

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	409,990,000.00	5.33
4	其中：政策性金融债	409,990,000.00	5.33
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债	3,945,832.80	0.06
9	其他	-	-
9	合计	413,925,832.80	5.38

五)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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140212	14国开12	2,000,000	200,040,000.00	2.60
2	140223	14国开23	800,000	80,080,000.00	1.04
3	150020	15国开20	600,000	59,944,000.00	0.78
4	140218	14国开18	500,000	50,020,000.00	0.65
5	120219	12国开19	200,000	19,996,000.00	0.26

六)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。

七)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

注:本基金本报告期末未持有权证。

八)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

注:本基金本报告期末未持有权证。

九)报告期末按公允价值占基金资产净值比例重估收益率情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

十)报告期内按公允价值占基金资产净值比例重估收益率情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

十一)报告组合报告附注

十二)本基金的投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

十三)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,872,771.93
2	应收证券清算款	82,010,716.57
3	应收股利	28,000.00
4	应收利息	12,557,137.24
5	应收申购款	7,719,447.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,188,072.77

十四)本基金报告期末未持有处于停牌期的可供出售股票。

十五)本基金报告期末前十名股票中除上述股票不在流通受限情况。

十六)十二、基金的业绩

基金管理人依据尽职尽责、诚信原则,勤勉尽责的履行管理责任和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读基金的招募说明书。

十七)基金的估值方法

本基金将根据对宏观经济走向和市场发展趋势的判断,以长期持有为主,辅以积极主动的波段操作。在操作过程中强调风险控制,及时剔除基本面恶化、短期估值过高的个股,并选择更具投资价值的成长股,对组合进行动态调整。本基金将把股票买入的进场跟踪维护,根据上市公司公开披露信息对本基金研究结果,定期按照本基金的投资理念,对上市公司重新进行排序评分,并及时剔除不符合标准的股票。

十八)“自下而上”的行业选择

本基金的投资将结合“自下而上”的行业分析,根据宏观经济运行,上下游行业运行态势与行业分布的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优秀的股票。

十九)本基金的估值方法

本基金将根据对宏观经济走向和市场发展趋势的判断,以长期持有为主,辅以积极主动的波段操作。在操作过程中强调风险控制,及时剔除基本面恶化、短期估值过高的个股,并选择更具投资价值的成长股,对组合进行动态调整。本基金将把股票买入的进场跟踪维护,根据上市公司公开披露信息对本基金研究结果,定期按照本基金的投资理念,对上市公司重新进行排序评分,并及时剔除不符合标准的股票。

二十)“自上而下”的行业选择

本基金的投资将结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行,上下游行业运行态势与行业分布的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优秀的股票。

二十一)基金的估值方法

本基金将根据对宏观经济走向和市场发展趋势的判断,以长期持有为主,辅以积极主动的波段操作。在操作过程中强调风险控制,及时剔除基本面恶化、短期估值过高的个股,并选择更具投资价值的成长股,对组合进行动态调整。本基金将把股票买入的进场跟踪维护,根据上市公司公开披露信息对本基金研究结果,定期按照本基金的投资理念,对上市公司重新进行排序评分,并及时剔除不符合标准的股票。

二十二)报告期投资损益

本基金将在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、差价策略、双向期权策略、卖空保护性的认沽权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

本公司将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

二十三)投资决策依据和决策程序

一、决策依据

(1)国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提;

(2)宏观经济发展趋势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础;

(3)投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金维护投资者利益的重要保障。

(4)基金评价指标。定期评价基金的绩效,基金经理在遵守投资决策委员会定的投资原则前提下,根据分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的的投资决策。

(5)进行风险评估。风险控制委员会定期召开会议,对基金投资组合进行风险评估,并提出风险控制意见。

(6)评估和调整决策程序:基金经理有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

二十四)基金的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%费率计提。管理费的计算方法如下:

H = E × 1.5% - 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

基金管理费由基金管理人向基金托管人支付。

基金管理费按前一日基金资产净值的0.25%的费率计提。托管费的计算方法如下:

H = E × 0.25% - 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

基金管理费由基金管理人向基金托管人支付。

基金管理费按前一日基金资产净值的0.05%的费率计提。支付日期按月。

基金管理费按前一日基金资产净值的0.05%的费率计提。基金管理费由基金管理人向基金托管人支付。

基金管理费按前一日基金资产净值的0.05