



# Disclosure 信息披露

2015年4月30日 星期五  
zqsb@stcn.com (0755)83501570

# B251

## (上接B250版)

2. 赎回调整:申购赎回  
申购赎回:赎回原因是开放式基金的基本特征,当申购量较大时就必然要求基金经理被动买入;当赎回量较大时基金经理就必须卖出。申购赎回调整是投资组合调整的重要组成部分,根据本基金对流动性与现金管理的规定,当必须进行调整时,将采取以下流程:

如申购,如果申购赎回额加原有现金储备仍在预设的现金缓冲区间内,则债券投资组合不作调整,否则需调整投资组合进行调整。  
7. 风险管理及绩效评价  
风险管理:通过建立一系列完整性的风险预警、风险识别及风险控制体系,运用数量化和系统化的方法来识别、测量、监督和控制风险。  
绩效评价:通过业绩表现分析、归因分析、绩效检讨报告,对基金投资进行总结,协助基金经理提高投资业绩。

**十一、基金的投资限制**  
本基金的投资组合将遵循以下限制:  
1. 本基金等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中可转换债券(含可分离交易可转债债券)的投资比例不高于固定收益类资产的80%;本基金所指固定收益类资产包括国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、可转换债券(含可分离交易可转债债券)、中小企业私募债、债券回购、短期融资券、次级债、银行存单、资产支持证券等金融工具。以上法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具;  
2. 股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%;  
3. 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;  
4. 本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有同一上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;  
5. 进入全国银行间同业拆借市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%。债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;  
6. 本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;  
7. 保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;  
8. 本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例,遵从法律法规或监管部门的相关规定;  
9. 本基金持有的同一同一信用级别资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;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,不得超过本基金资产净值的10%;基金管理人管理的本基金投资资产支持证券的比例不得超过本基金资产净值的10%;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,不得超过其各类资产支持证券占该规模的10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过本基金资产净值的20%;  
10. 本基金投资的所有资产支持证券信用评级为BBB级以上(含BBB,或相当于BBB级,在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个月内予以全部卖出);  
11. 本基金持有的全部中小企业私募债券,其市值不得超过固定收益类基金资产的20%;本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;  
12. 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;  
13. 法律法规及监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。  
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等非基金管理人可控的因素致使基金的投资组合不符合上述比例规定的,基金管理人应在10个工作日内进行内部调整,使基金的投资组合符合上述规定,但中国证监会另有规定的除外。  
**十二、基金的业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准:  
中证综合债券指数收益率\*70%+中证综合债指数收益率\*20%+上证红利指数\*10%。  
中证综合债券指数:中证综合债券指数由中证指数有限公司编制,反映境内债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券行情,该指数选择在沪深两市上市的股票且质量高、分红较稳定,具有一定期限及流动性的50只股票作为样本,能够反映沪深两市市场状况和走势,该指数于2004年12月28日正式发布。  
上证红利指数:上证红利指数由上海证券交易所编制,由中证指数有限公司开发的上证红利市场指数,该指数挑选在上海证券交易所上市、分红较稳定,具有一定期限及流动性的50只股票作为样本,能够反映上海证券市场状况和走势,该指数于2004年12月28日正式发布。  
本基金业绩比较基准综合考虑了指数编制方法、成分股、权重、跟踪误差、跟踪偏离度及指数与本基金投资范围、投资管理理念等因素,本基金认为,以上业绩比较基准目前能够更合理地体现本基金的风险收益特征。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准,或者指数编制机构停止编制该基准,或更具权威、更科学的复合指数权重比例,在与基金托管人协商一致后,本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并公告,而无须召开基金份额持有人大会。  
**十三、基金的风险收益特征**  
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中低风险、中低预期收益品种,其预期风险和预期收益水平

低于股票型、混合型基金,高于货币市场基金。  
**十四、基金投资组合报告**  
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。  
基金管理人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定,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、误导性陈述或者重大遗漏。  
本投资组合报告所载数据截至2014年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。  
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	10,727,800.00	0.93
	其中:股票	10,727,800.00	0.93
2	固定收益投资	104,760,292.35	9.06
	其中:国债	104,760,292.35	9.06
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	150,000,345.00	12.97
	其中:买入返售国债的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	572,975,086.56	49.54
6	其他资产	118,218,804.34	10.31
7	合计	1,156,082,328.25	27.50

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
B	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
C	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
D	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
E	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
F	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
G	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
H	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	000240	华谊集团	700,000	6,996,000.00	0.60
2	000122	江苏国泰	260,000	2,125,000.00	0.29
3	600963	岳阳兴化	30,000	1,125,000.00	0.10
4	300274	光力科技	30,000	484,800.00	0.07

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	国家债券	7,008,748.00	0.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	-	-
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转换债券	97,750,521.35	13.40
8	其他	-	-
9	合计	104,760,292.35	14.36

1. 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)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
7	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
8	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

2. 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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	国家债券	700,203,160.00	5.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,000,000.00	0.07
4	企业债券	10,000,000.00	0.07
5	中期票据	12,316,441,365.10	90.60
6	短期融资券	635,107,000.00	4.67
7	可转换债券	4,803,513,000.00	35.33
8	其他	13,727,000.00	0.10
9	合计	18,481,102,525.10	135.92

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五名债券投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	12484	130转债	2,800,000	277,564,000.00	2.04
2	124179	137转债	2,700,000	274,833,000.00	2.02
3	128266	129转债	1,400,000	246,744,000.00	1.81
4	122786	118转债	2,200,000	214,364,537.50	1.58
5	091944	140转债14	2,100,000	210,000,000.00	1.54

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贵金属投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
7	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
8	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

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股指期货投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
7	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
8	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

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五名权证投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	000240	华谊集团	700,000	6,996,000.00	0.60
2	000122	江苏国泰	260,000	2,125,000.00	0.29
3	600963	岳阳兴化	30,000	1,125,000.00	0.10
4	300274	光力科技	30,000	484,800.00	0.07

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
7	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
8	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	000240	华谊集团	700,000	6,996,000.00	0.60
2	000122	江苏国泰	260,000	2,125,000.00	0.29
3	600963	岳阳兴化	30,000	1,125,000.00	0.10
4	300274	光力科技	30,000	484,800.00	0.07

9. 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	000240	华谊集团	700,000	6,996,000.00	0.60
2	000122	江苏国泰	260,000	2,125,000.00	0.29
3	600963	岳阳兴化	30,000	1,125,000.00	0.10
4	300274	光力科技	30,000	484,800.00	0.07

10. 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	000240	华谊集团	700,000	6,996,000.00	0.60
2	000122	江苏国泰	260,000	2,125,000.00	0.29
3	600963	岳阳兴化	30,000	1,125,000.00	0.10
4	300274	光力科技	30,000	484,800.00	0.07

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	144,310.00	20,197,627.60	2.47
2	110023	民生银行	97,000	17,500,740.00	2.20
3	110027	东方证券	80,000	13,496,800.00	1.88
4	110023	民生银行	75,000	10,370,250.00	1.42
5	110022	工商银行	64,000	9,548,160.00	1.31

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  
本基金本报告期末未有资产支持证券。  
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权证投资明细  
本基金本报告期末未有权证。  
8. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1) 本期股指期货投资情况  
根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。  
2) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未有股指期货合约。  
9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
1) 本期国债期货投资情况  
根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。  
2. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未有国债期货合约。  
3. 报告期末本基金投资的国债期货合约估值情况  
1) 报告期末本基金投资的国债期货合约估值情况  
本基金本报告期末未有国债期货合约。  
2) 报告期末与国债期货合约估值情况  
本基金本报告期末未有国债期货合约。  
3. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
7	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
8	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
7	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
8	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

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)	占基金总资产比例(%)	
1	600240	华谊集团	700,000	6,996,000.00	0.96	董事局增持
2	000122	江苏国泰	260,000	2,125,000.00	0.29	
3	600963	岳阳兴化	30,000	1,125,000.00	0.10	
4	300274	光力科技	30,000	484,800.00	0.07	

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)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012	每日优鲜	4,756,593.70	0.65	
7	120006	长春经开	2,632,338.67	0.36	
8	120005	兴业银行	1,297.50	0.00	

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)	占基金总资产比例(%)	
1	000240	华谊集团	700,000	6,996,000.00	0.96	董事局增持
2	000122	江苏国泰	260,000	2,125,000.00	0.29	
3	600963	岳阳兴化	30,000	1,125,000.00	0.10	
4	300274	光力科技	30,000	484,800.00	0.07	

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)	占基金总资产比例(%)
1	119005	华泰证券	17,500,740.00	2.40	
2	110023	民生银行	10,370,250.00	1.42	
3	110022	工商银行	9,548,160.00	1.31	
4	110001	中国平安	9,395,400.00	1.29	
5	110003	招商银行	7,854,315.00	1.08	
6	110012</				