

博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

2014 第三季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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,也不保证基金份额持有人其未来表现。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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

基金产品概况	
基金简称	博时裕隆混合
基金代码	000652
交易代码	000652
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月3日
报告期末基金份额总额	1,145,655,958.73份
投资目标	通过对多种投资策略的有机结合,在有效控制风险的前提下,力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金将按风险收益配比原则,实行动态的资产配置。围绕对经济周期景气度的研判以及宏观经济政策的调整来实施大类资产的配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高风险/风险特征的基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本期已实现收益	30,829,922.61
2.本期利润	253,653,278.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.1510
4.期末基金资产净值	1,371,177,464.71
5.期末基金份额净值	1.197

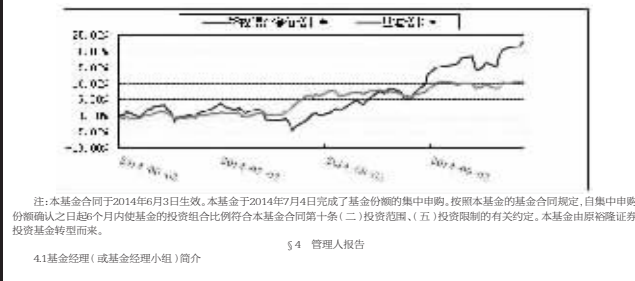
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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,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 本报告期末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	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	20.62%	1.24%	10.23%	0.67%	10.39%	0.57%



4.1基金管理人(或基金经小组)简介

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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,也不保证基金份额持有人其未来表现。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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

基金产品概况	
基金简称	博时裕隆混合
基金代码	000219
交易代码	000219
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月29日
报告期末基金份额总额	396,681,254.00份
投资目标	本基金以绝对收益为目标,投资目标分为下行风险控制和收益获取两个方面,风险控制目标优先。
投资策略	本基金具体投资策略略分三个层次:首先是大类资产的配置,目标为避险增值,其次是行业配置,目标定位于降低组合的波动性以及与市场的相关性;最后是个股选择策略和债券、权证、股指期货等资产的投资策略。
业绩比较基准	年化收益率2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

基金资产状况

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日~2014年9月30日)
基金简称	
1.本期已实现收益	19,828,231.32
2.本期利润	15,040,428.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0321
4.期末基金资产净值	389,064,179.01
5.期末基金份额净值	0.981

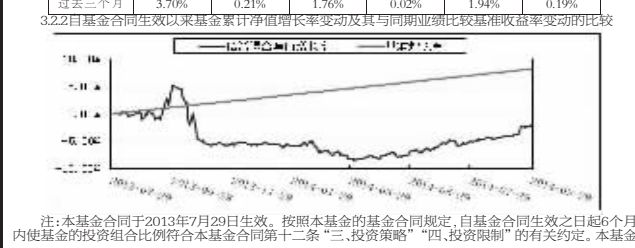
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数字。

§3.1 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	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
		标准差②	标准差③	标准差④		



基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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,也不保证基金份额持有人其未来表现。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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

基金产品概况	
基金简称	博时月月薪定期支付债
基金代码	000246
交易代码	000246
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月25日
报告期末基金份额总额	401,087,288.40份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争为投资人提供稳定的现金流收入,争取实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相结合的方式,确定资产在非信用类固定收益类证券(国家债券、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例。
业绩比较基准	3年期定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

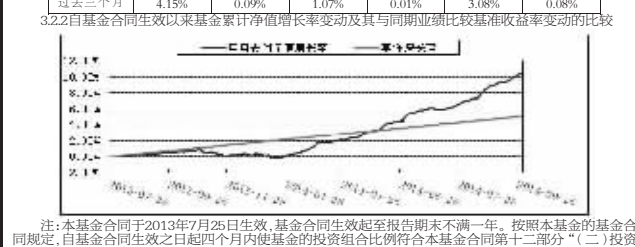
§3 主要财务指标和基金净值表现	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2014年7月1日~2014年9月30日)
1.本期已实现收益	5,461,251.53
2.本期利润	16,947,759.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0416
4.期末基金资产净值	420,870,648.86
5.期末基金份额净值	1.049

注: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)扣除相关费用后的金额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§3.1 本报告基金净值增长及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	4.15%	0.09%	1.07%	0.01%	3.08%	0.08%



姓名 职务 任本基金基金经理期限 证券从业年限 说明

林林 基金经理 2014-6-3 - 9 2001年起先后在光大证券集团、银联数据公司工作,2005年起在华西证券,安信证券从事研究工作,2010年起在银华长城基金从事研究员、基金经理,2012年11月加入博时基金管理有限公司,曾任裕隆证券投资基金基金经理,现任博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定,并未有违法违规行为,勤勉尽责、诚实守信,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法律法规和中国证监会的有关规定,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资组合和资产变动分析

在三季度,市场保持的基本上延续了第二季度的结构,主要是两方面:其一,将符合产业结构调整方向,以TMT为代表的新兴产业;其二为资产证券化周期中的工业、消费品行业,主要是水处理、智慧城市、互联网+金融、移动互联网应用、中国电力,以及航天系等。

4.5 报告期末基金的投资概况

截至2014年9月30日,本基金资产净值为1.197元,累计份额净值为1.035元,报告期内净值增长率为20.62%,同期业绩比较基准为10.23%。

4.6 管理人对于报告期内基金投资运作遵规守信情况的说明

从宏观经济看,各数据指标表现均低于预期,我国股市在结构性结构调整的期间,全国主要城市逐步停止了房地产限购政策,但是我们认为全国放松的规模较小,政策会在一定程度上容忍经济增速放缓,经济结构的转型会逐步推进。

对于A股市场,我们认为当前经济结构调整的大背景下,市场调整的下调空间有限,个股的估值依然处于一个比较低的水平,银行股存在复利回报,保险、券商等板块前期基本面有所改善,上述板块有一定上行空间。代表机构型的新兴产业长期在比较好的投资机会,短期而言,而成长股会进入到估值确认的估值的一个期间,其中一些投资逻辑和业绩逐步得到验证的,会有比较好的表现。

从行业上来看,我们目前看好几个行业,比如环保、金融互联网、移动互联网、军工等。尤其是环保行业,按照政府的“十二”规划,环保产业的进入速度加快,环保板块的收入会逐步改善,从而估值会提高,目前很多标的都已经处在去年的历史低位,未来一两个季度,估值会有明显的修复以及一半的估值,预期会有比较好的表现。军工产业未来受益于军工科研院所改制进行资产证券化的问题,会迎来一轮比较长期的投资机会。

§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	1,287,621,106.78	92.51
	其中:股票	1,287,621,106.78	92.51
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	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	97,488,685.46	7.00
7	其他资产	6,791,736.65	0.49
8	合计	1,391,901,528.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

博时裕益灵活配置

【 2014 】 第

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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,也不保证基金份额持有人其未来表现。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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

基金产品概况	
基金简称	博时裕隆混合
基金代码	000219
交易代码	000219
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月29日
报告期末基金份额总额	396,681,254.00份
投资目标	本基金以绝对收益为目标,投资目标分为下行风险控制和收益获取两个方面,风险控制目标优先。
投资策略	本基金具体投资策略略分三个层次:首先是大类资产的配置,目标为避险增值,其次是行业配置,目标定位于降低组合的波动性以及与市场的相关性;最后是个股选择策略和债券、权证、股指期货等资产的投资策略。
业绩比较基准	年化收益率2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

截至2014年9月30日,本基金基金份额净值为0.981元,累计份额净值为0.981元,报告期内净值增值率37.0%,同期沪深300指数涨幅为1.76%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的判断概要如下:

我们认为,我国宏观经济在“新常态”下,将进入以四个阶段:1、长期。按照中国经济所处的周期阶段,在物价低位水平及经济增速下降的背景下,利率水平上升的趋势,但长期下仍存存在温和通胀和各种体制弊病,另一方面也看到近期维持高房价的房地产周期的高位,这些考虑导致我们在未来进行长期价值投资。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。2、中期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。3、短期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。4、超短期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。

我们认为,我国宏观经济在“新常态”下,将进入以四个阶段:1、长期。按照中国经济所处的周期阶段,在物价低位水平及经济增速下降的背景下,利率水平上升的趋势,但长期下仍存存在温和通胀和各种体制弊病,另一方面也看到近期维持高房价的房地产周期的高位,这些考虑导致我们在未来进行长期价值投资。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。2、中期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。3、短期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。4、超短期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。

我们认为,我国宏观经济在“新常态”下,将进入以四个阶段:1、长期。按照中国经济所处的周期阶段,在物价低位水平及经济增速下降的背景下,利率水平上升的趋势,但长期下仍存存在温和通胀和各种体制弊病,另一方面也看到近期维持高房价的房地产周期的高位,这些考虑导致我们在未来进行长期价值投资。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。2、中期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。3、短期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。4、超短期。随着中国城镇化进程的持续进行,我们在今年上半年开始建仓的周期类资产,移动互联和网络金融领域的领创公司,我们认为经济结构的深刻变革将随着股票市场的全面复苏和流动性低估估值,随着新一轮经济结构性变化在时间轴上的展开,新兴经济将带动主题投资成长成为投资,新增投资对应的周期类资产,在明确估值上,将逐步显现,在估值低位,接受和认可,在估值高位,减持退出。



基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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,也不保证基金份额持有人其未来表现。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。

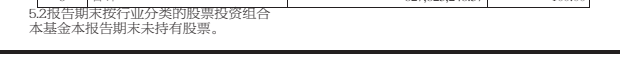
本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

基金产品概况	
基金简称	博时月月薪定期支付债
基金代码	000246
交易代码	000246
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月25日
报告期末基金份额总额	401,087,288.40份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争为投资人提供稳定的现金流收入,争取实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相结合的方式,确定资产在非信用类固定收益类证券(国家债券、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例。
业绩比较基准	3年期定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	774,058,661.20	93.51
	其中:债券	774,058,661.20	93.51
	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	23,423,968.88	2.83
7	其他资产	30,340,618.29	3.67



序号	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	567,131,489.05	41.36
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	32,879,419.44	2.40
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	513,472,219.34	37.45
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	103,007,542.96	7.52
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	71,060,435.99	5.18
S	综合	—	—
	合计	1,287,621,106.78	93.91

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	300070	神州泰岳	10,292,433	181,867,211.91	13.26
2	600570	恒信证券	2,983,597	125,192,901.46	9.18
3	300002	招商局	3,406,396	103,077,542.96	7.62
4	600909	四创电子	2,149,983	96,598,736.19	7.04
5	002544	杰赛科技	7,141,120	82,399,237.60	6.01
6	300194	福安药业	2,996,117	71,337,543.57	5.20
7	300133	华鼎股份	2,071,129	71,066,455.99	5.18
8	600334	津滨医疗	2,047,937	63,677,094.18	4.64
9	600850	华鲁能源	1,109,862	42,785,180.10	3.12
10	002338	奥普光电	749,881	40,411,087.09	2.95

5.6 报告期末按投资组合类资产分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按行业分类的基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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五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。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产明细

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

5.13 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股票投资明细

5.13.1 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 1) 属基金合同、或在报告期内任一日内买入或卖出公开流通、发行、上市、挂牌、挂牌转让、挂牌交易、挂牌上市、

1	存出保证金	537,991.99
2	应收证券清算款	4,713,324.34
3	应收股利	—
4	应收利息	19,426.25
5	应收申购款	1,820,994.07
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,791,736.65

三 季 度 报 告

姓名	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中:股票	—	—
2	固定收益投资	364,774,000.00	92.50
	其中:债券	364,774,000.00	92.50
	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	27,338,106.15	6.93
7	其他资产	2,227,369.00	0.56
8	合计	394,339,475.15	100.00