



Disclosure 信息披露

2016年6月2日 星期四
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B43

(上接B42版)

债券一级市场上的发行方式创新及新定价与认购情况发生变化,导致二级市场收益率产生波动;
由于市场交易规模及交易因素引起的流动性溢价的重定价;
市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动;
单个券种或某一类别债券的定价变化,也就是市场失衡导致的投资机会等。
4.权益投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权益投资。基金权益投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

5.资产支持证券投资策略
本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

九、业绩比较基准
本基金业绩基准=35%×天相中债全债指数+45%×天相中债成长指数+20%×中证金融指数
天相相关指数系列包含三个规模风格指数——天相大债、天相中债和天相小债,以及六个价值或成长风格指数——大债价值、大债成长、中债价值、中债成长、小债价值和成长。编制方法是:将股票按流通市值排序,累计市值前30%的股票为天相大债,累计流通市值中间40%的股票为天相中债,累计流通市值后30%的股票为天相小债,然后在每个规模风格中按股票按PB值分成长价值,并使得每个规模风格的价值权重流通市值相等。

中证金融指数是中证指数公司编制的反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数公司编制并发布的首只跨市场债券指数,该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券和企业债券组成,中证指数公司每日计算并发布中证金融的收盘指数及相应的债券市值数据,为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对于异常价格和无法成交的债券进行了剔除,避免为异常或流动性差的债券提供收益定价基准。

随着债券市场利率环境发生变化,如上述业绩比较基准不适用本基金,或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停计停止发布,或者出现指数编制方法变更、基金风险收益特征显著改变,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际状况对业绩比较基准进行相应调整,调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整后的2个工作日内至少以一种指定媒体上予以公告。

十、风险收益特征
本基金为混合型基金,基金资产整体的预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

十一、基金投资范围
本基金管理人承诺基金管理人承诺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。

2016年5月31日,中国银河证券股份有限公司根据本会合理规定,于2016年4月19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、误导性陈述或者重大遗漏。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,962,129.08	83.57
	其中:股票	56,962,129.08	83.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售的买入及卖出金融资产	-	-
6	银行存款和其他现金资产合计	92,119,224.46	13.58
7	其他各项资产	19,308,212.51	2.85
8	合计	678,389,576.05	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林牧渔	-	-
2	医药生物	-	-
3	信息技术	-	-
4	金融	-	-
5	其他	-	-

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	300996	利君股份	2,763,117	65,568,766.41	9.76
2	600102	理基股份	5,172,988	65,438,298.20	9.74
3	300145	南方泵业	1,660,379	65,169,875.73	9.70
4	002635	安洁科技	2,504,387	64,818,711.56	9.64
5	300207	顺源达	2,457,435	64,679,689.20	9.62
6	300389	艾比希	1,731,263	64,541,484.64	9.60
7	300232	朗明科技	1,817,457	61,384,410.85	9.21
8	300369	联众光电	2,644,015	60,733,024.55	9.04
9	300274	阳光电源	1,292,200	28,518,854.00	4.34
10	002179	中航光电	235,000	8,401,250.00	1.25

4. 报告期末按品种分类的股票投资组合

份办理了质押式回购交易,具体情况如下:

2016年5月31日,医药投资与中银国际证券有限责任公司(以下简称“中银证券”)签订了《股票质押式回购交易协议书》,将其持有的本公司9,570,000股限售流通股(占公司总股本的3.58%)以股票质押式回

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

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	56,962,129.08	56,962,129.08	83.57
2	2016年5月31日	56,962,129.08	56,962,129.08	83.57
3	2016年5月31日	56,962,129.08	56,962,129.08	83.57
4	2016年5月31日	56,962,129.08	56,962,129.08	83.57
5	2016年5月31日	56,962,129.08	56,962,129.08	83.57

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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

11. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

12. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

13. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

14. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

15. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

16. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

17. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

18. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

19. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

20. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

21. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

22. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
2	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
3	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
4	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58
5	2016年5月31日	92,119,224.46	92,119,224.46	13.58

23. 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金融资产投资明细

序号	金融资产名称	数量(元)	公允价值(元)
----	--------	-------	---------