

信息披露

（上接B22版）
 的变动对同行业的影响,得出行业间的相对投资价值与投资时机,据此挑选出具有良好行业和股票潜力的行业。
 ④ 个股选择
 本基金综合运用战略股票研究分析方法和其它投资分析工具,挑选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资。具体分以下三个层次进行:
 (1) 行业筛选
 选择在行业治理、财务状况及管理层面符合本基金基本面要求的上市公司,构建备选股票池,主要指标包括盈利能力(如PE、P/B、Flow、FCFF、P/FCF、P/BVMT等)经营效率(如 ROE、ROA、Return on operating assets等)财务状况(如 D/A、流动比率等)等。
 (2) 公司质地评价
 通过对上市公司直接和实地调研,了解并评估公司治理结构、公司治理、所处行业的竞争动力、公司的财务特点,以决策是否为一只值得投资的公司的合理估值水平,同时从整体上分析所拟投资公司的成长性、盈利能力和可持续性、盈利质量、管理层素质、商业模式、核心竞争力及投资回报的性价比等。同时,本基金定期对拟投资股票进行估值模型选择、筛选、剔除,通过股东回报最大化大量择标标准给每个目标公司进行打分。
 (3) 多元化资产配置
 本基金在充分研究的基础上,根据上市公司所处的不同行业特点综合运用多元化的股票估值指标,对投资组合进行合理估值,并定期投资组合,在确保组合估值合理的基础上选择价值被低估的投资标的。
 2. 权益投资策略
 本基金权益投资以价值投资理念作为核心,通过深入分析个股投资价值寻求其合理估值水平,以动态的方式进行管理为手段,分散投资于成长性、流动性及风险特征较好的股票,通过资产配置、择时与择股,追求基金资产的长期增值。
 3. 固定收益投资策略
 本基金固定收益投资遵循投资组合分散化原则,追求低风险投资目标。本基金以套期保值为目的,根据风险管理原则在可控的风险下,适度参与可转债投资,通过资产配置、择时与择股,追求基金资产的长期增值。
 4. 衍生品投资策略
 本基金通过宏观经济和资本市场走势的分析判断,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种选择,进行择时选择,选择流动性好、对冲风险能力强、保证金管理严格、流动性管理简单等。
 本基金在运用股指期货控制风险的基础上,将择时择股取得的超额收益,通过股指期货的多头、替代和避险策略,在合理范围内进行对冲操作,并通过对股指期货的套利操作,提高股指期货组合的收益率。
 5. 基金资产估值
 本基金估值采用《证券投资基金估值业务指导意见》确定的估值方法和估值程序,采用公允价值进行估值,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生重大变化,或证券发行机构调整估值输入数据,本基金将对估值方法进行适当调整,以确保基金资产的准确估值。
 6. 基金费用与税收
 本基金按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规的要求,披露基金费用与税收信息。
 7. 基金收益分配
 本基金收益分配遵循《证券投资基金收益分配指引》及相关法律法规的要求,在符合法律法规的前提下,本基金将按照基金合同约定进行收益分配。
 8. 基金风险管理
 本基金通过资产配置、品种选择、择时择股等方式,分散投资风险,确保基金资产的长期增值。
 9. 基金流动性管理
 本基金通过资产配置、品种选择、择时择股等方式,分散投资风险,确保基金资产的长期增值。
 10. 基金信息披露
 本基金按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规的要求,披露基金费用与税收信息。

基金投资组合

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	140407	14广佛债	500,000	50,825,000.00	14.79
2	140424	14广佛债	500,000	50,770,000.00	14.77
3	130434	13广佛债	200,000	20,616,000.00	6.00
4	110411	11广佛债	200,000	20,402,000.00	5.82
5	110418	11广佛债	200,000	19,988,000.00	5.82

基金投资组合

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	002008	大族激光	800,000	15,640,000.00	4.55
2	000001	平安银行	6,142,500.00	1,729,000.00	0.50
3	600084	长春高新	479,000	5,988,900.00	1.74
4	002665	百润生物	120,000	5,283,600.00	1.54
5	600094	铂力特	300,000	5,046,000.00	1.47
6	300137	华邦制药	329,000	4,970,617.57	1.45
7	000927	一汽夏利	999,200	4,846,158.80	1.41
8	300027	银信通达	120,000	3,951,600.00	1.15
9	601899	中国重工	600,000	3,936,000.00	1.15
10	300074	华平股份	186,113	3,463,562.93	1.01

基金投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	113,575,676.46	32.47
	其中:股票	113,575,676.46	32.47
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
	其中:债券	194,426,100.00	55.58
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	36,436,102.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,300.49	100.00

基金投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	3,406,000.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,630,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,275,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,153,100.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	4,004,291.00	1.17
S	综合	-	-
合计	-	113,575,676.46	33.05

基金投资组合

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	002008	大族激光	800,000	15,640,000.00	4.55
2	000001	平安银行	6,142,500.00	1,729,000.00	0.50
3	600084	长春高新	479,000	5,988,900.00	1.74
4	002665	百润生物	120,000	5,283,600.00	1.54
5	600094	铂力特	300,000	5,046,000.00	1.47
6	300137	华邦制药	329,000	4,970,617.57	1.45
7	000927	一汽夏利	999,200	4,846,158.80	1.41
8	300027	银信通达	120,000	3,951,600.00	1.15
9	601899	中国重工	600,000	3,936,000.00	1.15
10	300074	华平股份	186,113	3,463,562.93	1.01

基金投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	113,575,676.46	32.47
	其中:股票	113,575,676.46	32.47
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
	其中:债券	194,426,100.00	55.58
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	36,436,102.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,300.49	100.00

基金投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	3,406,000.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,630,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,275,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,153,100.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	4,004,291.00	1.17
S	综合	-	-
合计	-	113,575,676.46	33.05

基金投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	113,575,676.46	32.47
	其中:股票	113,575,676.46	32.47
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
	其中:债券	194,426,100.00	55.58
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	36,436,102.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,300.49	100.00

基金投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	3,406,000.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,630,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,275,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,153,100.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	4,004,291.00	1.17
S	综合	-	-
合计	-	113,575,676.46	33.05

基金投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	113,575,676.46	32.47
	其中:股票	113,575,676.46	32.47
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
	其中:债券	194,426,100.00	55.58
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	36,436,102.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,300.49	100.00

基金投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	3,406,000.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,630,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,275,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,153,100.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	4,004,291.00	1.17
S	综合	-	-
合计	-	113,575,676.46	33.05

基金投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	113,575,676.46	32.47
	其中:股票	113,575,676.46	32.47
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
	其中:债券	194,426,100.00	55.58
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	36,436,102.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,300.49	100.00

基金投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	3,406,000.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,630,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,275,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,153,100.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	4,004,291.00	1.17
S	综合	-	-
合计	-	113,575,676.46	33.05

基金投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	113,575,676.46	32.47
	其中:股票	113,575,676.46	32.47
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
	其中:债券	194,426,100.00	55.58
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	36,436,102.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,300.49	100.00

基金投资组合

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	-	-