

**基金管理人:诺德基金管理有限公司**  
**基金托管人:中国建设银行股份有限公司**  
报告送出日期:二〇一四年八月二十六日

**1.1 重要提示**  
诺德基金管理有限公司(以下简称“诺德基金”)董事会及高级管理人员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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期末财务资料未经审计。  
本报告自2014年1月1日起至6月30日止。

**1.2 基金简介**

**2.1 基金基本情况**

基金简称	诺德增强收益债券
基金代码	573003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月4日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	111,922,438.71份
基金合同存续期	不定期

**2.2 基金产品说明**

**投资目标**  
本基金为主动式管理的债券型基金,主要通过投资于各类债券品种,在获得稳定的息票收益的基础上,争取获得资本利得收益,为基金份额持有人获得较好的全面投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。

**投资策略**  
本基金将通过研究分析国内外宏观经济形势、货币政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期,并在此基础上,通过对各种债券品种进行前瞻性分析,综合考虑流动性、溢价性、信用风险和利率变化敏感性等因素,主动调整和优化投资组合,在获得稳定的息票收益的基础上,争取获得资本利得收益,同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性,从而达到控制投资风险、长期稳健地获得债券投资的目标。

**业绩比较基准**  
中国债券总回报(加权)收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%

**风险收益特征**  
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币型基金,低于混合型基金和股票型基金。

**2.3 基金管理人及基金托管人**

项目	基金管理人	基金托管人
名称	诺德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	张欣	田晋
联系电话	021-68879999	400-67595096
电子邮箱	alan.chang@nordfund.com	tsiangjia@ccb.com
客户服务电话	400-888-0000	400-67595096
传真	021-68877272	010-66275853

**2.4 信息披露方式**

诺德基金半年度报告摘要的管理人互联网网址: www.nordfund.com  
基金半年度报告备置地点: 基金管理人及基金托管人住所

**3 主要财务指标和基金净值表现**

**3.1 主要会计数据和财务指标**

项目	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	
本期已实现收益	698,755.97	
本期公允价值变动收益	4,190,072.22	
本期公允价值变动损益	603.65	
本期公允价值变动损益率	3.71%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配基金份额总额	0.0345	
期末基金资产净值	115,789,172.02	
期末基金份额净值	1.035	

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不当期发生数),表中“期末”均指报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。  
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

**3.2 基金净值表现**

**3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.17%	0.17%	0.33%	0.11%	0.84%	0.06%
过去三个月	2.27%	0.14%	2.45%	0.13%	-0.18%	0.01%
过去六个月	3.71%	0.12%	3.12%	0.14%	0.59%	-0.02%
过去一年	2.68%	0.11%	-1.56%	0.16%	4.24%	-0.05%
过去三年	0.49%	0.18%	-1.94%	0.16%	2.43%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.25%	0.26%	-0.95%	0.17%	7.20%	0.09%

注:业绩比较基准=中国债券总回报(加权)收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%。  
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
诺德增强收益债券型证券投资基金  
自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2009年3月4日至2014年6月30日)

注:“诺德增强收益债券型证券投资基金”成立于2009年3月4日,图示时间段为2009年3月4日至2014年6月30日。  
本基金建仓期自2009年3月4日至2009年9月3日,报告期末资产配置比例符合本基金合同规定。

**4 管理人报告**

**4.1 基金管理人及基金经理情况**

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验  
诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2008]98号文批准设立,公司股东方诺德、安博特资产管理公司(Lord Abbett & Co., LLC)、长江证券资产管理有限公司、清华控股有限公司,注册地为上海,注册资本为1亿元人民币,截至本报告期末,公司管理了九只开放式基金:诺德价值优势股票型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势股票型证券投资基金、诺德中小盘股票型证券投资基金、诺德沪深300股票型证券投资基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金、诺德周期策略股票型证券投资基金、诺德深证300指数分级证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
赵蔚洁	本基金基金经理、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2010-06-23	7	上海交通大学金融学硕士,2006年11月至2008年10月,任职于平安资产管理(上海)有限公司;2008年10月加入诺德基金管理有限公司,担任债券交易员、固定收益研究员等职务,期间先后具有债券研究员、基金经理助理等职务。

注:任职日期是指本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的任职日期;证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求利益,没有损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况  
本公司已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。此外,本基金管理人还建立了公平交易制度,确保不同基金在买入同一证券时,按照比例分配的原则在各基金账户中公平分配交易量;公司交易系统使用公平交易模块,一旦出现不同基金买入同一证券时,系统自动按比例公平交易;报告期内,公平交易机制总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《诺德基金管理有限公司公平交易管理制度》,明确公司对投资组合的申购与赎回交易和场内交易行为进行监控,并对发现的异常交易行为进行报告。该办法规范异常交易的类型、判定标准、监控方法与识别报告,对异常交易的报告内容等进行了详细规定。报告期内,本基金未有与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量0.5%的情况,也未发现存在不公平交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析  
2014年上半年债券市场在投资全面和宏观进一步下行风险较大的预期下大幅上涨,随着经济下行的数据确认,定向降准、正回购缩量等货币政策措施进一步验证和巩固了宽松预期,同时通胀也保持在较低水平,各类品种涨幅大幅走高。  
一方面基金管理人采用了积极的资产配置策略,利用债市上行机会积极对组合的债券仓位及结构进行了调整,本基金重点配置了信用债,以规避久期高风险品种为主;一方面面对组合中债券仓位进行及时的跟踪和调仓,表现出市场相对较强的优势,以此来增强组合收益的确定性和安全性。另外,使用低成本的转债市场股票资产适度参与,以获取波段收益。报告期内本基金权益业绩比较基准主要是因为低配了股票资产,另外个股选择方面也有待改进。  
4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.035元,累计净值为1.062元,本报告期份额净值增长率为3.71%,同期业绩比较基准收益率为3.12%。  
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望2014年下半年,三季度在“微刺激”政策的作用下,叠加外需的正面贡献,经济短期下行的势头有望趋缓,债市面对的政策基本面和宽松的货币政策可能有不利的变化,4季度需观察政策及经济长期回落的持续性,但中长期来看,经济增速中枢下降,通胀低位运行可能使得债券市场仍具有较大投资价值。  
4.6 管理人对报告期内本基金估值程序等事项的说明  
为了确保基金估值准确,基金管理人制定并修订了《诺德基金管理有限公司证券投资基金估值制度》(以下简称“估值制度”)。  
根据估值制度,基金管理人设立了专门的估值委员会,估值委员会由公司投资研究部总监、运营总监、清算登记部副经理、基金会计和基金估值专员组成,所有相关估值委员会成员均具备相应的专业胜任能力和长期工作经历,估值委员会主要负责制定基金资产的估值政策和程序,定期评价现有估值政策和程序的适用性以及保证估值政策和程序的一致性。其中:  
基金会计主管负责确定新的估值政策、方法和程序,提供相关的会计数据,并具体负责和会计事务部及基金托管人沟通、验证及参数进行沟通,以支持委员会的估值;运营部负责估值委员会会议有效执行及实施;投资研究部负责提供估值委员会所需的估值数据,并在符合相关法律法规和信息披露的基础上,对具体投资品种所处的经济环境和重大事件进行判断;  
法务与合规部负责提供估值委员会的合法合规意见,以及负责信息披露工作。  
根据估值制度,估值委员会成员中不包括基金经理,本报告期内,上述参与流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明  
报告期内,本基金未实施利润分配。

**5 托管人报告**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明  
报告期内,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 管理人对报告期内基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明  
本报告期,本托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关基金资产净值持有人的行为。  
报告期内,本基金未实施利润分配。  
5.3 托管人对本半年度报告中涉及基金净值信息内容的真实、准确和完整发表意见  
本报告期,本托管人认真复核了本报告涉及基金净值信息内容的真实、准确和完整分配情况,财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
**6 半年度财务会计报告(未经审计)**

**6.1 资产负债表**

资产	附注号	期末数 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
流动资产:			
银行存款	6.4.7.1	7,119,346.91	4,970,677.79
结算备付金		303,550.04	68,492.22
存出保证金		16,290.76	15,111.11
交易性金融资产	6.4.7.2	108,370,848.28	94,673,455.42
其中:股票投资		6,149,133.12	-
基金投资		102,221,715.16	94,673,455.42
债券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	12,500,000.00
应收证券清算款	6.4.7.5	5,177,859.78	3,152,389.15
应收利息	6.4.7.5	1,257,335.41	2,280,311.94
应收股利		-	-
应收申购款		23,999.53	8,582.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		122,769,230.71	118,288,189.25
负债和所有者权益			
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		799,998.60	-
应付证券清算款		5,301,559.07	-
应付赎回款		10,466.83	9,452.24
应付管理人报酬		71,147.37	74,818.92
应付托管费		18,972.66	19,951.74
应付销售服务费		37,945.25	39,903.40
应付交易费用	6.4.7.7	13,016.03	22,050.41
应付税费		558,158.84	558,158.84
应付利息		192.54	-
应付股利		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	168,601.50	340,000.75
负债合计		6,980,058.69	1,066,336.30
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	111,922,438.71	117,468,765.68
未分配利润	6.4.7.10	3,866,733.31	-24,912.73
所有者权益合计		115,789,172.02	117,223,852.95
负债和所有者权益总计		122,769,230.71	118,288,189.25

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.035元,基金份额总额111,922,438.71份。

**6.2 利润表**

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		5,234,147.60	2,080,918.21
1.利息收入		2,219,437.94	2,912,087.13
其中:存款利息收入		32,824.07	38,616.56
债券利息收入		2,071,173.33	2,751,930.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		115,440.54	121,539.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-566,367.37	-864,209.41
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-19,633.54	-
基金投资收益		-569,820.93	-864,209.41
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	6.4.7.15	22,791.10	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	6.4.7.16	3,381,316.25	32,985.79
4.汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	6.4.7.17	56.78	54.70
二、费用		1,044,075.37	1,090,789.37
1.管理人报酬		482,381.11	483,379.54
2.托管费		115,301.64	123,434.51
3.销售服务费		230,632.64	258,869.11
4.交易费用	6.4.7.18	30,662.75	1,684.90
5.利息支出		46,704.76	27,942.31
其中:卖出回购金融资产支出		46,704.76	27,942.31
6.其他费用	6.4.7.19	188,221.78	187,470.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		4,190,072.22	990,128.84
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		4,190,072.22	990,128.84

**6.3 所有者权益(基金净值)变动表**  
会计主体:诺德增强收益债券型证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	117,468,765.68	-24,912.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,190,072.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(申购减少以“-”号填列)	-5,546,326.97	-78,426.18
其中:1.基金申购款	428,011.01	5,328.99
2.基金赎回款	-5,974,338.98	-83,755.17
四、本期基金应支付和应付未支付的基金净值变动数(赎回减少以“-”号填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	111,922,438.71	3,866,733.31

**6.4 报表附注**

6.4.1 基金基本情况  
诺德增强收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2008]98号《关于核准诺德增强收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由诺德基金管理有限公司(以下简称“诺德基金”)和中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)共同发起募集,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,184,234,685.11元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(以下简称“普华永道”)出具验资报告予以验证,经中国证监会备案,《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》于2009年3月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,184,890,833.63份基金份额,其中认购资金利息折合56,148,529份基金份额,本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。  
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行及交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券和债券回购等固定收益类证券,以及法律法规允许投资的其他金融品种,本基金的投资组合比例为:债券资产占基金资产净值的比例不低于80%-95%,本基金持有的非流动性资产占基金资产净值的0%-20%,本基金的投资组合以及到期日在一年以内的政府债券(包括央行票据)占基金资产净值的比例不低于基金资产净值的5%,本基金的业绩比较基准为:90%中国债券总回报(加权)收益率+10%沪深300指数收益率。  
6.4.2 基金报告的编制基础  
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则(基本准则)》和38项具体会计准则、应用指南和解释等规定进行编制,企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的会计处理方法和会计政策。  
6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定声明  
本基金2014年1月1日至2014年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,完整地反映了本基金2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。  
6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的声明  
本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。  
6.4.5 会计政策变更的说明  
6.4.5.1 会计政策变更的说明  
本报告期内本基金未发生会计政策变更事项。  
6.4.5.2 会计估计变更的说明  
本报告期内本基金未发生会计估计变更事项。  
6.4.6 差错更正的说明  
本报告期内本基金未发生会计差错更正事项。  
6.4.6.1 差错更正  
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2008]9号)《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规规定,本报告期列示如下:  
(1)对于以多种方式筹集资金不属于应税收入,不征收营业税、基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税;  
(2)对基金从证券市场取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息收入、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税;  
(3)对基金取得的股息红利收入,应由发行债券的企业在派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额,对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。  
6.4.7 关联方关系  
(1)关联方关系  
6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况  
本报告期内,未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。  
6.4.7.2 本报告期与关联方发生关联交易的相关方

**6.4.8 关联方关系**

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
中国建设银行	7,119,346.91	26,099.11
诺德基金管理有限公司	26,099.11	7,955,386.29
合计	7,145,446.02	7,981,485.40

注:支付基金份额持有人赎回服务费前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:  
赎回服务费=前一日基金资产净值×0.4%÷当年天数。  
6.4.8.1 赎回服务费  
6.4.8.2 基金托管费  
注:支付基金份额持有人赎回服务费前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:  
托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。  
6.4.8.3 销售服务费  
注:支付基金份额持有人的销售服务费前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给诺德基金管理有限公司,再由诺德基金管理有限公司一并支付给各基金销售机构,其计算公式为:  
销售服务费=前一日基金资产净值×0.4%÷当年天数。  
6.4.8.4 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
6.4.8.5 关联方承销的证券  
6.4.8.6 关联方承销的证券  
6.4.8.7 关联方承销的证券  
6.4.8.8 关联方承销的证券  
6.4.8.9 关联方承销的证券  
6.4.8.10 关联方承销的证券  
6.4.8.11 关联方承销的证券  
6.4.8.12 关联方承销的证券  
6.4.8.13 关联方承销的证券  
6.4.8.14 关联方承销的证券  
6.4.8.15 关联方承销的证券  
6.4.8.16 关联方承销的证券  
6.4.8.17 关联方承销的证券  
6.4.8.18 关联方承销的证券  
6.4.8.19 关联方承销的证券  
6.4.8.20 关联方承销的证券  
6.4.8.21 关联方承销的证券  
6.4.8.22 关联方承销的证券  
6.4.8.23 关联方承销的证券  
6.4.8.24 关联方承销的证券  
6.4.8.25 关联方承销的证券  
6.4.8.26 关联方承销的证券  
6.4.8.27 关联方承销的证券  
6.4.8.28 关联方承销的证券  
6.4.8.29 关联方承销的证券  
6.4.8.30 关联方承销的证券  
6.4.8.31 关联方承销的证券  
6.4.8.32 关联方承销的证券  
6.4.8.33 关联方承销的证券  
6.4.8.34 关联方承销的证券  
6.4.8.35 关联方承销的证券  
6.4.8.36 关联方承销的证券  
6.4.8.37 关联方承销的证券  
6.4.8.38 关联方承销的证券  
6.4.8.39 关联方承销的证券  
6.4.8.40 关联方承销的证券  
6.4.8.41 关联方承销的证券  
6.4.8.42 关联方承销的证券  
6.4.8.43 关联方承销的证券  
6.4.8.44 关联方承销的证券  
6.4.8.45 关联方承销的证券  
6.4.8.46 关联方承销的证券  
6.4.8.47 关联方承销的证券  
6.4.8.48 关联方承销的证券  
6.4.8.49 关联方承销的证券  
6.4.8.50 关联方承销的证券  
6.4.8.51 关联方承销的证券  
6.4.8.52 关联方承销的证券  
6.4.8.53 关联方承销的证券  
6.4.8.54 关联方承销的证券  
6.4.8.55 关联方承销的证券  
6.4.8.56 关联方承销的证券  
6.4.8.57 关联方承销的证券  
6.4.8.58 关联方承销的证券  
6.4.8.59 关联方承销的证券  
6.4.8.60 关联方承销的证券  
6.4.8.61 关联方承销的证券  
6.4.8.62 关联方承销的证券  
6.4.8.63 关联方承销的证券  
6.4.8.64 关联方承销的证券  
6.4.8.65 关联方承销的证券  
6.4.8.66 关联方承销的证券  
6.4.8.67 关联方承销的证券  
6.4.8.68 关联方承销的证券  
6.4.8.69 关联方承销的证券  
6.4.8.70 关联方承销的证券  
6.4.8.71 关联方承销的证券  
6.4.8.72 关联方承销的证券  
6.4.8.73 关联方承销的证券  
6.4.8.74 关联方承销的证券  
6.4.8.75 关联方承销的证券  
6.4.8.76 关联方承销的证券  
6.4.8.77 关联方承销的证券  
6.4.8.78 关联方承销的证券  
6.4.8.79 关联方承销的证券  
6.4.8.80 关联方承销的证券  
6.4.8.81 关联方承销的证券  
6.4.8.82 关联方承销的证券  
6.4.8.83 关联方承销的证券  
6.4.8.84 关联方承销的证券  
6.4.8.85 关联方承销的证券  
6.4.8.86 关联方承销的证券  
6.4.8.87 关联方承销的证券  
6.4.8.88 关联方承销的证券  
6.4.8.89 关联方承销的证券  
6.4.8.90 关联方承销的证券  
6.4.8.91 关联方承销的证券  
6.4.8.92 关联方承销的证券  
6.4.8.93 关联方承销的证券  
6.4.8.94 关联方承销的证券  
6.4.8.95 关联方承销的证券  
6.4.8.96 关联方承销的证券  
6.4.8.97 关联方承销的证券  
6.4.8.98 关联方承销的证券  
6.4.8.99 关联方承销的证券  
6.4.8.100 关联方承销的证券

**6.4.9 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	占基金资产净值比例(%)
1	002033	丽江旅游	379,824	4,892,133.12	4.23
2	000992	平潭发展	150,000	1,257,335.41	1.09

**7.1 期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,149,133.12	5.01
2	其中:股票	6,149,133.12	5.01
3	固定收益投资	102,221,715.16	83.26
4	其中:债券	102,221,715.16	83.26
5	资产支持证券		