

(上接B068版)

法定代表人:彭文德  
客户服务电话:400-8877-780  
联系电话:023-86769742  
联系人:谢昕  
网址: www.cfc108.com  
4) 第一销售机构名称

(1) 深圳众禄基金销售有限公司  
注册地址:深圳市罗湖区笋岗路物资控股置地大厦8楼  
法定代表人:薛峰  
客服电话:4006-788-887  
传真:0755-82080798  
联系人:邓爱萍  
网址:www.zlfund.cn、www.jmmw.com  
(2) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司  
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室  
法定代表人:汪静波  
客服电话:400-821-5399  
传真:021-38509777  
联系人:何菁菁  
网址:www.noah-fund.com

(3) 杭州数米基金销售有限公司  
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈雁伟  
客服电话:4000-766-123  
传真:0571-26698533  
联系人:周婉雯  
网址:www.fund123.cn  
(4) 天相投顾有限公司  
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层  
法定代表人:林义相  
客服电话:010-66045678  
传真:010-66045627  
联系人:林冀  
网址:www.txsec.com

(5) 上海长量基金销售有限公司  
办公地址:上海市浦东新区浦东南路555号裕景国际B座16层  
法定代表人:张振伟  
客服电话:400-089-1289  
传真:021-58787698  
联系人:宋晓  
电话:021-5878878-8201  
传真:021-58787698  
客服电话:400-089-1289  
公司网站: www.erichfund.com  
(6) 上海好买基金销售有限公司  
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903-906室  
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室  
法定代表人:杨文斌  
客服电话:400-700-9665  
传真:021-50329599  
联系人:陶倩  
网址:www.ehowbuy.com

(7) 北京展恒基金销售有限公司  
办公地址:北京市西城区后厂峪路福安宫街6号  
法定代表人:周淑杰  
联系人:张晶晶  
传真:(+86-10) 6202 0088 转8802  
客服电话:400 888 6661  
网址:www.mylfund.com

(8) 浙江同顺基金销售有限公司  
办公地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903  
法定代表人:李晓峰  
客服电话:(0571)66768888  
传真:0571-88911818  
联系人:蒋泽君  
网址:www.10jqka.com.cn

(9) 上海天天基金销售有限公司  
住所: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10楼  
法定代表人:其实  
联系人:高莉莉  
联系电话:020-87599627  
客服电话:4001818188  
网址:www.1234567.com.cn

(10) 浙江金观诚财富管理有限公司  
住所:拱墅区观海路239号6号楼4楼403室  
办公地址:杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区8层  
法定代表人:陆彬彬  
联系人:鲁敏  
联系电话:0571-56028617  
客服电话:4000680050  
网址:www.jincheng-fund.com

(11) 和讯信息科技有限公司  
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
法定代表人:王朝  
联系人:于畅  
联系电话:021-20638688  
客服电话:400-920-0022  
网址:licaike.hexun.com

(12) 深圳市新兰德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1006H  
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006H  
法定代表人:马令海  
联系人:邓洁  
联系电话:010-58321388-1105  
客服电话:010-58325327  
网址:xinlanke.com

(13) 北京普华永道中天会计师事务所(北京)有限公司  
住所:北京市朝阳区建国路98号9号楼15层1809  
办公地址:北京市朝阳区建国路98号9号楼15层1809  
法定代表人:唐宁  
联系人:王巨明  
联系电话:010-52856650  
客服电话:400-6099-500  
网址:www.yixinfund.com

(14) 泛华普益基金销售有限公司  
住所:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室  
办公地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室  
法定代表人:于海峰  
联系人:黄嫒  
联系电话:028-84252471  
客服电话:400-8878-566  
网址:www.pyfund.cn

(15) 中期时代基金销售有限公司(北京)有限公司  
住所:北京市朝阳区建国路7号外光华路14号11层1103号  
办公地址:北京市朝阳区建国路7号外光华路16号1幢11层  
法定代表人:路甬  
联系人:侯建强  
联系电话:7010-59539888 ?  
客服电话:400-8888-160  
网址:www.citicofund.com

(16) 万银财富(北京)基金销售有限公司  
住所:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201  
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201  
法定代表人:李招弟  
联系人:毛怀哲  
联系电话:010-59393923  
客服电话:400-800-0069  
网址:www.wy-fund.com

(17) 深圳融元基金销售有限公司  
住所:深圳市福田区福华三路卓越世纪中心1号楼1806-1810  
办公地址:深圳市福田区福华三路卓越世纪中心1号楼1806-1810  
法定代表人:卓卓晶  
联系人:王妮娜  
联系电话:0755-33776853  
客服电话:4006-837-899  
网址:www.dowinfund.com

(18) 北京增财基金销售有限公司  
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室  
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室  
法定代表人:王昌庆  
联系人:罗细安  
联系电话:010-67000988  
客服电话:400-001-8811  
网址:www.zvcv.com.cn

(19) 北京恒天明泽基金销售有限公司  
住所:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层122室  
办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层122室  
法定代表人:黄伟伟  
联系人:侯仁伟  
联系电话:010-57756668  
客服电话:400-776-8668  
网址:www.chtfund.com

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。  
(二) 注册服务机构  
名称:鹏华基金销售有限公司(特准普通合伙)  
注册地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层  
办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层  
法定代表人:何如  
联系人:吴群刚  
联系电话:0755-82021106  
传真:0755-820211657

(三) 律师事务所  
名称: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:韩炯  
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
联系电话:(86 21)31313 8666  
传真:(86 21)31313 8600  
联系人:黎明  
经办律师:吕红、黎明

(四) 会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特准普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展展大厦6楼  
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
法定代表人:杨利华  
联系电话:(021)23238888  
注册会计师:申峰、魏佳亮  
联系人:魏佳亮

四、基金的名称  
本基金名称:鹏华金剛保本混合型证券投资基金

五、基金的类型和运作方式  
契约型开放式,保本混合型证券投资基金

六、基金的投资

(一) 保本周期内的投资  
1. 投资目标  
灵活运用投资组合保险策略,在保证本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。

2. 投资策略  
严谨的机制设计和严格的风险控制是获得本金安全及稳健增值的基础。

3. 投资范围  
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持债券、可转债、分离交易可转债、债券回购等)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例由优化的CPPI策略决定,并对比例范围有如下限制:权益类资产占基金资产的比例不超过40%;债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的60%,其中基金现金的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或中国证监会允许,基金管理人可在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

4. 投资策略  
本基金通过灵活运用投资组合保险策略,在本基金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。本基金的整体投资策略分为三个层次:第一层次,以保本为出发点的资产配置策略;第二层次,以追求本金安全和稳定的收益回报为目的固定收益类资产投资策略;第三层次,以股票为主要投资对象的权益类资产投资策略。

(1) 资产配置策略  
本基金以优化的恒定比例组合保险策略(CPPI)为核心,并结合对市场时机的把握,确定和调整基金资产在风险资产和无风险资产间的投资比例,规避系统性风险,确保本基金投资目标的实现。本基金利用CPPI进行资产配置的主要步骤是:

根据市场的波动情况和本基金资金的运作情况,确定和动态调整无风险资产和风险资产之间的配置比例,以确保风险资产的实际投资比例不超过风险资产的投资比例上限。

举一个例子说明该策略:假设本基金利用CPPI策略,期初投资1000万元于股票和债券,投资期限为期三年。债券收益率为3.36%。

期初(第一年初)基金管理人通过对市场的判断,确定放大倍数

为1.2,即:

故在第二年底,将297.24万元投资于债券,将769.33万元投资于债券。而在第二年底,基金拥有的债券市值为9667.48万元(936.03×(1+3.36%)=9667.48),故基金管理人卖出198.15万元债券,转换为股票。

因此如果股票上涨,那么投资组合净值上涨,安全垫增大,更多的资金从债券转到股票;如果股票下跌,那么投资组合净值下跌,安全垫缩小,更多的资金从股票转到债券;但投资组合净值最多下跌至底线,即安全垫最多缩小为零,这时投资组合全部转换为债券,投资组合沿着底线增值,到期增至本金1000万元,从而实现保本的目的。

本基金采用定性和定量两种分析方法确定放大倍数。基金管理人金融工程小组以相关波动率工具(包括风险资产的波动率水平、为减小构造成本而确定的放大倍数波动范围等)为依据,为本基金确定放大倍数提供数据支持。定性分析则侧重对宏观经济运行情况、利率水平及基金管理人对于风险资产/风险收益水平的预测等进行分析。通常情况下,本基金放大倍数不会超过2。

根据CPPI策略特点,放大倍数在一定时期内需保持恒定。在实际应用中,如果要保持安全垫放大倍数的恒定,则需要保持投资组合市值的变化随时调整风险资产与无风险资产的比例,而这将给基金带来高昂的交易费用。同时,当市场发生较大变化时,为维持恒定的放大倍数,基金的资金配置可能过于激进。因此,本基金放大倍数采取季度定期调整为佳,特殊情况下进行不定期调整的方式。

(2) 债券投资策略  
本基金将从风险和收益两个方面进行考虑来构建债券投资组合。债券资产首先必须是足够安全的,且债券的现金流收益率与保本周期相一致;在上述前提下,基金管理人将尽量选择收益率水平高的品种,以实现安全垫的最大化。

本基金将持有一部分剩余期限与保本周期相匹配的债券,另一部分兼顾收益性和流动性。本基金将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、利差策略、息差策略等,力争在债券投资层面为基金保本增值产生正向贡献。

1) 久期策略  
本基金将持有一部分剩余期限与保本周期相匹配的债券,主要按买入并持有方式操作以保证组合收益的稳定性,以期实现利率风险。

2) 收益率曲线策略  
收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一,本基金将根据此调整组合中、长、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测,适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合,并进行动态调整。

3) 骑乘策略  
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析,在可选的目标久期区间内买入期限位于收益率曲线较陡处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下,随着其剩余期限的衰减,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下降,从而获得较高的资本收益;即便收益率曲线上升或进一步变陡,这一策略也能够提供更多的安全边际。

4) 息差策略  
本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资的收益。

(3) 利率策略  
本基金将通过对两个期限相近的债券的利差进行分析,从而对利差水平的未来走势作出判断,进而相应地进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的主要因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当期利差水平缩小时,买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当期利差水平扩大时,则进行相反的操作。

(4) 新股申购策略  
本基金将根据新发行人的基本情况,结合对认购中签率和新股上市后表现的预期,并考虑保本周期的期限限制,谨慎参与新股申购,获取股票一级市场与二级市场的价差收益。

(5) 权证投资策略  
本基金将权证看作是辅助性投资工具,权证的投资原则为有利于基金资产增值、增值,有利于加强基金风险控制。

5. 业绩比较基准  
三年定期存款税后利率  
三年定期存款利率是中国人民银行制定的货币利率之一,反映了居民闲置资金在银行存款三年定期存款所能获得的年收益率,扣除利息税后为实际可得收益率。该利率可反映本基金目标客户群体风险偏好好且期限与本基金保本周期一致,可以作为本基金的业绩比较基准。

如果有更适当的,更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,履行适当程序后,调整业绩比较基准并及时公告。

6. 风险收益特征  
本基金属于保本混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的低风险品种。  
7. 投资决策依据  
(1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;  
(2) 经济运行态势和证券市场走势。  
8. 投资决策流程

(1) 基金经理及金融工程师,以CPPI技术为基础,依据量化手段,计算大类资产配置比例及相关系数,提交投资决策委员会审议;  
(2) 投资决策委员会:审议并确定大类资产配置比例及整体投资策略。投资决策委员会定期召开会议,由公司总经理或指定人员召集,如需做及时重大决策或基金经理小组提议,可临时召开;

(3) 基金经理:在严格遵守大类资产配置比例及其他相关要求的前提下,确定配置比例;长期、中期结构并挑选合适的股票、债券等品种;  
(4) 集中交易室:执行基金经理下达的交易指令;  
(5) 监察稽核部门:进行全程风险评估、监测和绩效分析。

本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在基金招募说明书更新中予以公告。

(二) 转型后的“鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金”的投资  
1. 投资目标  
追踪宏观经济周期,自上而下地进行资产配置,力争基金资产长期稳定增值。

2. 投资范围  
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产的30%-80%,其中权证资产占基金资产净值的比例不超过3%;债券、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其它金融工具占基金资产的20%-70%,其中基金现金的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种或对基金投资组合比例有新的规定,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

3. 投资管理  
宏观经济周期以一定的规律影响各类资产的投资收益。

4. 投资策略  
本基金采用积极主动的投资方法,遵循宏观经济周期的规律,自上而下地进行大类资产配置,债券投资和股票投资等,在严格控制风险的前提下,力争基金资产的长期稳定增值。

(1) 大类资产配置策略  
本基金综合运用定性和定量的分析手段,在对宏观经济因素进行充分研究的基础上,判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论,结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内大类资产风险和预期收益率的评估,确定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例,调整原则和调整策略。

本基金关注并分析宏观经济指标,包括M1、M2、PPI、CPI、GDP增长率、工业增加值、发电量、进出口、PMI指数、工业总产值、预算内工业企业销售收入、社会商品零售额、国内商品纯购进、国内商品销售、海陆进出口额、货币流通量、银行现金收入等。通过对这些指标的跟踪,以及对宏观经济政策的把握,判断宏观经济的走势。在完成一次配置之后,本基金将结合宏观经济周期的滞后指标对宏观经济进行持续分析,对经济运行中已经出现的峰、谷进行确认,并相应调整资产配置。通过对经济周期持续、完整的跟踪及分析,对资产配置的效果进行总结,完善资产配置策略。

(2) 股票投资策略  
1) 行业配置策略  
宏观经济周期对股票市场的影响将通过行业板块的周期性表现来体现,同时市场状况、技术水、产业政策等因素都会对行业特性产生影响。本基金将通过历史资料的统计分析和实地调研,自上而下进行行业配置。

A. 定性分析  
本基金将重点关注影响行业特性的重要因素,包括以下几个方面:产业政策。产业政策是政府管理和调控行业的主要手段,包括产业结构调整政策、产业组织政策、产业政策和技术政策等。本基金将深入分析行业政策,把握行业发展动向。

产业组织。指同一产业内企业的组织形态和企业间的关系,包括市场结构、市场行为、市场绩效等方面。产业组织创新能在一定程度上引起企业生命周期运行轨迹或持续时间上的变化。本基金将用全局的眼光,重点对能够引起产业组织变化的因素进行分析,从而判断产业发展前景与趋势。

技术水平。技术水平的进步将会改变一个行业的面貌,这一点不光在高科技产业表现突出,同时也会引起传统行业的升级。

其他因素。需求变化是未来优势产业的发展方向,并在相当程度上影响行业的兴衰,因此对社会习惯变化的关注和行业分析,有助于对行业前景的预测。全球化是现代社会新兴的经济现象,并使得传统的经济学原理在某些方面失效,本基金将充分重视包含全球化因素在内的新兴因素对行业产生的影响,适当调整行业分析理论和方法,从而做出更贴近真实的判断。

B. 定量分析  
通过对行业PB、PE等指标分析,比较行业相对估值和绝对估值水平,结合行业盈利状况和盈利预期等因素,把握行业轮动规律。

2) 个股投资策略  
为评估个股的投资价值,本基金将借助于定量分析和定性分析相结合的方式,对行业内个股进行研究和分类。

A. 定性分析  
财务分析。通过对资产负债率、流动比率、速动比率等偿债能力指标、应收账款周转率、存货周转率等营运能力指标、资本金利润率、销售利润率(营业收入/利息率)、成本费用利润率等盈利能力指标的分析,比较其与行业内其他企业的相对地位,鉴别企业的投资价值。

估值分析。在企业的价值被低估时买入,高估时卖出,可以获得丰厚的投资回报。基金将选择运用相对估值方法和绝对估值方法,挖掘出其未来价值的潜力。

在定量分析中,本基金还将关注上市公司基本发生重大变化对其未来价值的影响。

B. 定量分析  
在定量分析的基础上,本基金采用定性分析的方法研究并考察上市公司公司的品质和可靠性,以便从更长周期的角度保证定量方法所选出上市公司增长的持续性。

上市公司盈利增长的持续性取决于增长背后的驱动因素,这些驱动因素往往是上市公司具备的相对竞争优势,具体包括技术优势、资源优势、战略优势、公司治理优势和商业模式优势等。本基金将通过上市公司技术水平、资源状况、公司治理、管理结构和商业模式的分析,判断推上市公司主营业务收入及上市公司利润增长的可持续性和可保持的时间,进而判断上市公司长期投资价值。

技术优势分析。主要通过对公司主要产品更新周期、拥有专有技术和专利、对引进技术的消化、吸收和改进能力以及自主创新产品能力等进行考察和分析,进而判断公司的技术水平和技术依赖程度。

资源优势分析。主要通过对公司的规模、政策支持程度、成本、进入壁垒、国内外同行企业比较和垄断性等指标进行考察和分析,进而判断公司的资源优劣是否支持其持续发展。

公司战略分析。公司战略是决定公司未来及长期发展的指导性思想,体现公司的眼光和潜力,并会最终体现在公司业绩上,是进行公司未来价值评价的重要因素。

公司治理结构分析。良好的战略及愿景需要通过坚定地执行业务来实现,公司治理结构从制度上保证公司的执行,影响公司业绩的实现。

商业模式分析。公司的商业模式决定了公司在其所属行业发展的潜力和方向,本基金将分析行业和公司商业模式的特点,分析其商业模式。

(3) 新股申购策略  
本基金将根据新发行人的基本情况,结合对认购中签率和新股上市后表现的预期,谨慎参与新股申购,获取股票一级市场与二级市场的价差收益。

(4) 债券投资策略  
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析,在可选的目标久期区间内买入期限位于收益率曲线较陡处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下,随着其剩余期限的衰减,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下降,从而获得较高的资本收益;即便收益率曲线上升或进一步变陡,这一策略也能够提供更多的安全边际。

5. 业绩比较基准  
沪深300指数收益率×65%+中债总指数收益率×35%  
沪深300指数是由上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成分股指数,覆盖了沪深市场六成左右市值,具有较好的市场代表性;中债总指数是反映债券全市场的整体价格和回报情况的指数。此外,本基金按照预期的大类资产配置比例设置了业绩基准的权重。

如果指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、或有更适当的,更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,履行适当程序后,调整业绩比较基准并及时公告。

6. 风险收益特征  
本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其风险和预期收益高于

于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

7. 投资决策依据  
(1) 有关法律、法规、基金合同等的相关规定;  
(2) 经济运行态势和证券市场走势;  
8. 投资决策程序

(1) 本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划,投资原则投其它重大事项;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整 and 日常管理等工作;

(2) 基金经理构建、调整投资组合,并在此过程中充分考虑以下因素:每日基金申购和赎回净现金流量;基金合同的投资限制和比例限制;研究团队的投资建议;绩效与风险评估小组的建议等;

(3) 交易执行相关部门根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(4) 风险绩效相关部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告;

(5) 监察稽核相关部门对投资合规性进行监控;

本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在基金招募说明书更新中予以公告。

(三) 基金的投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会、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法律责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年4月16日复核了本报告期内财务指标、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、误导性陈述或重大遗漏。

本报告中所有财务数据截至至2015年3月31日(未经审计)。

1. 报告期末本基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	68,533,065.66	10.57
其中:股票	68,533,065.66	10.57	
2	固定收益投资	429,590,703.00	66.25
其中:债券	429,590,703.00	66.25	
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	112,200,194.25	17.30
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	21,350,385.97	3.29
7	其他资产	16,744,806.28	2.58
8	合计	648,419,155.16	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	28,385,121.91	4.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,431,860.00	0.53
F	批发和零售业	10,152,165.00	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	8,006,760.00	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,364,061.99	2.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,193,096.76	0.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	68,533,065.66	10.67

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	300089	长城集团	420,500	14,086,750.00	2.19
2	601933	永辉超市	880,500	10,152,165.00	1.58
3	601021	春秋航空	92,000	8,006,760.00	1.25
4	300271	华宇软件	99,915	7,195,878.30	1.12
5	002273	水晶光电	187,350	4,822,389.00	0.75
6	300005	探路者	156,300	4,604,598.00	0.72
7	301011	振芯科技	96,900	4,022,319.00	0.63
8	300168	万润科技	49,000	3,916,254.00	0.61
9	002375	亚厦股份	112,520	3,431,860.00	0.53
10	300075	新华保险	41,049	2,557,763.19	0.40

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,825,000.00	3.09
其中:政策性金融债	19,825,000.00	3.09	