

## (上接A38版)

理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳健收益。

**五、基金的业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×25%+中信标普全债指数×75% $\times$ 沪深300指数×25%+中信标普全债指数×75% $\times$ 沪深300指数×25%。如果今后市场有其他代表性更强的业绩比较基准推出,本基金可以在经过适当调整后变更使用新的比较基准。

**十一、基金的风险揭示特征**

本基金是一只稳健型的股票基金,属于股票型基金中的中等风险品种,本基金力争在严格控制风险的前提下谋取实现长期资产稳定增长。

**十二、基金的投资组合报告**

本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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2014年11月18日核对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。

本基金投资组合报告为期为2014年4月1日至2014年6月30日,所载数据未经审计。

**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	3,215,605,930.79	78.37
其中:股票		3,215,605,930.79	78.37
2	固定收益投资	187,616,992.00	4.57
其中:债券		187,616,992.00	4.57
3	贵金属买卖	-	-
4	黄金租赁	-	-
5	买入返售金融资产	570,817,621.50	13.91
其中:买断式回购		-	-
6	银行存款和结算备付金	122,515,880.82	2.99
7	其他资产	6,313,914.09	0.15
8	合计	4,102,870,339.20	100.00

**2.报告期末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	采矿业	-	-
C	制造业	1,954,650,168.33	48.15
D	电力、自来水、燃气、水生产和供应业	19,603,911.15	0.48
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	188,525,871.24	4.64
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	336,506,341.85	8.29
J	金融业	41,364,288.86	1.02
K	房地产业	129,877,713.06	3.20
L	租赁和商务服务业	208,111,579.20	5.13
M	科学研究和技术服务业	40,963,230.50	1.01
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	148,474,542.39	3.66
R	文化、体育和娱乐业	147,527,644.21	3.63
S	综合	-	-
合计		3,215,605,930.79	79.23

**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	600035	天士力	4,009,254	155,438,778.58	3.83
2	002400	省广股份	53,617,434	138,428,242.94	3.41
3	300026	红日药业	146,441	136,141,014.30	3.35
4	300104	乐视网	2,991,509	131,327,245.10	3.24
5	600196	复星医药	6,492,772	131,089,066.68	3.23
6	002454	霞客股份	10,280,549	129,444,701.91	3.19
7	000625	长春汽车	9,929,210	122,288,575.10	3.01
8	600048	保利地产	23,819,850	118,146,456.00	2.91
9	300005	探路者	7,351,686	113,310,031.84	2.80
10	300333	华鼎锦纶	3,388,273	108,273,022.65	2.67

**4.报告期末按债券品种的债券投资组合**

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	180,093,000.00	4.44
其中:政策性金融债		180,093,000.00	4.44
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	7,523,992.00	0.19
8	其他	-	-
9	合计	187,616,992.00	4.62

**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**

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6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相关招募说明书中有关比例的约定。

**十三、基金的费用与税收****(一) 基金的费用的种类**

1.基金管理人的管理费

2.基金托管人的托管费

3.基金销售机构的销售服务费

4.基金份额持有人大会费用

5.合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;

6.基金合同生效应支付的基金信息披露费;

7.在有关规定允许的前提下,本基金可以从事基金资产中计提销售服务费,销售服务费的具体计算方法、计提标准在有关公告中载明。

8.按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金资产中列支的其他费用。

本基金终止经营所发生的费用,按实际数从基金资产总值中扣除。

9.基金合同中规定的费用

10.基金合同中规定的费用

11.基金合同中规定的费用

12.基金合同中规定的费用

13.基金合同中规定的费用

14.基金合同中规定的费用

15.基金合同中规定的费用

16.基金合同中规定的费用

17.基金合同中规定的费用

18.基金合同中规定的费用

19.基金合同中规定的费用

20.基金合同中规定的费用

21.基金合同中规定的费用

22.基金合同中规定的费用

23.基金合同中规定的费用

24.基金合同中规定的费用

25.基金合同中规定的费用

26.基金合同中规定的费用

27.基金合同中规定的费用

28.基金合同中规定的费用

29.基金合同中规定的费用

30.基金合同中规定的费用

31.基金合同中规定的费用

32.基金合同中规定的费用

33.基金合同中规定的费用

34.基金合同中规定的费用

35.基金合同中规定的费用

36.基金合同中规定的费用

37.基金合同中规定的费用

38.基金合同中规定的费用

39.基金合同中规定的费用

40.基金合同中规定的费用

41.基金合同中规定的费用

42.基金合同中规定的费用

43.基金合同中规定的费用

44.基金合同中规定的费用

45.基金合同中规定的费用

46.基金合同中规定的费用

47.基金合同中规定的费用

48.基金合同中规定的费用

49.基金合同中规定的费用

50.基金合同中规定的费用

51.基金合同中规定的费用

52.基金合同中规定的费用

53.基金合同中规定的费用

54.基金合同中规定的费用

55.基金合同中规定的费用

56.基金合同中规定的费用

57.基金合同中规定的费用

58.基金合同中规定的费用

59.基金合同中规定的费用

60.基金合同中规定的费用

61.基金合同中规定的费用

62.基金合同中规定的费用

63.基金合同中规定的费用

64.基金合同中规定的费用

65.基金合同中规定的费用

66.基金合同中规定的费用

67.基金合同中规定的费用

68.基金合同中规定的费用

69.基金合同中规定的费用

70.基金合同中规定的费用

71.基金合同中规定的费用

72.基金合同中规定的费用