

(上接B046版)

中国证券报

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日,本报台中所列财务数据未经审计。

1. 资产资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	208,113,871.84	38.21
	其中:股票	208,113,871.84	38.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	271,110,421.10	49.77
	其中:债券	271,110,421.10	49.77
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	54,549,950.98	10.01
9	其他各项资产	10,929,429.57	2.01
	合计	544,703,673.49	100.00

2. 按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	193,750,295.47	35.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,956.08	-
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	14,357,620.29	2.65
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	208,113,871.84	38.40

3. 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

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601567	三星电气	1,350,517	44,067,369.71	8.13
2	002509	广深发展	1,601,982	31,046,411.16	5.73
3	002050	三花股份	1,161,837	22,504,782.69	4.15
4	000700	横店科技	1,113,813	21,808,458.54	4.02
5	002094	青岛金王	1,063,362	20,958,865.02	3.87
6	002260	伊立浦	444,490	15,633,434.60	2.88
7	002159	三特索道	504,307	14,357,620.29	2.65
8	002121	科陆电子	493,500	13,826,835.00	2.50
9	002644	海利生物	45,175	12,969,742.50	2.39
10	002668	蓝思科技	1,188,825	11,234,396.25	2.07

4. 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	228,141,200.00	42.10
	其中:政策性金融债	228,141,200.00	42.10
4	企业债券	-	-
5	中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	42,969,221.10	7.93
8	其他	-	-
	合计	271,110,421.10	50.02

5. 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14国开13	800,000	80,000,000.00	14.76
2	110023	民生转债	234,650	32,210,405.50	5.94
3	140444	14农发44	300,000	30,036,000.00	5.54
4	100416	10农发16	300,000	30,003,000.00	5.54
5	150102	15国开2	300,000	29,922,000.00	5.52

6. 公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金无此项投资。

7. 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,包括国内市场依法发行的国债、金融债、企业债(含转换债券)、公开发行上市的股票以及中国证监会允许基金投资的权证及其衍生品种。本基金不投资于股票、金融衍生品(信用衍生品除外)为主要投资对象,以稳健型配置为主,风险控制策略为:风险资产占基金资产的比例是40%~95%,股票投资的单一品种比例不超过10%;持仓比例不超过10%的单一品种;投资于货币市场基金的比例不超过5%。

本基金的投资目标:“追求低风险的稳定的收益”,即以债券投资为主,稳健收益型股票投资为辅,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的稳定增值。

八、基金的投资策略

(一) 基本面投资策略包括以下四个方面:

1. 采取自下而上的投资分析方法,根据内外经济形势,在经济景气度观察的基础上,综合分析真实经济因素、物价水平变化趋势、国债政策与货币政策等因素,研判股票市场的投资环境的变化趋势,给资产配置提供依据。作为债券投资,本基金主要关注利率走势研究,根据利率来评价变化趋势和变化幅度,从而决定投资品种。

2. 根据收益率、流动性与风险匹配原则及证券的估值原则构建投资组合,合理配置不同市场和不同投资对象的投资比例,并根据投资环境的变化调整配置。具体包括:

(1) 根据证券所处市场、交易所买卖的股票和银行间债券市场的债券的收益率、流动性变化和预期收益率,选择投资品种。

(2) 根据宏观经济形势,结合宏观经济指标,通过利率差价策略选择投资品种。

(3) 投资于收益率和风险的匹配关系,本基金将充分考虑投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

(4) 评估组合的稳定性,对证券进行定期跟踪,根据证券的稳定性,对证券进行重新配置。

(5) 本基金将根据基本面研究结果,从宏观经济、分析投资、投资策略、债券投资等方面对公司研究各报告和建议报告,以投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(6) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(7) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(8) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(9) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(10) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(11) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(12) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(13) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(14) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(15) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(16) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(17) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(18) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(19) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(20) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(21) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(22) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(23) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(24) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(25) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(26) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(27) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(28) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(29) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(30) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(31) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(32) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(33) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(34) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(35) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(36) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(37) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(38) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(39) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(40) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(41) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(42) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(43) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(44) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(45) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(46) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(47) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(48) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(49) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(50) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(51) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(52) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(53) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(54) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(55) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。

(56) 本基金将根据投资决策委员会和基金经理会审定后执行。</div