

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

2014 第三季度报告

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示
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。
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10月23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。
本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	交银荣泰保本混合
基金主代码	519729
交易代码	519729
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2013年12月25日
报告期末基金份额总额	243,504,998.55份
投资目标	本基金在追求保本周期到期时本金安全的基础上，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金采用固定比例组合保险(CPI-Constant Proportion Portfolio Insurance)原理，动态调整股票资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以保障本金安全在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现
主要财务指标		单位：人民币元
报告期		2014年7月1日~2014年9月30日
1.本期已实现收益	4,665,695.75	
2.本期利润	8,522,855.15	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0344	
4.期末基金资产净值	237,601,853.29	
5.期末基金份额净值	1.058	

注：1.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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；
2.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；
3.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
交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准③	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	3.42%	0.25%	1.09%	0.01%	2.33%	0.24%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年12月25日至2014年9月30日)



注：本基金基金合同生效日为2013年12月25日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起六个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

4.1 基金管理人（或基金管理人）简介
4.2 基金管理人（或基金管理人）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
任职日期	离任日期			
周冠任先生	2013-12-25	-	15年	周冠任先生，上海交通大学管理学硕士，历任平安资产管理有限责任公司研究员，固定收益投资经理和基金经理，其中2003年12月至2007年5月担任平安资产管理有限责任公司固定收益部副经理，2007年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，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
4.3.2 异常交易专项说明
4.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.4 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易专项说明
4.3.3 公平交易制度的执行情况
4.3.4 公平交易制度的执行情况

截至2014年9月30日,本基金份额净值1.0659元,本报告期份额净值增长率为3.42%,同期业绩比较基准增长率为1.09%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	69,139,534.38	26.70
	其中:股票	69,139,534.38	26.70
2	固定收益投资	152,154,000.00	58.76
	其中:债券	152,154,000.00	58.76
	资产支持证券	--	--
3	贵金属投资	--	--
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	32,420,183.76	12.52
7	其他资产	5,222,521.37	2.02
8	合计	258,936,239.51	100.00

债券型证券投资基金	
三 季 度 报 告	

3	贵金属投资		-	-
4	金融衍生品投资		-	-
5	买入返售金融资产		-	-
	其中：买入返售金融资产		-	-
6	债权类资产		539,282.26	3.02
	其中：买入返售金融资产		-	-
7	其他资产		402,054.04	2.25
8	合计		17,881,559.81	100.00

5.2 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	牧、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2 089 610.00	14.85

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	352,300.00	2.50
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				2,441,910.00	17.36
6.5 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	600887	伊利股份	12,000	310,800.00	2.21
2	000883	湖北能源	60,000	276,600.00	1.97
3	600079	人福医药	10,000	276,200.00	1.96
4	000768	中航飞机	15,000	236,850.00	1.68
5	002032	金风科技	20,000	234,000.00	1.66
6	601989	中国重工	30,000	196,800.00	1.40
7	002008	大族激光	10,000	195,500.00	1.39
8	000858	五洲药业	10,000	184,700.00	1.31
9	300137	昊海生物	10,000	155,360.00	1.10
10	600677	中国石化	10,000	151,000.00	1.07

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十名股票投资		7,000	120,260,000	0.85
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	央行票据	--	--	
3	金融债券	5,011,700.00	35.62	
	其中:政策性金融债	5,011,700.00	35.62	
4	企业债券	6,855,980.00	48.73	
5	企业短期融资券	--	--	
6	中期票据	--	--	
7	可转债	2,630,283.50	18.70	

5.8	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股票投资明细					14,497,963.50	103.06
	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	140027	14国开07	30,000	3,006,900.00	21.37	
	2	124123	13南债16	20,000	2,004,000.00	14.36	
	3	140424	14开债04	20,000	2,004,000.00	14.25	
	4	122880	10天业债	13,000	1,309,100.00	9.31	
	5	122036	09广12债	13,000	1,303,380.00	9.26	

5.9 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股票投资明细		§5 投资组合报告
本基金本报告期末未持有A股市场证券 本基金本报告期末未持有B股市场证券 本基金本报告期末未持有权证		
5.10 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		
本基金本报告期末未持有权证		
5.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明		
本基金本报告期末未持有股指期货		
5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明		
本基金本报告期末未持有国债期货		
5.13 报告期末本基金投资的国债逆回购交易明细		
本基金本报告期末未持有国债逆回购 本基金本报告期末未持有		
5.14 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		
5.15 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贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属		
5.16 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境外证券投资明细 本基金本报告期末未持有境外证券		
5.17 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买入返售金融资产投资明细 本基金本报告期末未持有买入返售金融资产		
5.18 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卖出回购金融资产投资明细 本基金本报告期末未持有卖出回购金融资产		
5.19 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权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证		
5.20 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.21 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.22 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.23 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.24 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.25 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.26 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.27 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.28 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.29 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.30 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.31 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.32 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.33 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.34 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.35 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.36 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.37 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.38 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.39 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.40 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.41 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.42 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.43 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.44 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.45 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.46 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.47 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.48 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.49 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.50 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.51 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.52 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.53 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.54 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.55 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.56 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.57 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.58 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.59 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.60 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.61 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.62 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.63 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.64 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.65 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.66 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.67 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.68 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.69 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.70 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.71 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.72 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.73 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.74 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.75 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.76 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.77 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.78 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.79 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.80 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.81 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.82 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.83 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.84 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.85 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.86 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.87 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.88 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.89 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.90 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.91 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.92 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.93 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.94 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.95 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.96 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.97 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.98 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.99 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		
5.100 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其他资产投资明细 本基金本报告期末未持有其他资产		

序号		名称	金额(元)
1	存出保证金		9,267.01
2	应收证券清算款		

3	应收股利	-
4	应收利息	388,837.04
5	应收申购款	4,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	402,404.05

5.12 报告期末持有的公允价值低于成本的债券投资明细

债券名称	公允价值	占基金资产净值比
------	------	----------

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	比例(%)
1	113005	平安转债	985,050.00	7.00
2	100015	石化转债	545,150.00	3.88
3	110024	隧道转债	367,800.00	2.61
4	110011	歌华转债	239,160.00	1.70

6.13 报告期末前十名股票公允价值变动情况列示

序号	股票代码	股票名称	公允价值变动 金额(元)	公允价值变动 比例(%)	报告期末资产 占比
1	000768	中航飞机	236,850.00	1.68	重大事项

项目		交银量化回报债券A/B	交银量化回报债券C
本报告期期初基金份额总额		13,871,173.66	4,292,742.27
本报告期基金总申购份额		1,120,830.00	258,512.50
减:本报告期基金总赎回份额		4,599,473.24	1,548,816.47
本报告期基金拆分变动份额		-	-
本报告期末基金份额总额		10,392,530.50	3,002,438.30

7.1 基金管理人持有本基金变动情况说明		7.2 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.3 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.4 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.5 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.6 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.7 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.8 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.9 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.10 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.11 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.12 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.13 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.14 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.15 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.16 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.17 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.18 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.19 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.20 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.21 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.22 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.23 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.24 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.25 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.26 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.27 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.28 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.29 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.30 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.31 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.32 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.33 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.34 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.35 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.36 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.37 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.38 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.39 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.40 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.41 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.42 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.43 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.44 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.45 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.46 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.47 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.48 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.49 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.50 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.51 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.52 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.53 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.54 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.55 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.56 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.57 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.58 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.59 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.60 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.61 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.62 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.63 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.64 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.65 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.66 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.67 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.68 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.69 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.70 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.71 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.72 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.73 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.74 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.75 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.76 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.77 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.78 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.79 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.80 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.81 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.82 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.83 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.84 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.85 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.86 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.87 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.88 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.89 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.90 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.91 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.92 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.93 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.94 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.95 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.96 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.97 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.98 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明
7.99 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明		7.100 基金管理人报告期内持有本基金变动情况说明

基金管理人业务资格批件、营业执照和基金管理人经中国证监会核准的证券投资业务资格证明文件存放在指定报刊上各项公告的附册。
 5.2 投资者可以至基金管理人或基金销售机构处索取，基金管理人或基金销售机构应予以提供。
 5.3 投资者有权向基金管理人索取基金资料。
 5.4 投资者可在其办公时间至基金管理人的办公场所或基金服务机构索取，或者至基金管理人网站(www.fund001.com, www.neraccapital.com)索取。投资者在索取基金资料时，须填写索取基金资料申请表并加盖投资者本人印章。
 5.5 投资者若对本报告有任何疑问，可咨询本基金管理人又根路罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61056000，电子邮箱：neraccap@yintd.com。

5.2 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	-	-
B	制造业	-	-

C	制造业	35,743,231.54	13.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,377,682.00	1.31
E	建筑业	1,940,874.00	0.75
F	批发和零售业	2,122,000.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务	7,156,832.00	2.78
J	金融业	1,236,000.00	0.48
K	房地产业	6,408,500.00	2.49
L	租赁和商务服务业	765,000.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	711,541.82	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	3,468,273.02	1.31
R	文化、体育和娱乐业	6,209,600.00	2.45

S	综合			-	
	合计		69,139,534.38	26.84	
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	002098	长春高新	400,000	7,820,000.00	3.04
2	600584	长电科技	399,990	4,775,880.60	1.85
3	600633	瀚宇博传	200,000	4,024,000.00	1.56
4	002665	普联节能	80,000	3,522,440.00	1.37
5	000927	一汽夏利	709,200	3,439,620.00	1.34
6	600804	鹏博士	200,000	3,364,000.00	1.31
7	600067	冠城大通	500,000	3,255,000.00	1.26
8	603005	晶方科技	58,731	2,804,992.56	1.09
9	300347	泰格医药	80,000	2,727,200.00	1.06
10	600208	新宙思安	600,000	2,514,000.00	0.98

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	国债债券	10,235,000.00	3.97
2	央行票据	--	--
3	金融债券	141,919,000.00	55.09
	其中,政策性金融债	141,919,000.00	55.09
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债	--	--
8	其他	--	--
9	合计	152,154,000.00	59.06