

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	000364	际华集团	6,226,762	76,201,120.00	1.46
2	000166	同益股份	2,760,000	21,567,000.00	0.98
3	000896	江铃发展	2,152,880	27,630,480.00	0.72
4	002008	中信特钢	1,000,791	21,767,196.34	0.62
5	000377	正海能源	600,014	19,380,450.00	0.53
6	000007	华神集团	767,794	16,246,301.30	0.44
7	000006	横州国际	2,300,000	16,762,000.00	0.43
8	000626	长安汽车	920,002	12,080,567.62	0.30
9	000967	北方股份	600,000	12,481,000.00	0.30
10	000619	贵州茅台	60,000	11,533,760.00	0.22

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	122000	11国债(1)	2,000,000	305,304,000.00	63.92
2	120002	08国债(2)	3,304,340	315,320,090.40	66.02
3	110220	11国债(2)	2,000,000	211,220,000.00	44.13
4	122009	11国债(2)	1,040,790	167,076,281.80	35.03
5	122010	11国债(2)	1,985,000	285,665,260.00	59.77

1.1.1 投资组合报告附注

1.1.1.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.1.1.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

序号	股票代码	股票名称	报告期期初和期末公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	报告期变动情况说明
1	601877	正泰电器	19,903,426.68	0.88	无重大事项停牌
2	600067	北方创业	12,461,100.00	0.26	无重大事项停牌

§12基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产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

2013.11.1-2014.12.31	16.94%	0.11%	163.37%	0.28%	-0.69%	-0.10%
2015.1.1-2015.6.30	12.05%	0.26%	4.70%	0.40%	8.32%	-0.72%
自基金成立起至今	2033.22%	0.05%	92.23%	0.21%	300.95%	0.29%

§ 13 基金的费用概览

(一) 与基金运作有关费用

1、基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费；