

(上接B106版)

(129) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	注册地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
(130) 浙商证券股份有限公司	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
	法定代表人	吴承根
	电话	(0571) 87901912 传真 (0571) 87901913 网址 www.zq.com.cn 客服电话 (0571) 96777
	住所、办公地址	深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层(518048)
(131) 平安证券股份有限公司	住所、办公地址	深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层(518048)
	法定代表人	詹露阳
	电话	021-38931117 传真 021-58991806 网址 http://www.pingan.com.cn 客服电话 95511-8
	住所、办公地址	广西桂林市七星路13号
(132) 国海证券股份有限公司	住所、办公地址	广西南宁市桂海大道10号
	法定代表人	张维桥
	电话	0755-82700350 传真 0755-83700205 网址 www.ghtz.com.cn 客服电话 95563 (全国)
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(133) 东吴证券股份有限公司	住所、办公地址	苏州市工业园区苏州大道东218号
	法定代表人	李荣
	电话	0755-82211572 传真 0755-82211572 网址 www.dwzq.com.cn 客服电话 95528
	住所、办公地址	贵州省贵阳市中华北路77号
(134) 上海证券有限责任公司	住所、办公地址	上海市常熟路293号
	法定代表人	陆俊
	电话	021-33333333 传真 021-60448825 网址 www.shzq.com.cn 客服电话 400-818-8118
	住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号
(135) 恒泰证券股份有限公司	住所、办公地址	内蒙古自治区呼和浩特市新城新区新华大街111号
	法定代表人	魏立
	电话	01018418389 传真 01018418389 网址 www.htht.com.cn 客服电话 400-818-8118
	住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号
(136) 中国银河证券股份有限公司	住所、办公地址	北京市西城区金融大街29号
	法定代表人	陈共
	电话	01016973286 传真 01016973286 网址 www.chinastock.com.cn 客服电话 95551
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(137) 西南证券股份有限公司	住所、办公地址	四川省成都市高新区天府二街111号
	法定代表人	魏庆华
	电话	02987416168 传真 02987406710 网址 www.swsec.com.cn 客服电话 95582
	住所、办公地址	陕西省西安市东大街23号
(138) 华龙证券有限责任公司	住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
	法定代表人	李俊安
	电话	0931-4880028 传真 0931-4880028 网址 www.hljzq.com.cn 客服电话 95582
	住所、办公地址	浙江省杭州市西湖区文苑路111号
(139) 新通证券股份有限公司	住所、办公地址	浙江省杭州市上城区平海路15号
	法定代表人	沈卫平
	电话	0571-87925129 传真 0571-87918329 网址 www.xtsec.com 客服电话 95523 (上海地区)
	住所、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
(140) 上海证券有限责任公司	住所、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
	法定代表人	邵琦
	电话	021-38784817 传真 021-38775878 网址 www.shzq.com.cn 客服电话 88777777
	住所、办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01B0单元
(141) 东莞证券有限责任公司	住所、办公地址	广东省东莞市莞城区运河东一路111号
	法定代表人	李俊安
	电话	0931-4880028 传真 0931-4880028 网址 www.hljzq.com.cn 客服电话 95582
	住所、办公地址	浙江省杭州市西湖区文苑路111号
(142) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(143) 中山证券有限责任公司	住所、办公地址	广东省深圳市福田区金田路2026号
	法定代表人	林斌
	电话	0755-82700350 传真 0755-82700205 网址 www.zszq.com.cn 客服电话 95528
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(144) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(145) 江海证券有限公司	住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路333号
	法定代表人	孙名坤
	电话	0451-5883728 传真 0451-5883728 网址 www.jhzq.com.cn 客服电话 400-666-2288
	住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号
(146) 国金证券股份有限公司	住所、办公地址	四川省成都市东城根上街56号
	法定代表人	冉云
	电话	028-86660067 传真 028-86660067 网址 www.gjzq.com.cn 客服电话 95310
	住所、办公地址	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
(147) 中国银河证券股份有限公司	住所、办公地址	北京市西城区金融大街29号
	法定代表人	陈共
	电话	01016973286 传真 01016973286 网址 www.chinastock.com.cn 客服电话 95551
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(148) 华宝证券有限责任公司	住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心65层
	法定代表人	陈琳
	电话	021-68777222 传真 021-68777222 网址 www.huabao.com.cn 客服电话 4008288888
	住所、办公地址	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
(149) 长城证券股份有限公司	住所、办公地址	深圳市福田区金田路2026号
	法定代表人	王勇
	电话	06502207929 传真 06502207902 网址 www.cgwz.com.cn 客服电话 400-0999-486
	住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1000号32楼
(150) 爱建证券有限责任公司	住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1000号32楼
	法定代表人	宫龙云
	电话	021-32229898 传真 021-68772782 网址 www.wjzq.com.cn 客服电话 021-63340678
	住所、办公地址	北京市西城区金融大街10号
(151) 华泰证券股份有限公司	住所、办公地址	北京市西城区金融大街10号
	法定代表人	李志刚
	电话	010-85566008 传真 010-85566008 网址 www.htsec.com.cn 客服电话 400-888-4889
	住所、办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
(152) 天风证券股份有限公司	住所、办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
	法定代表人	余磊
	电话	027-87610062 传真 027-87611893 网址 www.tfzq.com.cn 客服电话 4008006000
	住所、办公地址	北京市西城区金融大街10号
(153) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(154) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(155) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼

(1) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	注册地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
(130) 浙商证券股份有限公司	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
	法定代表人	吴承根
	电话	(0571) 87901912 传真 (0571) 87901913 网址 www.zq.com.cn 客服电话 (0571) 96777
	住所、办公地址	深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层(518048)
(131) 平安证券股份有限公司	住所、办公地址	深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层(518048)
	法定代表人	詹露阳
	电话	021-38931117 传真 021-58991806 网址 http://www.pingan.com.cn 客服电话 95511-8
	住所、办公地址	广西桂林市七星路13号
(132) 国海证券股份有限公司	住所、办公地址	广西南宁市桂海大道10号
	法定代表人	张维桥
	电话	0755-82700350 传真 0755-83700205 网址 www.ghtz.com.cn 客服电话 95563 (全国)
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(133) 东吴证券股份有限公司	住所、办公地址	苏州市工业园区苏州大道东218号
	法定代表人	李荣
	电话	0755-82211572 传真 0755-82211572 网址 www.dwzq.com.cn 客服电话 95528
	住所、办公地址	贵州省贵阳市中华北路77号
(134) 上海证券有限责任公司	住所、办公地址	上海市常熟路293号
	法定代表人	陆俊
	电话	021-33333333 传真 021-60448825 网址 www.shzq.com.cn 客服电话 400-818-8118
	住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号
(135) 恒泰证券股份有限公司	住所、办公地址	内蒙古自治区呼和浩特市新城新区新华大街111号
	法定代表人	魏立
	电话	01018418389 传真 01018418389 网址 www.htht.com.cn 客服电话 400-818-8118
	住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号
(136) 中国银河证券股份有限公司	住所、办公地址	北京市西城区金融大街29号
	法定代表人	陈共
	电话	01016973286 传真 01016973286 网址 www.chinastock.com.cn 客服电话 95551
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(137) 西南证券股份有限公司	住所、办公地址	四川省成都市高新区天府二街111号
	法定代表人	魏庆华
	电话	02987416168 传真 02987406710 网址 www.swsec.com.cn 客服电话 95582
	住所、办公地址	陕西省西安市东大街23号
(138) 华龙证券有限责任公司	住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
	法定代表人	李俊安
	电话	0931-4880028 传真 0931-4880028 网址 www.hljzq.com.cn 客服电话 95582
	住所、办公地址	浙江省杭州市西湖区文苑路111号
(139) 新通证券股份有限公司	住所、办公地址	浙江省杭州市上城区平海路15号
	法定代表人	沈卫平
	电话	0571-87925129 传真 0571-87918329 网址 www.xtsec.com 客服电话 95523 (上海地区)
	住所、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
(140) 上海证券有限责任公司	住所、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
	法定代表人	邵琦
	电话	021-38784817 传真 021-38775878 网址 www.shzq.com.cn 客服电话 88777777
	住所、办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01B0单元
(141) 东莞证券有限责任公司	住所、办公地址	广东省东莞市莞城区运河东一路111号
	法定代表人	李俊安
	电话	0931-4880028 传真 0931-4880028 网址 www.hljzq.com.cn 客服电话 95582
	住所、办公地址	浙江省杭州市西湖区文苑路111号
(142) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(143) 中山证券有限责任公司	住所、办公地址	广东省深圳市福田区金田路2026号
	法定代表人	林斌
	电话	0755-82700350 传真 0755-82700205 网址 www.zszq.com.cn 客服电话 95528
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(144) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(145) 江海证券有限公司	住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路333号
	法定代表人	孙名坤
	电话	0451-5883728 传真 0451-5883728 网址 www.jhzq.com.cn 客服电话 400-666-2288
	住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号
(146) 国金证券股份有限公司	住所、办公地址	四川省成都市东城根上街56号
	法定代表人	冉云
	电话	028-86660067 传真 028-86660067 网址 www.gjzq.com.cn 客服电话 95310
	住所、办公地址	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
(147) 中国银河证券股份有限公司	住所、办公地址	北京市西城区金融大街29号
	法定代表人	陈共
	电话	01016973286 传真 01016973286 网址 www.chinastock.com.cn 客服电话 95551
	住所、办公地址	浙江省温州市龙湾区永宁街566号
(148) 华宝证券有限责任公司	住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心65层
	法定代表人	陈琳
	电话	021-68777222 传真 021-68777222 网址 www.huabao.com.cn 客服电话 4008288888
	住所、办公地址	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
(149) 长城证券股份有限公司	住所、办公地址	深圳市福田区金田路2026号
	法定代表人	王勇
	电话	06502207929 传真 06502207902 网址 www.cgwz.com.cn 客服电话 400-0999-486
	住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1000号32楼
(150) 爱建证券有限责任公司	住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1000号32楼
	法定代表人	宫龙云
	电话	021-32229898 传真 021-68772782 网址 www.wjzq.com.cn 客服电话 021-63340678
	住所、办公地址	北京市西城区金融大街10号
(151) 华泰证券股份有限公司	住所、办公地址	北京市西城区金融大街10号
	法定代表人	李志刚
	电话	010-85566008 传真 010-85566008 网址 www.htsec.com.cn 客服电话 400-888-4889
	住所、办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
(152) 天风证券股份有限公司	住所、办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
	法定代表人	余磊
	电话	027-87610062 传真 027-87611893 网址 www.tfzq.com.cn 客服电话 4008006000
	住所、办公地址	北京市西城区金融大街10号
(153) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(154) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼
(155) 国联证券股份有限公司	住所、办公地址	江苏省无锡市太湖新城一街8号
	法定代表人	姚志勇
	电话	0610-82831662 传真 0610-82830162 网址 www.gliac.com.cn 客服电话 96670 (0511) 96777
	住所、办公地址	浙江省杭州市拱墅区黄龙世纪广场A座6-7楼

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	000028	国药一致	2,684,976	217,214,588.40	5.79
2	000963	华东医药	3,545,244	176,198,626.80	4.70
3	000063	中兴通讯	5,840,762	138,689,698.88	3.70
4	000661	格力电器	3,208,660	132,098,062.00	3.52
5	600703	三安光电	5,369,380	156,776,788.00	2.82
6	600887	伊利股份	3,760,801	81,196,627.00	2.17
7	002027	分众传媒	5,823,400	120,298,984.00	2.14
8	600036	招商银行	3,348,500	80,062,636.00	2.14
9	002450	康得新	3,381,452	76,150,289.04	2.03
10	601318	中国平安	1,449,927	71,930,878.47	1.92

(6) 报告期末按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	248,525,000.00	6.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	621,744,000.00	16.68
其中:政策性金融债	621,744,000.00	16.68	
4	企业债券	-	-
5	企业信用类融资资产	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	97,473.30	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	870,366,473.30	23.21

(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10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	120009	12国债09	2,500,000	248,525,000.00	6.63
2	150201	15国债01	1,800,000	179,872,000.00	4.80
3	160419	16农发19	1,800,000	179,874,000.00	4.80
4	110228	11国债06	1,000,000	101,810,000.00	2.72
5	160217	16国债17	600,000	59,688,000.00	1.59

(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10名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

(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5名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

(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5名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

(6) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

(6) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

(1) 投资组合报告附注

① 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门处罚,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

② 本基金投资的前十名证券中,没有列出基金合同约定的备选股票之外的股票。

③ 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	661,070.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	11,333,815.76
4	应收利息	11,667.35
5	应收中购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,114,553.31

(6) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122001	蓝创转债	97,473.30	0.00

⑤ 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

3. 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	22,133,517.12	1.35
其中:股票	22,133,517.12	1.35	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,582,107,013.30	96.39
其中:债券	1,582,107,013.30	96.39	
资产支持证券	-	-	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,237,040.06	0.44
8	其他资产	30,074,815.77	1.83
9	合计	1,641,552,440.25	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	22,133,517.12	1.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
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	-	22,133,517.12	1.76

(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10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	002241	歌尔股份	1,148,004	22,133,517.12	1.76

注:报告期末,本基金仅持有上述1只证券。

(4) 报告期末按公允价值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	107,135,854.20	8.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	249,456,563.00	19.87
其中:政策性金融债	249,456,563.00	19.87	
4	企业债券	264,406,533.10	21.06
5	企业信用类融资资产	289,527,000.00	22.85
6	中期票据	630,406,500.00	49.31
7	可转债(可交换债)	60,022,763.00	4.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,582,107,013.30	126.00

(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5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	010017	21国债07	755,800	80,591,640.00	6.42
2	150101	15国债01	700,000	69,890,000.00	5.57
3	160206	17国债06	600,000	57,624,000.00	4.59
4	118227	11国债27	500,000	51,580,000.00	4.11
5	170206	17国债06	500,000	49,800,000.00	3.97

(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10名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

(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5名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

(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5名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

(6) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

(6) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

(1) 投资组合报告附注

① 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门处罚,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

② 本基金投资的前十名证券中,没有列出基金合同约定的备选股票之外的股票。

③ 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,839.38
2	应收证券清算款	1,818,972.90
3	应收股利	-
4	应收利息	28,144,597.37
5	应收中购款	49,406.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,074,815.77

(4) 报告期末处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	14宝钢债B	18,789,000.00	1.50
2	110032	一转债	15,024,636.00	1.20
3	123004	14国信债B	2,783,322.60	0.22
4	110033	恒顺转债	2,511,688.00	0.20
5	110034	九州转债	1,285,500.00	0.10
6	123005	14国信债A	998,215.00	0.08

⑤ 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

2. 基金的投资策略

本基金采用价格优选法,通过买入、增持或卖出,动态调整投资组合,投资于本基金,但不保证基金一定盈利,也不保证收益覆盖,基金的投资运作并不对投资者未来投资收益和投资风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 资产配置策略

1. 基金投资组合将主要投资于与同期业绩比较基准收益特征相似的

2. 本基金合同规定的基金资产净值中非现金资产及其比例范围内投资于本基金收益变动的资产。

阶段	净值增长率	业绩比较基准	超额收益	超额收益	①-③	②-④
2003年7月9日至2004年12月31日	6.49%	0.41%	-17.35%	1.16%	23.84%	-0.75%
2004年度	15.56%	0.89%	-15.41%	1.52%	20.99%	-0.63%
2005年度	8.85%	0.93%	-13.29%	1.67%	22.14%	-0.74%
2006年度	114.77%	1.16%	92.60%	1.59%	22.11%	-0.47%
2007年度	107.39%	1.60%	107.65%	2.59%	89.86%	-0.99%
2008年度	-29.36%	1.76%	-36.80%	1.92%	-18.96%	-1.61%
2009年度	60.33%	1.37%	14.04%	2.28%	-73.70%	-0.91%
2010年度	24.87%	1.20%	11.30%	1.90%	13.57%	-0.69%
2011年度	-18.72%	0.96%	-32.34%	1.55%	13.26%	-0.69%
2012年度	5.55%	0.96%	0.39%	1.59%	5.16%	-0.64%
2013年度	14.12%	1.12%	13.89%	1.46%	-4.36%	-0.34%
2014年度	14.88%	1.00%	41.15%	1.27%	-26.72%	-0.27%
2015年度	67.43%	2.28%	67.66%	2.28%	-9.77%	-1.01%
2016年度	-7.80%	1.41%	-9.54%	1.19%	17.4%	0.22%
2017年止	-17.17%	0.75%	-4.40%	0.65%	-2.98%	0.20%