

信息披露 Disclosure

(上接B045版)

法人代表: 王常青
联系电话: (010) 65183888
传真电话: (010) 65182261
联系人: 权煜
客服电话: 400-8888-108
公司网站: www.csc108.com
(17) 国信证券股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法人代表: 何如
联系电话: (0755) 82130833
传真电话: (0755) 82133952
联系人: 周杨
客服电话: 95536
公司网站: www.guosen.com.cn
(18) 招商证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
法人代表: 宫少林
联系电话: (0755) 82943666
传真电话: (0755) 82943636
联系人: 林生迎
客服电话: 95565、400-8888-111
公司网站: www.newone.com.cn
(19) 广发证券股份有限公司
注册地址: 广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316层)
办公地址: 广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法人代表: 孙树明
联系电话: (020) 87556305
传真电话: (020) 87556305
联系人: 黄岚
客服电话: 95675
公司网站: www.gf.com.cn
(20) 中国银河证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法人代表: 陈有安
联系电话: (010) 66569430
传真电话: (010) 66568990
联系人: 田薇
客服电话: 4008-888-888
公司网站: www.chinastock.com.cn
(21) 申万宏源证券有限公司
注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层
法人代表: 李梅
联系电话: (021) 33389888
传真电话: (021) 33388224
联系人: 王序微
客服电话: 95523或4008895523
公司网站: www.swhysc.com
(22) 长江证券股份有限公司
注册地址: 武汉新华路特8号长江证券大厦
办公地址: 武汉新华路特8号长江证券大厦
法人代表: 杨泽柱
联系电话: (027) 76579999
传真电话: 027-85481900
联系人: 李良
客服电话: 95579或4008-888-999
公司网站: www.95579.com
(23) 安信证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单
元
办公地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单
元
法人代表: 牛冠兴
联系电话: (0755) 82568305
传真电话: (0755) 82568002
联系人: 陈剑虹
客服电话: 400-800-1001
公司网站: www.essence.com.cn
(24) 渤海证券股份有限公司
注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址: 天津市南开区滨水西道8号
法人代表: 杜庆平
联系电话: 022-28461709
传真电话: 022-28461892
联系人: 胡天彤
客服电话: 400-661-5988
公司网站: www.bhzzq.com
(25) 华泰证券股份有限公司
注册地址: 江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址: 江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法人代表: 吴万善
联系电话: 0755-82569143
传真电话: 0755-82492962
联系人: 孔晓君
客服电话: 95597
公司网站: www.htsc.com.cn
(26) 信达证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法人代表: 张志刚
联系电话: 010-63080988
传真电话: 01063080975
联系人: 唐静
客服电话: 400-800-8899
公司网站: www.cindasc.com
(27) 方正证券股份有限公司
注册地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法人代表: 雷杰
联系电话: (010) 5739062
传真电话: (010) 57390658
联系人: 徐锦福
客服电话: 95571
公司网站: www.foundersc.com
(28) 长城证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法人代表: 黄耀华
联系电话: (0755) 83516289
传真电话: (0755) 83515567
联系人: 刘阳
客服电话: (0755) 33680000(深圳)、400-6666-888(非深圳)
公司网站: www.cgws.com
(29) 光大证券股份有限公司
注册地址: 上海市静安区新闸路1508号
办公地址: 上海市静安区新闸路1508号
法人代表: 薛峰
联系电话: 021-22169999
传真电话: 021-22169134
联系人: 刘晨、李芳芳
客服电话: 95525
公司网站: www.ebscn.com
(30) 上海证券有限责任公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
法人代表: 龚德雄
联系电话: (021) 53519888
传真电话: (021) 53519888
联系人: 张瑾
客服电话: (021) 962518
公司网站: www.962518.com
(31) 平安证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区金田路42号中华国际交易广场8楼
办公地址: 深圳市福田区金田路42号中华国际交易广场8楼
法人代表: 杨宇翔
联系电话: 95511-8
传真电话: 95511-8
联系人: 郑舒雨
客服电话: 95511-8
公司网站: www.pingan.com
(32) 国都证券有限责任公司
注册地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法人代表: 常磊
联系电话: (010) 84183333
传真电话: (010) 84183311-3389
联系人: 黄静

客服电话: 400-818-8118
公司网站: www.guodu.com
(33) 东海证券股份有限公司
注册地址: 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法人代表: 刘化军
联系电话: 021-20333910
传真电话: 021-50498925
联系人: 王彦
客服电话: 95531; 400-8888-588
公司网站: www.longone.com.cn
(34) 中银国际证券有限责任公司
注册地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法人代表: 许刚
联系电话: 021-20328309
传真电话: 021-50372474
联系人: 王炜哲
客服电话: 400-620-8888
公司网站: www.bocichina.com
(35) 华西证券股份有限公司
注册地址: 四川省成都市陕西街239号
办公地址: 四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法人代表: 杨炯洋
联系电话: 010-5272373
传真电话: 028-86157275
联系人: 张曼
客服电话: 95584
公司网站: www.hx168.com.cn
(36) 宏源证券股份有限公司
注册地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址: 乌鲁木齐市天山区太平桥大街19号
法人代表: 冯戎
联系电话: 010-88085858
传真电话: 010-88085858
联系人: 李巍
客服电话: 4008-000-562
公司网站: www.hysec.com
(37) 齐鲁证券有限公司
注册地址: 济南市经七路86号
办公地址: 济南市经七路86号23层
法人代表: 李玮
联系电话: 0531-68889155
传真电话: 0531-68889185
联系人: 吴阳
客服电话: 95538
公司网站: www.qizq.com.cn
(38) 华福证券有限责任公司
注册地址: 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157号新天地大厦7至10层
法人代表: 黄金琳
联系电话: 0591-87383600
传真电话: 0591-87383610
联系人: 张宗锐
客服电话: 96326(福建省外请先拨0591)
公司网站: www.hfzq.com.cn
(39) 华龙证券有限责任公司
注册地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
办公地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法人代表: 李晓安
联系电话: 0931-4890208
传真电话: (0931) 4890628
联系人: 李昕田
客服电话: (0931) 96668、400689888
公司网站: www.hlzqgs.com
(40) 上海华信证券有限责任公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法人代表: 杨晓敏
联系电话: 021-38784818
传真电话: 021-68775878
联系人: 倪昀
客服电话: 68777877
公司网站: www.cf-clsa.com
(41) 中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11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层至21层
法人代表: 龙增来
联系电话: (0755) 82024442
传真电话: (0755) 82026539
联系人: 刘璇
客服电话: 95532、400-600-8008
公司网站: www.china-invsc.com
(42) 华宝证券有限责任公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法人代表: 陈林
联系电话: 021-68777222
传真电话: 021-68777822
联系人: 刘闻川
客服电话: 4008209898
公司网站: www.cnhbstock.com
(43) 北京启创启富投资管理有限公司
注册地址: 北京市西城区闹市口大街31号5号楼215A
办公地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法人代表: 梁静
联系电话: (010) 66154828
传真电话: (010) 88067526
联系人: 张旭
客服电话: 400-6262-818
公司网站: www.6182ch.com
(44) 和讯信息科技有限公司
注册地址: 北京市朝来公园二区22号泛利大厦10层
办公地址: 上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼
法人代表: 王莉
联系电话: 400-920-0022
传真电话: 021-20635879
联系人: 于畅
客服电话: 400-920-0022
公司网站: licaike.hexun.com
(45) 海天天基基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表: 其实
联系电话: 021-54509998
传真电话: 021-64385308
联系人: 潘世伟
客服电话: 400-1818-188
公司网站: www.1234567.com.cn
(46) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法人代表: 杨文斌
联系电话: (021) 56870011
传真电话: (021) 68596916
联系人: 张虹
客服电话: 4007009665
公司网站: www.ehowbuy.com
(47) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址: 杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法人代表: 陈柏青
联系电话: 021-60897840
传真电话: 0571-26690713
联系人: 张裕
客服电话: 4000766123
公司网站: www.fund123.com
(48) 嘉实财富管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表: 赵学军
联系电话: 021-20289890
传真电话: 021-20280110
联系人: 张倩
客服电话: 400-021-8850
公司网站: www.harvestwm.cn

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: 富国基金管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

法定代表人: 黄静

客服电话: 400-888-888

公司网站: www.fund123.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。

三、基金的投资

(一) 投资目标

本基金主要投资于城镇发展相关股票,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市

的股票)、固定收益类资产(国债、金融债、企业债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

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。

(三) 投资策略

1、大类资产配置
本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

2、股票投资策略
(1) 城镇发展相关股票的界定
本基金所界定的城镇发展相关股票主要指在国家战略高度布局下受益于中国“新型城镇化”进程的相关股票,包括体现城镇硬实力的地产

产业链概念、体现城镇软实力的城市信息化概念以及体现城市承载能力提高的绿色环保概念这三大类投资主线。

具体落实到行业上,目前包括6个申万一级行业,分别是建筑建材、房地产、电子、信息设备、信息服务及4个申万二级行业,分别是专用设备、非汽车交运设备、公共工程及服务、水务。未来通过收入分配制度改革、深化及其他政策或市场因素等,城镇化概念的外延将会逐渐扩大,例如更新“市民化”驱动的消费升级等,本基金可调整对上述行业界定,并在更新的招募说明书中进行公告。

一般情况下,本基金将参考申银万国行业体系对城镇发展相关股票进行界定;如个股经营范围或业务重点发生转变,但申万行业并未及时做出调整,本基金管理人可在充分论证后将其纳入城镇发展相关股票的范畴。如果未来申银万国证券研究所对其行业分类标准进行调整,则本基金管理人亦将根据情况进行相应的调整。如果未来申银万国证券研究所不再存续或不再发布该行业分类标准,亦或市场上出现了更加合理、科学的行业分类标准且符合本基金投资目标和权益理念的,本基金将视情况并履行相关程序后调整其采用的行业分类标准并公告。

(2) 个股投资策略
根据上述行业界定,三类投资主线范畴内的股票在公司商业轨迹及股价风格表现上存在差异,因此在具体选股策略须分为两类风格区对待:

1) 偏周期类行业股票
周期类行业股票是指与宏观经济联动性大,盈利随经济周期波动呈现周期性波动的行业。在本基金的主要投资对象中,地产基建概念相关股票存在偏周期类的风格趋向,主要集中在建筑建材、房地产、专用设备和非汽车交运设备这几个行业。

对于偏周期类行业股票,本基金将首要进行行业趋势判断,根据趋势走向的不同判定在选仓上采取进攻或者防御的组合构建,最后通过基本面分析精选个股。

在趋势分析上,基金管理人会综合房地产销售数据、新开工数据和行业景气指数以及机构研究报告做出判断。当行业趋势向上,宜采用进攻的策略,此时则根据PE等估值指标配股;当行业景气情况不佳,需采用防御的配置,此时则主要关注PB等指标。由于水泥等建材的弹性很大,估值指标需考虑动态指标。

2) 偏成长类行业股票
相对周期类而言,成长类行业股票,顾名思义,其具有高成长性,且对经济周期不敏感,而更多的受自身企业经营状况等非系统性因素影响。在本基金的主要投资对象中,城市信息化及绿色环保概念相关股票存在偏成长类的风格趋向,主要集中在电子、信息设备、信息服务、环保、水务这几个行业。

对于偏成长类行业股票,本基金首要进行自下而上的成长或成长性分析,可以从两个方面判定:过往成长能力及未来成长预期。过往成长能力主要指个股过去几年从财务数据上表现出来的持续成长特征。本基金将重点关注个股的净利润增长率、主营业务收入增长率及净资产收益率等指标,通过定量方法筛选出成长增速较快的企业。以上指标将连续多期观察,保证其成长能力的稳定性。未来成长预期主要是基于上市公司现有的基本面判断其是否具备在未来1年内持续增长的潜力。通过定性方法及实地调研,挖掘公司未来成长的驱动因素以及该驱动因素是否具有可持续性。

除了对拟投资股票的选股风格进行区分外,本基金在精选个股时还将关注的方面有:

1) 概念
调控政策的发布等因素会成为房地产市场概念的来源;核心技术的发现和产业政策颁布会成为电子、信息设备等行业概念的来源。本基金须深入剖析各类概念的真伪、可持续性和是否被过度挖掘,并提前布局适当参与。

2) 预期差
本基金将通过严谨的实地调研及论证,把握市场上出现的有效预期差,发现被低估的股票,例如前期覆盖度较低的个股或被噪音所扰但基本面较好的上市公司股票。

3) 估值水平
本基金将在组合构建时注重个股估值水平,以确定该股是否具有足够的安全边际,投资的风险收益比如何。指标方面,将持续跟踪个股的P/E、P/S、P/CF、PB等,并进行定量筛选和配置比例参考。

3、债券投资策略
本基金将采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上,根据对宏观经济发展状况、金融市场环境特点等因素的分析确定组合整体框架;对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种的价格变化进行跟踪,相机而动,积极调整。

(1) 久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险;

(2) 期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利;

(3) 市场转换是指管理人将针对债券子市场间不同运行规律和风险-收益特性构建和调整组合,提高投资收益;

(4) 相对价值判断是在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的类属,减持相对高估、价格将下降的类属;

(5) 信用风险评估是指基金管理人将充分利用现有行业与公司研究力量,根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估,以此作为品种选择的基本依据。

对于可转换债券的投资,本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性,以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益;本基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的转换条件、回售条件等。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产证

券化产品。
4、金融衍生工具投资
本基金还可运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具;
(1) 运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要通过波套利及风险对冲策略实现相对收益;
(2) 构建权证与债券的组合,利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性,形成本投资组合;
(3) 针对不同的市场环境,构建购举组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合,形成多元化的盈利模式;
(4) 在严格风险监控的前提下,通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究,谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。
基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

九、基金的业绩比较基准
沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%

十、风险收益特征

本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

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	1,057,694,626.31	86.39
	其中:股票	1,057,694,626.31	86.39
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	149,416,291.98	12.20
7	其他资产	17,239,140.82	1.41
8	合计	1,224,350,059.41	100.00

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	采矿业	-	-
C	制造业	435,984,026.30	36.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,558,383.69	5.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	74,318,288.33	6.19
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	216,514,144.69	18.04
I	住宿和餐饮业	-	-
J	金融业	125,215,000.00	10.43
K	房地产业	79,687,020.80	6.64
M	科学研究和技术服务业	24,319,756.30	2.03
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	40,128,000.00	3.34
S	综合	-	-
8	合计	1,057,694,626.31	88.13

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组合

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	000671	阳光城	8250,000	117,959,000.00	9.82
2	300257	开山股份	2,880,000	101,276,000.00	8.45
3	002318	久立特材	3,055,800	91,307,304.00	7.61
4	300253	欧比特	1,217,268	85,172,341.96	7.10
5	002421	诺安智能	2,559,245	76,915,389.20	6.41
6	300058	蓝色光标	2,880,000	60,825,600.00	5.07
7	300285	富创材料	1,780,062	51,906,607.92	4.32
8	600799	广安股份	8,200,001	51,578,363.69	4.30
9	000963	华联矿业	950,053	49,982,288.33	4.16
10	300203	莱尼科技	2,350,568	44,151,124.44	3.68

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券资产。

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组合

注:本基金本报告期末未持有债券资产。

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

注: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组合

注:本基金本报告期末未投资贵金属。

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组合

注: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

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有受到被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	资产名称	金额(元)
1	存出保证金	848,304.22
2	应收证券清算款	12,884,301.72
3	应收股利	-
4	应收利息	307,405.39
5	应收申购款	3,469,129.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,239,140.32

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合

十二、基金的业绩