

(上接B011版)

电话: (021) 68761616
传真: (021) 68767981
客户服务电话: 4008-888-128
网址: www.tibetonline.com
(21) 齐鲁证券有限公司
住所: 山东省济南市市中区经二路86号
办公地址: 山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人: 李玮
电话: (0531) 68889155
传真: (0531) 68889752
联系人: 吴昊
客户服务电话: 96538
网址: www.qizq.com.cn
(22) 江海证券有限公司
住所: 黑龙江龙市哈爾濱市香坊区赣水路66号
法定代表人: 孙名扬
电话: (0451) 58583966
传真: (0451) 82287211
联系人: 张哲北
客户服务电话: 400-666-2288
网址: www.jhzq.com.cn
(23) 平安证券有限责任公司
住所: 深圳市福田区金田路4188号平安国际交易广场裙楼8楼
办公地址: 深圳市福田区金田路4188号平安国际交易广场裙楼8楼(518048)
法定代表人: 杨宇翔
电话: (0755) 22627802
传真: (0755) 82400862
联系人: 陈静
客户服务电话: 95511-1
网址: www.pingan.com
(24) 厦门证券有限公司
住所: 厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人: 倪晓娟
电话: (0592) 5161642
传真: (0592) 5161640
联系人: 赵欢
客户服务电话: (0592) 5163588
网址: www.xmzq.cn
(25) 中国国际金融有限公司
住所: 北京建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址: 北京建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
法定代表人: 金立群
电话: (010) 65051166
传真: (010) 65058065
联系人: 罗春峰、武明坤
客户服务电话: 400-9300-9300
网址: www.cicc.com.cn
(26) 瑞银证券有限责任公司
住所: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人: 程实
电话: (010) 58292112
传真: (010) 58328740
联系人: 牟冲
客户服务电话: 400-887-8827
网址: www.ubssecurities.com
(27) 国金证券股份有限公司
住所: 成都市东城根上街66号
办公地址: 成都市东城根上街66号
法定代表人: 冉云
电话: (028) 86690126
传真: (028) 86690126
联系人: 金晶
客户服务电话: 400-6600-109
网址: www.gjzq.com.cn
(28) 渤海证券股份有限公司
住所: 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址: 天津市开发区滨江西路8号
法定代表人: 杜庆华
电话: (022) 28451861
传真: (022) 28451892
联系人: 王兆权
客户服务电话: 400-651-5988
网址: www.bhzq.com.cn
(29) 信达证券股份有限公司
住所: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人: 高冠江
电话: (010) 63081000
传真: (010) 63080978
联系人: 唐静
客户服务电话: 400-800-8899
网址: www.cindasc.com
(30) 西南证券股份有限公司
住所: 重庆市江北区桥北苑8号
办公地址: 重庆打铜街12号桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人: 余维佳
电话: (023) 63786121
传真: (023) 63786214
联系人: 张煜
客户服务电话: 400-809-6096
网址: www.swsc.com.cn
(31) 东吴证券股份有限公司
住所: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人: 徐勇力
电话: (010) 66555316
传真: (010) 66556246
联系人: 汤惠川
客户服务电话: 400-8898-993
网址: www.dxzq.net.cn
(32) 华融证券有限责任公司
住所: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址: 福州市五四路新天地大厦7至10层
法定代表人: 黄金雄
电话: (0591) 87383623
传真: (0591) 87383610
客户服务电话: (0591) 963626
网址: www.hfzq.com.cn
(33) 中国中投证券有限责任公司
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、01.02.03.05.11.12.13.15.16.17.19.20.21.22.23.24层
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层及21层
法定代表人: 龙增来
电话: (0755) 82023442
传真: (0755) 182029539
联系人: 刘凯
客户服务电话: 400-600-8008
网址: www.china-invsc.cn
(34) 华融证券股份有限公司
住所: 北京市西城区金融大街8号
办公地址: 北京市西城区金融大街8号
法定代表人: 宋国贤
电话: (010) 58568235
传真: (010) 58568062
联系人: 黄恒
客户服务电话: (010) 58568118
网址: www.hrsc.com.cn
(35) 天相证券有限责任公司
住所: 北京市西城区金融街19号富凯大厦10层701
办公地址: 北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人: 林义相
电话: (010) 66045529
传真: (010) 66045518
联系人: 尹丹
客户服务电话: (010) 166045678
网址: www.txsc.com.cn, www.tjcm.com.cn
(36) 联讯证券股份有限公司
住所: 惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址: 惠州江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人: 徐刚
电话: (021) 33060736
传真: (021) 33060760
联系人: 陈思
客户服务电话: 96564
网址: www.lxzzq.com.cn
(37) 杭州聚米基金销售有限公司
住所: 杭州市余杭区仓前街道海曙路42号
办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道368号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈柏青
电话: (0571) 28822970, (021) 60897869
传真: (021) 22699533
联系人: 周晟
客户服务电话: 4000-766-123
网址: www.fund123.cn
(38) 深圳众禄基金销售有限公司
住所: 深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25楼1单元
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25楼1单元
法定代表人: 薛峰
电话: (0755) 33227983
传真: (0755) 82020539
联系人: 汤素媛
客户服务电话: 4006-788-887
网址: www.zlfund.com, www.jmmw.com
(39) 上海长量基金销售有限公司
住所: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路656号裕景国际B座16层
法定代表人: 张铁伟
电话: (021) 20691835
传真: (021) 20691861
联系人: 冉丹萍
客户服务电话: 400-089-1289
网址: www.erichfund.com
(40) 上海好买基金销售有限公司
住所: 上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址: 上海浦东新区东陆路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人: 杨文斌
电话: (021) 68596916
联系人: 薛娜
客户服务电话: 400-700-9665
网址: www.ehowbuy.com
(41) 浙江正立上海基金销售有限公司
住所: 上海市浦东新区南汇新城滴水湖1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号2号楼2层
法定代表人: 林其
电话: (021) 54609988
传真: (021) 164385308
联系人: 潘世友
客户服务电话: 400-1818-188
网址: www.1234567.com.cn
(42) 北京钱景财富投资管理有限公司
住所: 北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012
办公地址: 北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012

法定代表人: 赵荣春
电话: (010) 57418829
传真: (010) 57569671
联系人: 魏华
客户服务电话: 400-678-5095
网址: www.wjzq.net.cn
(45) 深圳市新华信证券投资咨询有限公司
住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006F
办公地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦A座20层
法定代表人: 陈操
电话: (010) 58325395
传真: (010) 58325282
联系人: 刘亚文
客户服务电话: 400-850-7771
网址: https://tj.rjcm.com/

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其它符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。

(二) 登记机构
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17号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人: 周明
电话: (010) 583778839
传真: (010) 583778907
联系人: 朱立元

(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称: 上海市通力律师事务所
住所: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人: 俞卫锋
电话: (021) 31358666
传真: (021) 31358600
联系人: 黎明
经办律师: 吕红、黎明

(四) 审计会计师事务所
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号星展银行大厦6楼
办公地址: 上海市湖滨路202号普华永道中国11楼
首席合伙人: 杨绍信
电话: (021) 23238888
传真: (021) 23238800
联系人: 沈兆杰
经办注册会计师: 汪峰、沈兆杰

四、基金的名称
本基金名称: 交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金

五、基金的类型
本基金类型: 契约型开放式

六、基金的投资目标
本基金为基金份额持有人持有到期的基金份额提供保本金额为: 本基金的第一个保本周期内, 本基金投资期间内认购本基金的投资者认购并持有到期的基金份额的认购金额(即认购保本金额, 包括该等基金份额的净认购金额、认购费用以及募集期间内的认购利息), 以及发生本基金转入下一保本周期的情形时, 在过渡期内进行申购的投资者申购并持有到期的基金份额折算日所代表的资产净值, 以及从本基金上一保本周期结束后默认投资转入当期保本周期时基金份额持有人在上一保本周期持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值, 按照基金合同其他约定未获得可享受保本条款确认的基金份额除外。

在保本周期到期日, 如基金份额持有人持有到期的基金份额的认购金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内累计分红金额之和计算的总金额不低于其保本金额(低出的部分即为“保本赔付差额”), 则基金管理人或保本义务人应足额补足其赔付差额, 并在保本周期到期后20个工作日内(含第20个工作日)内将该保本赔付支付给基金份额持有人。

发生基金合同约定的不适用保本条款情形的, 相应基金份额不适用本保本条款。

七、基金的投资目标
本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下, 力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

八、基金的投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行的股票、债券、股票(包括中、小盘、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但需符合中国证监会的相关规定。

本基金的投资组合包括股票资产和债券资产, 稳健资产为国内依法发行的股票、货币市场工具、国债及银行存款等, 其中债券资产包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、信用债等。风险资产为股票(包括中、小盘、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票)、权证、股指期货等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为: 债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%, 其中基金投资应不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券; 股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于40%, 其中, 基金持有的全部权证的市场价值不超过基金资产净值的3%。

九、基金的投资策略
本基金运用固定比例组合保险(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)原理, 动态调整稳健资产与风险资产在投资组合中的投资比例, 以确保本基金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。

具体而言, 本基金的投资策略包括资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。

(1) 资产配置策略
本基金运用固定比例组合保险(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)原理对稳健资产和风险资产进行配置, 动态调整稳健资产与风险资产投资的比例, 通过对稳健资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全, 通过对风险资产的投资寻求保本周期内的稳定增值。本基金对稳健资产和风险资产的资产配置具体可分为以下四步:
第一步, 确定本基金的价值底线(Floor)。根据本基金保本周期到期时投资组合的最低目标值(本基金最低保本值为投资本金的100%)和合理的贴现率, 确定本基金当前持有的稳健资产数额, 亦即本基金的价值底线(Floor)。
第二步, 计算本基金的安全垫(Cushion)。通过计算基金投资组合当前净值超越价值底线的数额, 得到本基金的安全垫(Cushion)。
第三步, 确定风险乘数(Multiplier)。本基金通过对宏观经济和证券市场运行状况和趋势的判断, 并结合基金的投资收益情况, 确定安全垫的放大倍数。风险乘数, 并在安全垫和风险乘数确定的基础上, 得到当前风险资产的最高配置规模与市值。
第四步, 动态调整稳健资产与风险资产的配置比例。根据本基金市场实际运行态势制定投资策略, 进行投资组合管理, 实现基金资产在保本基础上的保值增值。

CPPI 投资策略实施示例:
假设本基金初始募集规模为30 亿元, 当期三年期无风险利率为年化3.33%, 本基金认购费率最高一档为10%, 假设本基金投资保本周期到期日最低目标值为人民币1.01 亿元(假设当期“发生申购赎回”), 此时本基金投资组合的公允价值为27.4640 亿元(即: 1.01×30/1.1+3.33%×12-28.3788), 此时本基金的安全垫为2.5360 亿元(30-27.4640-2.5360)。假设本基金运作首日, 基金经理人根据市场状况确定的当期风险乘数为2, 则本基金投资于风险资产的最高配置规模为2.5360 亿元(2.5360×1=2.5360, 1为放大倍数), 初始投资于稳健资产的规模不低于27.4640 亿元。

假设经过一年的时间, 股票市场出现一定程度的上涨, 本基金的净资产变为32亿元(假设当期“发生申购赎回”), 此时本基金投资组合的公允价值为32.3785 亿元(即: 1.01×30/1.1+1.333%×12-28.3788), 此时本基金的安全垫为3.6215 亿元(32-32.3785-3.6215)。假设此时基金经理人根据市场状况确定的当期风险乘数为2, 则本基金投资于风险资产的最高配置规模为7.2430 亿元(3.6215×2=7.2430, 2为放大倍数)。

(2) 稳健资产投资策略
本基金通过判断宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化, 对未来市场利率趋势及市场流动性状况进行预测, 并综合考虑利率、信用、基金化对不同资产类别的影响, 收益水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素, 在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上, 构造债券组合。

1) 免役策略
本基金采用剩余期限与保本周期到期期限匹配的积极投资策略, 根据保本周期的剩余期限动态调整稳健资产债券组合久期, 有效控制债券利率、收益率曲线等各种风险, 保证债券组合收益的稳定性。

2) 收益率曲线策略
本基金将结合对收益率曲线变化的预测, 适时运用子弹、杠铃或梯形策略构造组合, 并进行动态调整, 从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。

3) 相对价值策略
本基金通过对不同债券市场、债券品种及信用等级的债券间利差的分析判断, 获取不合理定价所带来的投资机会。

4) 骑乘策略
本基金通过分析收益率曲线各期限段的利差情况, 买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券, 持有一段时间后, 随着债券剩余期限的缩短, 到期收益率将迅速下降, 基金可获得较高的资本利得收入。

5) 回购策略
本基金将适时运用回购交易套利策略, 在确保基金资产安全的前提下增强债券组合的收益。

6) 信用债投资策略
本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法, 通过对信用产品基本面的研究, 形成对该信用产品信用风险综合评定, 并通过调整组合内信用产品在信用等级和剩余期限方面的分布, 获取超额收益。

(3) 风险资产投资策略
1) 股票投资策略
本基金充分发挥基金管理人的研究优势, 将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合, 在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上, 通过优选具有良好成长性、成长质量优秀、定价相对合理的股票进行投资, 以谋求超额收益。

2) 行业配置
本基金通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等多因素的分析, 形成对行业及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响, 得出各行业的相对投资价值与投资时机, 据此挑选出具有良好景气和发展潜力的行业。

3) 个股选择
本基金综合运用交银施罗德的股票研究分析方法和其它投资分析工具挑选具有良好成长性、成长质量优秀、定价相对合理的股票构建股票投资组合。具体分以下三个层次进行:
a) 品质筛选
筛选出在公司治理、财务及管理素质上符合本基金品质要求的上市公司, 构建备选股票池。主要筛选指标包括: 盈利能力(如 E/P、P/Cash Flow、P/BPC、P/S、P/EHIT等)、经营效率(如 ROE、ROA、Return on operating assets等)和财务状况(如 D/A、流动比率等)等。
b) 公司品质评价
通过对上市公司直接接洽和实地调研, 了解并评估公司治理结构、公司战略、所处行业的竞争地位、公司的财务特点, 以决定投资组合价值中应该该有的折价或溢价水平。在调研基础上, 分析员依据公司成长性、盈利能力可预见性、盈利质量、管理层素质、流通股股东关注焦点、大股东减持压力等因素给每个目标公司进行评分。
c) 多元化投资组合
在质量评价的基础上, 根据上市公司所处的不同行业特点, 综合运用上述价值的股票估值指标, 对股票进行合理估值, 并评定投资级别。在不同的估值基础上选择价值被低估的投资标的。

2) 权证投资策略
本基金的权证投资以权证的市值价值分析为基础, 配以权证定价模型寻求其合理估值水平, 以主动式的科学投资管理手段, 充分发掘权证资产的收益性、流动性及风险性特征, 通过资产配置、品种与类属选择, 追求基金资产稳定的当期收益。

3) 股指期货投资策略
本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金以套期保值为目的, 根据风险管理的原则, 在风险可控的前提下, 投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约, 套期保值或对冲基金投资组合的系统性风险, 以减小基金资产净值波动。
本基金通过对宏观经济和股票市场走势的判断, 并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征, 通过资产配置、品种选择, 谨慎进行投资, 以降低投资组合的整体风险。具体而言, 本基金股指期货投资策略包括套期保值和择时策略, 期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略。
本基金在运用股指期货控制风险的基础上, 将谨慎地获取相应的超额收益, 通过股指期货对冲的多头仓位和空头仓位组合, 实现可转移阿尔法, 并通过股指期货与股票的多空比例调整, 获取股指期货的投资阿尔法。
本基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程, 确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作, 并明确相关岗位职责。此外, 基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组, 并授权相关管理人员负责股指期货的投资审批事项。

十、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准采用: 三年期银行定期存款税后收益率。
三年期银行定期存款税后收益率按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位, 单位为百分数)计算的与当期保本周期期限的税后收益率。
本基金业绩比较基准为人民币三年期存款基准利率, 能够体现本基金受人理性判断本基金的收益特征, 客观地衡量比较本基金基本保证的有效性。
如果今后市场发生变化, 或者市场变化导致本基金业绩基准不再适用, 又或者市场出现更具权威、且更能客观反映本基金投资组合业绩表现的业绩比较基准, 则基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩比较基准并报中国证监会备案, 并及时公告, 但不需要召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征
本基金是一只只保本混合型基金, 在证券投资基金中属于低风险品种。

十二、基金投资组合报告
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。
本基金本报告期自2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务资料未经审计。
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	113,575,676.46	32.47
其中: 股票	113,575,676.46	32.47	
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
其中: 债券	194,426,100.00	55.58	
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	36,436,103.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,500.49	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	2,486,000.00	0.99
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业	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,670,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,236,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	卫生和社会工作	-	-
P	教育、文化和体育业	-	-
Q	卫生和医药工作	4,133,000.00	1.21
R	农、林、牧、渔业	4,084,291.00	1.17
S	综合	-	-
合计		113,575,676.46	33.05

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	002008	大康农业	800,000	15,640,000.00	4.55
2	000100	TCL 集团	2,275,000	6,142,500.00	1.79
3	600584	长电科技	499,908	5,968,901.52	1.74
4	002065	首航节能	120,000	5,283,600.00	1.54
5	600884	鲁商置业	300,000	5,046,000.00	1.47
6	300137	先河环保	320,669	4,970,671.57	1.45
7	000927	一汽夏利	999,238	4,846,138.80	1.41
8	300077	恒信达	200,000	3,981,600.00	1.15
9	400789	中国国贸	600,000	3,936,000.00	1.15
10	300074	华平股份	186,113	3,463,562.93	1.01

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	2.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	162,201,000.00	47.20
其中: 政策性金融债	162,201,000.00	47.20	
4	企业债券	11,045,100.00	3.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,945,000.00	3.19
8	其他	-	-
9	合计	194,426,100.00	56.58

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	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	140407	14债07	50,000	50,825,000.00	14.79
2	140424	14债24	50,000	50,707,000.00	14.77
3	130431	13债31	200,000	20,610,000.00	6.00
4	130411	13债11	200,000	20,610,000.00	6.00
5	130418	13债18	200,000	19,988,000.00	5.82

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投资明细

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明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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明细

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
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持有国债期货。
11. 投资组合报告附注
(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。
(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中, 没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
(3) 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	113,575,676.46	32.47
其中: 股票	113,575,676.46	32.47	
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
其中: 债券	194,426,100.00	55.58	
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	36,436,103.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,500.49	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	2,486,000.00	0.99
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业	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,670,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,236,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	卫生和社会工作	-	-
P	教育、文化和体育业	-	-
Q	卫生和医药工作	4,133,000.00	1.21
R	农、林、牧、渔业	4,084,291.00	1.17
S	综合	-	-
合计		113,575,676.46	33.05

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	002008	大康农业	800,000	15,640,000.00	4.55
2	000100	TCL 集团	2,275,000	6,142,500.00	1.79
3	600584	长电科技	499,908	5,968,901.52	1.74
4	002065	首航节能	120,000	5,283,600.00	1.54
5	600884	鲁商置业	300,000	5,046,000.00	1.47
6	300137	先河环保	320,669	4,970,671.57	1.45
7	000927	一汽夏利	999,238	4,846,138.80	1.41
8	300077	恒信达	200,000	3,981,600.00	1.15
9	400789	中国国贸	600,000	3,936,000.00	1.15
10	300074	华平股份	186,113	3,463,562.93	1.01

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	2.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	162,201,000.00	47.20
其中: 政策性金融债	162,201,000.00	47.20	
4	企业债券	11,045,	