

天弘永定价值成长股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21日复核了本报告中的财务指标、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。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者的投资存在本金损失的风险,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。

本报告自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	天弘永定价值成长股票
基金代码	420005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月17日
报告期末基金份额总额	169,413,519.24份
投资目标	在严格控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金为主动管理的股票型基金,主要投资于国内A股市场成长性较好、估值水平具有较好性价比且符合行业景气度向上、业绩确定性较强的上市公司股票,同时适当配置可转债、货币资产等固定收益类资产,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为主动管理的股票型基金,属于中高风险,收益较高的证券投资基金品种。本基金的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

1.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	7,927,494.44
2.本期利润	17,365,328.39
3.本期公允价值变动损益	188,793,649.97
4.本期基金份额净值增长率	1.114%
5.期末基金份额净值	1.114%

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、所述基金业绩指标不包括持有认购或交易基金的的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

1.4 基金净值表现

1.4.1 本基金报告期内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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	
过去三个月	18.64%	0.87%	10.72%	7.92%	0.15%

1.4.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1.5 投资组合报告

1.5.1 基金投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	134,836,068.90	66.85
2	其中:股票	134,836,068.90	66.85
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和拆入资金	66,296,267.30	30.79
10	其他各项资产	710,457.27	0.36
11	合计	195,842,893.92	100.00

1.5.2 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	47,936,671.25	25.30
B	医药生物	586,179.29	0.28
C	制造业	26,264,153.08	13.90
D	电力、热力、燃气及水利生产和供应业	28,978,203.99	15.53
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息、计算机和通信业	844,461.66	0.43
H	批发和零售业	-	-
I	住宿和餐饮业	21,400.80	0.01
J	金融业	14,647,384.00	7.44
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	教育、文体、娱乐和休闲业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	164,543,792.71	88.7
T	合计	134,836,068.90	71.42

1.5.3 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	002267	联天燃气	1,497,626	16,968,215.88	8.91
2	000669	阳光电源	1,548,917	16,743,792.77	8.87
3	600595	矿业股份	586,179	12,009,986.11	6.28
4	002251	鑫科钛业	1,146,234	6,080,010.88	4.81
5	002157	正邦科技	341,307	3,665,547.61	4.56
6	002477	瀚蓝环保	788,438	3,959,974.20	4.53
7	002299	圣农发展	565,258	3,297,987.44	4.40
8	002234	*ST亿阳	790,266	3,123,934.48	4.30
9	002714	联创股份	145,415	2,993,462.35	4.23
10	002528	思源股份	438,010	3,871,503.00	3.09

1.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

1.5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

1.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

1.5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

1.5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

1.5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

1.5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

1.5.11 投资组合报告附注

1.5.11.1 本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

1.5.11.2 本基金投资的前十名证券,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

1.5.11.3 其他资产构成

1.6 开放式基金份额变动

序号	项目	金额
1	存在期初余额	190,982,941
2	应收证券申购款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	30,535.81
5	应收申购款	488,079.87
6	赎回费	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	710,457.27

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。

4.16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	期末持仓金额(元)
1	002477	瀚蓝环保	4,590,974.20	4.48	基金管理人
2	600548	蓝光股份	5,877,503.00	3.09	基金管理人

注:1、上述日期为基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行运作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权和审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合之间不存在不公平交易和利益输送;建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场内、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的严格执行情况良好。