

**(上接B117版)**

联系人:孙秋月  
联系电话:0532-85202206  
传真:0532-89222605  
客户服务热线:95548  
网址:www.citicfund.com

(68) 西南证券股份有限公司  
注册地址:重庆市江北北区红桥北路8号  
法定代表人:余维彬  
联系人:张煜  
电话:021-63786141  
客服电话:400 899 4096  
公司网站:www.swsc.com.cn

(69) 江苏东方财富证券股份有限公司  
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层  
法定代表人:朱洪波  
联系人:朱洪波  
电话:021-20333333  
传真:021-50498825  
联系人:王正一  
客服电话:95531,400-8888-588  
网址:www.kjzq.com.cn

(70) 第一创业证券股份有限公司  
注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼  
法定代表人:刘学民  
联系人:毛宇萍  
电话:0755-23838750  
客服电话:400-888-1888  
网址:www.foc.com.cn

(71) 川财证券有限责任公司  
注册地址:成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17层  
法定代表人:金泽华  
联系人:王晖  
电话:028-86683953  
客服电话:028-95105118  
公司网站: http://www.ccfq.com

(72) 天风证券股份有限公司  
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼  
法定代表人:余磊  
联系人:潘婕  
电话:027-87610052  
传真:027-87618863  
客户服务电话:4008005000  
网址:www.tfzq.com

(73) 上海证券有限责任公司  
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号  
法定代表人:龚德柏  
联系人:许鲁华  
电话:021-53686262  
传真:0066-21-53681000-7008/0066-21-5368230-7478  
客户服务电话:4008189118/021-962518  
网址:www.shzq.com.cn

(74) 中原证券股份有限公司  
注册地址:郑州市郑东新区CBD东三环商务内环路1号  
法定代表人:张钧  
联系人:李洪涛  
电话:029-63913913  
传真:0755-83217421  
客户服务电话:400-990-8826  
网址:www.ccnew.com.cn

(75) 开源证券股份有限公司  
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:029-63867256  
传真:029-88187650  
客户服务电话:400-860-8866  
网址:www.kysec.com

(76) 深圳众禄金融控股股份有限公司  
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋岗西路4008号大中华国际交易广场东座4楼  
联系人:董浩  
联系人:董广平  
电话:0755-33227950  
传真:0755-33227951  
客户服务电话:4006-788-887  
网址:众禄基金网www.zlfund.cn

(77) 杭州数米基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1214号14楼202室  
法定代表人:陈柏青  
联系人:沈晗  
电话:021-68978400  
传真:021-20691861  
客户服务电话:400-020-2899  
公司网站: www.erfund.com

(78) 上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室  
法定代表人:杨文斌  
联系人:杨文斌  
电话:021-38623777  
传真:021-38697717  
客户服务电话:400-821-5399  
网址:www.howbuy.com

(79) 上海长量基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区高翔路524号2202室  
法定代表人:董承平  
联系人:李海荣  
电话:021-58980111  
传真:021-68909016  
客户服务电话:400 700 9665  
网址:www.shchw.com.cn

(80) 和讯信息科技有限公司  
注册地址:上海市浦东新区东方路122号泛利大厦10层  
法定代表人:王莉  
联系人:王莉  
电话:010-85627337  
客服电话:400-920-0022 / 021-20835888  
公司网站: hk.cake.broom.com

(81) 上海天天基金销售有限公司  
注册地址:上海市徐汇区龙漕路190号东方财富大厦2楼  
法定代表人:其实  
联系人:潘海英  
电话:021-54509988  
传真:021-64385308  
客服电话:400-1818-188  
网址: http://www.1234567.com.cn

(82) 浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址:浙江省杭州市文一西路9号元茂大厦903室  
法定代表人:吴强  
联系人:吴强  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.5ifund.com

(83) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(84) 和讯信息科技有限公司  
注册地址:上海市浦东新区东方路122号泛利大厦10层  
法定代表人:王莉  
联系人:王莉  
电话:010-85627337  
客服电话:400-920-0022 / 021-20835888  
公司网站: hk.cake.broom.com

(85) 上海天天基金销售有限公司  
注册地址:上海市徐汇区龙漕路190号东方财富大厦2楼  
法定代表人:其实  
联系人:潘海英  
电话:021-54509988  
传真:021-64385308  
客服电话:400-1818-188  
网址: http://www.1234567.com.cn

(86) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809  
法定代表人:于刚  
联系人:于刚  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yixinfund.com

(87) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(88) 上海天天基金销售有限公司  
注册地址:上海市徐汇区龙漕路190号东方财富大厦2楼  
法定代表人:其实  
联系人:潘海英  
电话:021-54509988  
传真:021-64385308  
客服电话:400-1818-188  
网址: http://www.1234567.com.cn

(89) 北京晟视天下投资管理有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:李强  
联系人:李强  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.shengshit.com.cn

(90) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(91) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(92) 一路财富(北京)信息科技有限公司  
注册地址:北京市西城区阜成门大街27号5层A座002号  
法定代表人:吕奕勇  
联系人:吕奕勇  
电话:010-88123777  
传真:010-88123885  
客户服务电话:400-001-1566  
网址:www.yilucaifu.com

(93) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(94) 北京景颐投资管理有限公司  
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号10层1008-1012  
法定代表人:赵晓春  
联系人:赵晓春  
电话:010-57756019  
传真:010-786-8868-5  
网址:www.jingyifund.com

(95) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(96) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(97) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(98) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(99) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(100) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

电话:010-57418829  
客户服务热线:400-678-5095  
网址:www.10jqz.com

(95) 深圳瑞之金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区香梅路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元  
法定代表人:曹军  
联系人:叶健  
电话:0755-33576853  
客服电话:0755-33655516  
客户服务热线:400-999-8600  
网址:www.reuzhijin.com

(96) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(97) 北京德恒华盈投资咨询有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:王岩  
联系人:胡明会  
电话:010-52090855  
客服电话:010-52090800  
客户服务热线:400-819-9688  
网址:www.dhwyfund.com

(98) 上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:杨文斌  
联系人:杨文斌  
电话:021-33232993  
客服电话:400-820-2819  
手机交易:400-1588-5888  
网址:www.howbuy.com

(99) 上海利得基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区四川路5475号1033室  
法定代表人:沈震博  
联系人:李海荣  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400676266  
公司网站: www.lidfund.com.cn

(100) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(101) 上海恒信基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-20665922  
客服电话:400-821-9031  
网址:www.hundfund.com

(102) 深圳前海微众银行股份有限公司  
注册地址:深圳市南山区沙河西路1819号微众银行大厦9楼  
法定代表人:顾敏  
联系人:李海荣  
电话:0755-85099922  
客服电话:0755-85099922  
客户服务热线:0755-85099922  
网址:www.wenwubank.com

(103) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(104) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(105) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(106) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(107) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(108) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(109) 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号东方广场A座21层  
法定代表人:尹洪涛  
联系人:尹洪涛  
电话:010-59027888  
客服电话:400-679-9200  
网址:www.yinfund.com

(110) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(111) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(112) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(113) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(114) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(115) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(116) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(117) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(118) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(119) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

(120) 上海源石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号1501室  
法定代表人:李刚  
联系人:李刚  
电话:021-50583533  
客服电话:021-50583533  
客户服务热线:400-679-9200  
网址:www.youshiwealth.com

转出净值在转入基金中对应的申购费用=11,451.3-11,282.07=169.23元  
转出净值在转出基金中对应的申购金额=11,451.3/1.015=11,282.07元  
转出净值在转入基金中对应的申购费用=11,451.3-11,282.07=169.23元  
转出净值在转出基金中对应的申购金额=11,451.3-169.23=11,282.07元  
转出净值在转入基金中对应的申购费用=11,451.3-11,282.07=169.23元  
转出净值在转出基金中对应的申购金额=11,451.3-169.23=11,282.07元

**八、基金的投资目标**  
本基金的投资目标是:在严格控制风险的前提下,通过专业化投资管理,为投资者提供长期稳定并可持续增长的投资价值。各基金投资目标如下:  
1. 优选混合型基金利用“晨曦成长股票数据库”对股票进行精密和系统的分析,构建具有投资价值股票组合,力求为投资者提供长期的资本增值。  
2. 货币市场基金在保持基金的高流动性和安全性的前提下,获得高于基准的投资回报。  
3. 动力平衡基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标,注重通过动态的资产配置以达到当期收益与长期资本增值的均衡,努力为投资者提供长期稳定的回报。

**九、基金的投资策略**  
本基金的投资策略包括:  
1. 资产配置策略  
本基金的投资组合包括股票、债券、货币市场基金、权证、股指期货、大宗商品等。  
2. 股票投资策略  
本基金采用“晨曦成长股票数据库”对股票进行精密和系统的分析,构建具有投资价值股票组合,力求为投资者提供长期的资本增值。  
3. 债券投资策略  
本基金采用“晨曦成长债券数据库”对债券进行精密和系统的分析,构建具有投资价值债券组合,力求为投资者提供长期的资本增值。  
4. 货币市场基金投资策略  
本基金采用“晨曦成长货币市场基金数据库”对货币市场基金进行精密和系统的分析,构建具有投资价值货币市场基金组合,力求为投资者提供长期的资本增值。  
5. 权证投资策略  
本基金采用“晨曦成长权证数据库”对权证进行精密和系统的分析,构建具有投资价值权证组合,力求为投资者提供长期的资本增值。  
6. 股指期货投资策略  
本基金采用“晨曦成长股指期货数据库”对股指期货进行精密和系统的分析,构建具有投资价值股指期货组合,力求为投资者提供长期的资本增值。  
7. 大宗商品投资策略  
本基金采用“晨曦成长大宗商品数据库”对大宗商品进行精密和系统的分析,构建具有投资价值大宗商品组合,力求为投资者提供长期的资本增值。

**十、基金的风险控制**  
本基金的风险控制策略包括:  
1. 资产配置风险控制  
本基金通过动态的资产配置,控制基金的整体风险水平。  
2. 股票风险控制  
本基金通过“晨曦成长股票数据库”对股票进行精密和系统的分析,控制股票组合的整体风险水平。  
3. 债券风险控制  
本基金通过“晨曦成长债券数据库”对债券进行精密和系统的分析,控制债券组合的整体风险水平。  
4. 货币市场基金风险控制  
本基金通过“晨曦成长货币市场基金数据库”对货币市场基金进行精密和系统的分析,控制货币市场基金组合的整体风险水平。  
5. 权证风险控制  
本基金通过“晨曦成长权证数据库”对权证进行精密和系统的分析,控制权证组合的整体风险水平。  
6. 股指期货风险控制  
本基金通过“晨曦成长股指期货数据库”对股指期货进行精密和系统的分析,控制股指期货组合的整体风险水平。  
7. 大宗商品风险控制  
本基金通过“晨曦成长大宗商品数据库”对大宗商品进行精密和系统的分析,控制大宗商品组合的整体风险水平。

**十一、基金的费用**  
本基金的费用包括:  
1. 基金管理费  
2. 基金托管费  
3. 基金销售服务费  
4. 基金赎回费  
5. 基金申购费  
6. 基金认购费  
7. 基金转换费  
8. 基金定投费  
9. 基金分红费  
10. 基金其他费用

**十二、基金的信息披露**  
本基金的信息披露包括:  
1. 基金招募说明书  
2. 基金合同  
3. 基金托管协议  
4. 基金定期报告  
5. 基金临时报告  
6. 基金清算报告  
7. 基金其他文件

**十三、基金的公告**  
本基金的公告包括:  
1. 基金招募说明书  
2. 基金合同  
3. 基金托管协议  
4. 基金定期报告  
5. 基金临时报告  
6. 基金清算报告  
7. 基金其他文件

序号	名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券清算款	329,230.08	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	5,960,876.34	-
5	应收申购款	780,927.86	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	7,071,069.28	-

11.4 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券:  
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分无。

**货币市场基金投资组合情况**  
1. 报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	253,248,555.39	41.74
2	其中:国债	253,248,555.39	41.74
3	货币支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	130,000,715.00	21.42
5	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和货币支持证券合计	165,353,525.27	27.25
7	其他资产	58,174,493.25	9.59
8	合计	606,774,288.91	100.00

注:报告期末结束持仓持仓中包含货币基金定期存款162,690,000.00元。

**2. 报告期末基金投资组合情况**

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	报告期末国债到期前金融资产	-	-
2	报告期末国债到期后金融资产	75,909,762.03	14.35

注:报告期内国债到期前金融资产占基金总资产的比例为报告期内每个交易日国债金融资产占基金总资产净值的简单平均值。  
报告期末国债到期后金融资产占基金总资产净值的20%的说明  
本报告期末本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。  
3. 基金投资组合平均存续期限

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

报告期内,本货币基金投资组合平均剩余期限未超过180天;报告期内,本货币基金投资组合平均剩余期限未超过180天。  
3.2 报告期末基金投资组合平均存续期限分布比例

序号	平均存续期限	各期限资产占基金总资产净值的比例(%)	各期限占基金总资产净值的比例(%)
1	30天以内	55.82	14.35
1	其中:剩余存续期限在30天以内的浮动利率资产	-	-
2	30天以内-60天	7.58	-
3	60天以内-90天	18.91	-
3	其中:剩余存续期限在30天以内的浮动利率资产	-	-
4	90天以内-180天	17.59	-
4	其中:剩余存续期限在30天以内的浮动利率资产	-	-
5	180天以内-390天(含)	3.78	-
5	其中:剩余存续期限在30天以内的浮动利率资产	-	-
6	合计	103.68	14.35

**4. 报告期末投资组合品种的债券投资组合**

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	33,031,790.88	6.24
3	其中:政策性金融债	33,031,790.88	6.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	220,213,763.61	41.62
6	中期票据	-	-
7	待偿还资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	253,248,555.39	47.86
10	报告期内未到期资产支持证券	-	-

5. 报告期末投资组合品种类型的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	33,031,790.88	6.24
3	其中:政策性金融债	33,031,790.88	6.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	220,213,763.61	41.62
6	中期票据	-	-
7	待偿还资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	253,248,555.39	47.86
10	报告期内未到期资产支持证券	-	-

6. 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏差

项目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值	0.000000
报告期内偏离度的最高值	0.112222
报告期内偏离度的最低值	-0.000000
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.000000

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
8. 投资组合报告附注

本基金采用摊余成本法计价,即计价以买入成本或摊余,按照票面利率或约定利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其存续期间内摊销,每日计提损益。本基金采用摊余成本法,基金资产的净值单位为1.0000元。

**8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分无。**

**动力平衡基金投资组合情况**  
1. 报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	932,818,147.61	74.21
1	其中:普通股	932,818,147.61	74.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,503,936.23	21.20
3	其中:国债	26,503,936.23	21.20
4	货币支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和货币支持证券合计	50,568,263.48	4.02
8	其他资产	7,071,069.28	0.56
9	合计	1,256,961,416.60	100.00

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)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	58,571,489.04	44.22
D	电力、热力、燃气及生产供应业	56,186,427.52	4.40
E	建筑业	36,234.48	0.00
F	交通运输、仓储和邮政业	14,138,452.88	1.13
G	批发和零售业	12,031,529.42	0.96
H	信息技术、软件和信息技术服务业	11,187,209.39	0.89
J	房地产业	79,592,344.32	6.35
K	金融业	83,321,997.48	6.65
M	医药制造业	20,922,344.88	1.67
N	水利、建筑业和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、通用航空服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		932,818,147.61	74.40

2.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

|--|