

上接B50版

(2)股票选择
本基金管理人综合运用交银施罗德股票研究分析方法和其它投资分析工具,充分发掘研究团队“自下而上”的主动选股能力,精选出具有投资价值的股票进行股票池。

筛选在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司,构建备选股票池,主要筛选指标包括:

①盈利能力指标(如P/E,P/B,ROE,PEBIT等)

②成长性指标(如D/A,流动比率,经营性资产)

③财务状况指标(如A/D,流动负债率)

2)价值评估
在对股票票池基础上,本基金将逐一通过对备选上市公司基本面从分析和深入的实地调研,以定性与定量相结合的方式进行估值分析,结合估值结果,构建本基金风格池,具体从三方面进行系统分析:①行业分析
该部分主要通过对公司所处行业的基本面、主要投资机会、行业整体机会、行业市场表现以及行业的估值情况进行综合考察,从而在行业内进行行业配置和整体投资组合。②公司质地评价
本基金对公司的评价的主要包括企业财务状况、企业的成长能力以及公司治理、管理团队等方面。

首先通过对企业基本面的分析,进行估值,并结合其在行业中的地位,具体指标包括公司ROE和调整后ROE(ROE历史变化率和ROE预测变化率),资产负债率,流动比率,存货周转率,应收账款周转率,存货周转率,经营现金流量/资本支出等。

其次,本基金对企业的成长性的分析,主要是通过对其未来收入增长的预期,具体指标包括公司ROE和调整后ROE(ROE历史变化率和ROE预测变化率),营业收入增长率,净利润增长率,每股收益增长率等。

再次,本基金对公司的治理评价,主要通过公司信息披露情况,具体指标包括公司ROE和调整后ROE(ROE历史变化率和ROE预测变化率),资产负债率,流动比率,存货周转率,应收账款周转率,存货周转率,经营现金流量/资本支出等。

最后,本基金对公司的估值,主要通过市盈率、市净率、市现比、市销率等指标,结合估值结果,构建本基金风格池。

该部分主要通过对公司所处行业的基本面、主要投资机会、行业整体机会、行业市场表现以及行业的估值情况进行综合考察,从而在行业内进行行业配置和整体投资组合。

③公司质地评价
本基金对公司的评价的主要包括企业财务状况、企业的成长能力以及公司治理、管理团队等方面。

本基金本期报告期末未持有债券。

3)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本期报告期末未持有债券。

4)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本期报告期末未持有贵金属。

5)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及权证投资明细

本基金本期报告期末未持有权证。

6)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

本基金本期报告期末未持有股指期货。

7)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

本基金本期报告期末未持有国债期货。

8)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资明细

本基金本期报告期末未持有股票期权。

9)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名商品期货交易情况说明

本基金本期报告期末未持有商品期货。

10)报告期内公司公允价值变动损益占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品交易情况说明

本基金本期报告期末未持有金融衍生品。

11)报告期组合投资情况

报告期末本基金投资的前十名名称的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名发行的主体未受到过行政处罚和处罚。

12)其他资产构成情况

本基金对其他资产的构成为:

其中:存出保证金 152,947.38 元

应收证券清算款 6,086,675.46 元

应收股利 11,326.79 元

应收利息 2,810,218.83 元

应收申购款 - 元

其他 - 元

合计 9,061,168.48 元

13)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

14)报告期末前十名股票中限售流通股的数量说明

本基金本期报告期末前十名股票中不存在限售流通股的情况。

15)报告期末持有的股票投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于股票市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

16)报告期末持有的债券投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于债券市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

17)报告期末持有的贵金属投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于贵金属市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

18)报告期末持有的权证投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于权证市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

19)报告期末持有的股指期货投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于股指期货市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

20)报告期末持有的国债期货投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于国债期货市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

21)报告期末持有的商品期货、商品期权投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于商品期货、商品期权市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

22)报告期末持有的金融衍生品投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于金融衍生品市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

23)报告期末持有的其他投资总额及占基金资产净值的比例

在报告期内,本基金投资于其他投资市场的投资总额及占基金资产净值的比例为0%。

24)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

25)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

26)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

27)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

28)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

29)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

30)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

31)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

32)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

33)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

34)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

35)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

36)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

37)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

38)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

39)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

40)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

41)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

42)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

43)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

44)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

45)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

46)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

47)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

48)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

49)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

50)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

51)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

52)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

53)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

54)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

55)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

56)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

57)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

58)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

59)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

60)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

61)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

62)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

63)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

64)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

65)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

66)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

67)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

68)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

69)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

70)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

71)报告期末持有的资产总值

在报告期内,本基金投资于所有投资品种的总资产及占基金资产净值的比例为100%。

72)报告期末持有的资产总值