

(上续C18)

(1) 在分析研究报告的基础上,基金经理根据月度投资计划并提交投资决策委员会审议。
(2) 投资决策委员会根据分析师提供的投资建议,制定投资组合。
(3) 根据研究报告,基金经理在“自上而下”的大类资产配置策略下,选择合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。
(4) 根据交易员执行交易指令。

(5) 业绩比较基准
本基金的投资组合应遵循以下限制:
(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;其中对实物公司债券的投资比例不低于债券资产的80%,长期债券(不含金融债和金融债券)的比例不低于基金资产的50%;中期票据(不含中小企业私募债)的比例不低于基金资产的10%;短期融资券(不含中小企业短期融资券)的比例不低于基金资产的10%;中期票据(不含中小企业短期融资券)的比例不低于基金资产的10%;
(2) 本基金不持有信用等级低于AA+的债券资产;其中信用评级为AA+的债券资产,其公允价值不得超过基金资产净值的20%;
(3) 本基金持有的同一上市公司股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4) 本基金管理人管理的全部基金持有同一上市公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券净值的10%;
(6) 本基金管理人管理的全部基金持有同一权证,不得超过该权证的10%;
(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券净值的10%;
(8) 本基金持有同一信用评级资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(10) 本基金管理人管理的本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(11) 本基金投资于信用评级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券,本基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以调整。
(12) 本基金管理人管理的本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(13) 本基金持有同一上市公司发行的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(14) 本基金管理人管理的本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,其公允价值不得超过该资产支持证券规模的10%;
(15) 法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他投资限制。

除中国证监会规定的特殊基金品种外,基金管理人应当在每个交易日结束前,将前一个交易日所持有本基金资产净值,按照公允价值进行估值,并在规定时间内公布。基金管理人应当根据相关法律法规及中国证监会的规定,制定估值政策和程序,并定期对估值政策和程序进行检讨,以保证基金资产估值的准确性。基金管理人应当根据相关法律法规及中国证监会的规定,制定估值政策和程序,并定期对估值政策和程序进行检讨,以保证基金资产估值的准确性。基金管理人应当根据相关法律法规及中国证监会的规定,制定估值政策和程序,并定期对估值政策和程序进行检讨,以保证基金资产估值的准确性。

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	110023	民生转债	700,000	74,067,000.00	4.84
2	110118	国电转债	536,400	58,392,504.00	3.81
3	112190	11国电02	300,000	30,000,000.00	1.96
3	124616	13银科转债	300,000	30,000,000.00	1.96
4	122274	11银证02	300,000	30,000,000.00	1.96
4	124333	13银证转债	200,000	20,000,000.00	1.31
4	122267	13华泰转债	200,000	20,000,000.00	1.31
5	127001	海通转债	105,149	12,374,565.21	0.81

1.6 报告期内按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情况
注:本基金本报告期末持有资产支持证券。
1.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.8 报告期内本基金投资组合报告期内发生的所有重大关联交易情况
注:本基金本报告期未发生关联交易。
1.9 投资组合报告期末基金资产净值情况
注:本基金本报告期末投资组合净值情况。
1.10 报告期内本基金投资组合报告期内发生的所有重大关联交易情况
注:本基金本报告期未发生关联交易。
1.11 投资组合报告期末基金资产净值情况
注:本基金本报告期末投资组合净值情况。
1.12 报告期内本基金投资组合报告期内发生的所有重大关联交易情况
注:本基金本报告期未发生关联交易。
1.13 投资组合报告期末基金资产净值情况
注:本基金本报告期末投资组合净值情况。
1.14 报告期内本基金投资组合报告期内发生的所有重大关联交易情况
注:本基金本报告期未发生关联交易。
1.15 投资组合报告期末基金资产净值情况
注:本基金本报告期末投资组合净值情况。

九、基金的投资业绩比较基准
本基金的投资业绩比较基准为:中债综合指数。
中债综合指数是中国银行间债券市场最具代表性的债券指数,以2011年12月31日为基期,基点为100元,并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的编制方法符合行业惯例,具有良好的权威性和公信力,是债券市场公认的基准。本基金管理人认为,该指数能够有效反映债券市场的整体走势,适合作为本基金的投资业绩比较基准。本基金管理人认为,该指数能够有效反映债券市场的整体走势,适合作为本基金的投资业绩比较基准。本基金管理人认为,该指数能够有效反映债券市场的整体走势,适合作为本基金的投资业绩比较基准。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
2	指定类投资	312,761,106.75	20.30
2	其中:债券	312,761,106.75	20.30
3	金融资产投资	-	-
3	其中:基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	190,000,000.00	12.33
4	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,031,581,788.91	66.95
6	其他资产	6,433,524.62	0.42
7	合计	1,540,776,420.28	100.00

1.15 报告期内期末资产配置情况
注:本基金本报告期末资产配置情况。
1.16 报告期内期末资产配置情况
注:本基金本报告期末资产配置情况。
1.17 报告期内期末资产配置情况
注:本基金本报告期末资产配置情况。
1.18 报告期内期末资产配置情况
注:本基金本报告期末资产配置情况。
1.19 报告期内期末资产配置情况
注:本基金本报告期末资产配置情况。

(上续C18)

(D9) 中德证券有限责任公司

住所、办公地址:福州五四路157号新天地大厦7层
法定代表人:袁永豪
电话:0591-87383623
网址:www.zdq.com.cn

(D1) 光大证券股份有限公司
住所、办公地址:上海市静安区威海路150号
法定代表人:袁长
电话:021-22169999
网址:www.ebsc.com.cn

(D2) 安信证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街242号写字楼101室
办公地址:天津市开发区第四大街242号
法定代表人:王连平
电话:02212845186
网址:www.axxzq.com

(D3) 平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦37层A01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦37层A01单元
法定代表人:何如
电话:0755-82582555
网址:www.pinnac.com.cn

(D4) 东北证券股份有限公司
住所、办公地址:长春市自由大路1338号
法定代表人:刘维
电话:0431-85096709
网址:www.nesc.com.cn

(D5) 华泰证券股份有限公司
住所:南京市江东中路228号
办公地址:南京市江东中路228号
法定代表人:吴万善
电话:025-83331817
网址:www.htsec.com.cn

(D6) 方正证券股份有限公司
住所:吉林省长春净月开发区世纪大街1585号
办公地址:吉林省长春市净月开发区世纪大街1585号
法定代表人:孙宪志
电话:0431-85096709
网址:www.found.com.cn

(D7) 安信证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街242号写字楼101室
办公地址:天津市开发区第四大街242号
法定代表人:王连平
电话:02212845186
网址:www.axxzq.com

(D8) 太平洋证券股份有限公司
住所:昆明市东川区东川区
办公地址:昆明市东川区东川区
法定代表人:李永红
电话:0871-63113119
网址:www.tay.com.cn

(D9) 中德证券有限责任公司
住所、办公地址:福州五四路157号新天地大厦7层
法定代表人:袁永豪
电话:0591-87383623
网址:www.zdq.com.cn

(D10) 光大证券股份有限公司
住所、办公地址:上海市静安区威海路150号
法定代表人:袁长
电话:021-22169999
网址:www.ebsc.com.cn

(D11) 安信证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街242号写字楼101室
办公地址:天津市开发区第四大街242号
法定代表人:王连平
电话:02212845186
网址:www.axxzq.com

(D12) 东北证券股份有限公司
住所、办公地址:长春市自由大路1338号
法定代表人:刘维
电话:0431-85096709
网址:www.nesc.com.cn

(D13) 华泰证券股份有限公司
住所:南京市江东中路228号
办公地址:南京市江东中路228号
法定代表人:吴万善
电话:025-83331817
网址:www.htsec.com.cn

(D14) 方正证券股份有限公司
住所:吉林省长春净月开发区世纪大街1585号
办公地址:吉林省长春市净月开发区世纪大街1585号
法定代表人:孙宪志
电话:0431-85096709
网址:www.found.com.cn

(D15) 安信证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街242号写字楼101室
办公地址:天津市开发区第四大街242号
法定代表人:王连平
电话:02212845186
网址:www.axxzq.com

注:本基金本报告期末持有资产支持证券。
注:本基金本报告期末持有资产支持证券。
注:本基金本报告期末持有资产支持证券。
注:本基金本报告期末持有资产支持证券。
注:本基金本报告期末持有资产支持证券。

中欧纯债分级债券型证券投资基金之纯债A份额开放日常申购与赎回业务公告

公告送出日期:2014年1月27日

1.公告基本信息

基金名称	中欧纯债分级债券型证券投资基金
基金简称	中欧纯债分级债券
基金代码	166016

2.日常申购、赎回业务的办理时间
本基金自2014年1月31日起,中欧纯债分级债券型证券投资基金之纯债A份额,每日接受投资者的申购、赎回申请,具体办理时间为:每日上午9:30至下午3:00(法定节假日除外)。申购、赎回业务的具体办理时间为:每日上午9:30至下午3:00(法定节假日除外)。申购、赎回业务的具体办理时间为:每日上午9:30至下午3:00(法定节假日除外)。

3.申购赎回费率
本基金申购、赎回费率如下表所示:

申购费率	赎回费率
0.40%	0.40%

4.申购赎回限制
本基金申购、赎回限制如下表所示:

项目	限制
单笔申购最低金额	1.00元人民币
单笔赎回最低金额	1.00元人民币
连续赎回最低金额	1.00元人民币

5.其他重要事项
本基金申购、赎回其他重要事项如下:

- 本基金申购、赎回业务的具体办理时间为:每日上午9:30至下午3:00(法定节假日除外)。
- 本基金申购、赎回业务的具体办理时间为:每日上午9:30至下午3:00(法定节假日除外)。
- 本基金申购、赎回业务的具体办理时间为:每日上午9:30至下午3:00(法定节假日除外)。

股票代码:600732 股票简称:上海新梅 编号:临2014-04

上海新梅置业股份有限公司重大资产重组进展公告

公司董事会及全体董事保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
因正在筹划重大资产重组事项,本公司于2013年12月13日披露了《上海新梅置业股份有限公司重大资产重组停牌公告》,并于2014年1月13日披露了《上海新梅置业股份有限公司重大资产重组停牌公告》。

目前,公司及全体董事积极履行信息披露义务,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。公司将根据重组进展,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。

上海新梅置业股份有限公司
2014年1月27日

股票代码:600732 股票简称:上海新梅 编号:临2014-04

上海新梅置业股份有限公司

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

股票代码:000407 公告编号:2014-007号

山东胜利股份有限公司董事会关于筹划发行股份购买资产并募集配套资金的进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。山东胜利股份有限公司(以下简称“胜利”)于2014年1月20日披露了《山东胜利股份有限公司关于筹划发行股份购买资产并募集配套资金的进展公告》。

目前,公司及全体董事积极履行信息披露义务,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。公司将根据重组进展,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。

山东胜利股份有限公司董事会
二〇一四年一月二十七日

股票代码:000407 公告编号:2014-007号

山东胜利股份有限公司

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

股票代码:000600 证券简称:建投能源 公告编号:2014-6

河北建投能源投资股份有限公司关于发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易事宜获得中国证监会并购重组委审核通过的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。河北建投能源投资股份有限公司(以下简称“建投能源”)于2014年1月20日披露了《河北建投能源投资股份有限公司关于发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易事宜获得中国证监会并购重组委审核通过的公告》。

目前,公司及全体董事积极履行信息披露义务,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。公司将根据重组进展,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。

河北建投能源投资股份有限公司董事会
2014年1月27日

股票代码:000600 证券简称:建投能源 公告编号:2014-6

河北建投能源投资股份有限公司

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。
注:本基金本报告期末持有股票。

证券代码:002291 证券简称:星期六 公告编号:2014-001

佛山星期六鞋业股份有限公司关于控股股东股权质押的公告

佛山星期六鞋业股份有限公司(以下简称“星期六”)于2014年1月20日披露了《佛山星期六鞋业股份有限公司关于控股股东股权质押的公告》。

目前,公司及全体董事积极履行信息披露义务,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。公司将根据重组进展,及时披露重组进展,积极配合中介机构开展工作,保证公平信息披露。根据重组进展,经各方协商一致,决定暂停重组事项,并恢复公司股票交易。

佛山星期六鞋业股份有限公司董事会
二〇一四年一月二十四日

证券代码:002291 证券简称:星期六 公告编号:2014-001

佛山星期六鞋业股份有限公司