来, 如基金指数编制机构变更, 或市场出现更具代表性更强、投资者认同度更高的指数, 或原指数编制机构变更或变更原指数的编制及发布, 基金管理人可在履行适当程序后, 变更本基金的业绩比较基准或构成。
十、基金的风险收益特征
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、基金的投资组合报告
基金管理人承诺本基金不存在虚假记载、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。
基金托管人中国工商银行根据本基金合同约定, 于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2014年6月30日, 本报告中列列数据未经审计。

(一) 报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	3,346,433,856.19	87.77
2	固定收益投资	322,735,536.00	8.61
3	其中: 债券	322,735,536.00	8.61
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	132,181,137.82	3.47
9	其他各项资产	11,404,950.33	0.30
10	合计	3,812,758,480.36	100.00

(二) 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	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,987,852,036.79	53.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,709,113.72	2.55
E	建筑业	27,900,000.00	0.74
F	批发和零售业	199,469.40	0.04
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	647,283,092.52	17.28
J	金融业	78,319,035.92	2.08
K	房地产业	74,119,057.13	1.99
L	租赁和商务服务业	194,182,000.00	5.18
M	科学研究和技术服务业	85,933,963.75	2.29
N	水利、环境和公共设施管理业	156,024,626.74	4.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	3,346,433,856.19	89.32

(三) 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			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	002551	顺荣房产	8,116,049
2	300104	乐视网	201,940,000.00
3	002400	广汇集团	7,900,000
4	600066	长城证券	13,603,722
5	600699	华邦医药	10,980,296
6	002594	比亚迪	2,399,558
7	002087	伊利股份	3,900,000
8	002000	安徽文峰	3,642,485
9	600699	华邦医药	3,999,768
10	300070	碧水源	3,239,193

(四) 报告期末按品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	公允价值	占基金总资产比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	180,020,000.00	4.80
4	其中: 政策性金融债	180,020,000.00	4.80
5	企业债券	142,587,024.00	3.80
6	中期票据	-	-
7	可转债	328,512.00	0.01
8	其他	-	-
9	合计	322,735,536.00	8.61

(五) 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			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	068007	06国债(16)	1,100,000
2	120319	12国开19	800,000
3	140077	14国开07	400,000
4	140012	14国开01	400,000
5	122149	12国开49	331,440

(六) 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			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	068007	06国债(16)	1,100,000
2	120319	12国开19	800,000
3	140077	14国开07	400,000
4	140012	14国开01	400,000
5	122149	12国开49	331,440

证券投资明细
本基金报告期末未持有资产支持证券。
(七) 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
本基金报告期末未持有贵金属。
(八) 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
本基金报告期末未持有权证。
(九) 报告期末本基金投资组合股指期货交易情况说明
1. 报告期末本基金投资组合股指期货持仓和损益明细
本基金报告期末无股指期货持仓。
2. 本基金股指期货持仓和损益明细
本基金报告期末无股指期货持仓。
(十) 报告期末本基金投资组合国债期货交易情况说明
1. 本期国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
2. 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(二十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(三十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(四十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(五十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(六十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(七十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(八十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十一) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十二) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十三) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十四) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十五) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十六) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十七) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十八) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(九十九) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。
(一百) 报告期末本基金投资组合国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末无国债期货持仓。

单位: 人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	872,368.52	2.29
2	应收证券清算款	6,842,386.17	18.00
3	应收利息	-	-
4	应收股利	3,614,001.85	9.50
5	应收申购款	76,293.81	0.20
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	11,404,950.33	3.00

4. 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
1	110023	民生转债	328,512.00

5. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明			
序号	股票代码	股票名称	公允价值
1	002551	顺荣房产	278,936,163.64

6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分			
1	002551	顺荣房产	278,936,163.64

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。投资风险, 投资者在做出投资决策前请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据。
(一) 基金运作费用
1. 基金运作费用
基金运作过程中, 从基金财产中支付的费用包括:
(1) 基金管理人的管理费。
(2) 基金托管人的托管费。
(3) 因基金的证券交易费用而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)。
(4) 基金资产净值。
(5) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所信息披露费。
(6) 基金资产净值。
(7) 按照相关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。
(二) 基金费用的项目、计提标准、计提方式与支付方式
(1) 基金管理人的管理费
在通常情况下, 基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如:
H = E × 1.5% × 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
基金管理费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(2) 基金托管人的托管费
在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如:
H = E × 0.25% × 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
基金托管费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(3) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(4) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(5) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(6) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(7) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(8) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(9) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(10) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(11) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(12) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(13) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(14) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(15) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(16) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(17) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(18) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(19) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由基金管理人向基金托管人发送基金费用划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
(20) 本条第(一)款第1项中第(3)至第(7)项费用由