

(上接B23)

[illegible][illegible][illegible]

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号绿地金融中心40楼
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号绿地金融中心40楼
信息披露负责人:	王瑞
联系电话:	021-58787888
传真:	021-58787888
电子邮箱:	sh@chinafund.com.cn
网址:	www.chinafund.com.cn

(17)力证证券有限责任公司

注册地址:	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心10、11、12层及30、31、32层
办公地址:	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心10、11、12层及30、31、32层
信息披露负责人:	张永泰
联系电话:	0755-23992600
传真:	0755-23992600
电子邮箱:	zhangyongtai@chinafund.com.cn
网址:	http://www.chinafund.com.cn

(18)华鑫证券有限责任公司

注册地址:	深圳市福田区金田路4018号安联大厦30、31、32、33、34层
办公地址:	深圳市福田区金田路4018号安联大厦30、31、32、33、34层
信息披露负责人:	张琳
联系电话:	0755-58303000
传真:	0755-58303000
电子邮箱:	zhanglin@chinafund.com.cn
网址:	http://www.chinafund.com.cn

(19)国信证券股份有限公司

注册地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
办公地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
信息披露负责人:	孙国新
联系电话:	0755-40789999
电子邮箱:	guoxin.sun@chinafund.com.cn
网址:	http://www.guoxin.com.cn

(20)中国中投证券有限责任公司

注册地址:	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座3层
办公地址:	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座3层
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	0755-58160666
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.cicc.com.cn

(21)方正证券股份有限公司

注册地址:	湖南省长沙市芙蓉中路二段80号中兴证券大厦20楼
办公地址:	湖南省长沙市芙蓉中路二段80号中兴证券大厦20楼
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	0731-85497729
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.fundoo.com.cn

(22)上海证券有限责任公司

注册地址:	上海市虹口区四川北路360号
办公地址:	上海市虹口区四川北路360号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	021-50454646
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.shzq.com.cn

(23)九州证券股份有限公司

注册地址:	陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门2幢1001室
办公地址:	陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门2幢1001室
信息披露负责人:	张静
联系电话:	029-88266666
电子邮箱:	zhangjing@chinafund.com.cn
网址:	http://www.jiuzhou.com.cn

(24)国金证券股份有限公司

注册地址:	四川省成都市东城根上街15号
办公地址:	四川省成都市东城根上街15号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	028-86690000
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.guojin.com.cn

(25)中国民族证券有限责任公司

注册地址:	北京市朝阳区东三环北路2号
办公地址:	北京市朝阳区东三环北路2号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	010-65953636
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.mzsec.com.cn

(26)华宝证券有限责任公司

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	021-52322888
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.huabao.com.cn

(27)长城国瑞证券有限责任公司

注册地址:	北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座1001室
办公地址:	北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座1001室
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	010-63200888
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.cgr.com.cn

(28)爱建证券有限责任公司

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	021-52322888
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.ajzq.com.cn

(29)光大证券股份有限公司

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1500号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	021-52322888
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.ebsc.com.cn

(30)信达证券股份有限公司

注册地址:	北京市西城区金融大街19号
办公地址:	北京市西城区金融大街19号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	010-63200888
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.cindasc.com.cn

(31)大通证券股份有限公司

注册地址:	辽宁省大连市中山路126号
办公地址:	辽宁省大连市中山路126号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	0411-24222888
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.dntong.com.cn

(32)首创证券有限责任公司

注册地址:	北京市西城区金融大街19号
办公地址:	北京市西城区金融大街19号
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	010-63200888
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.scfund.com.cn

(33)方正证券股份有限公司

注册地址:	湖南省长沙市芙蓉中路二段80号中兴证券大厦20楼
办公地址:	湖南省长沙市芙蓉中路二段80号中兴证券大厦20楼
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	0731-85497729
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.fundoo.com.cn

(34)国信证券股份有限公司

注册地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
办公地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	0755-40789999
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.guoxin.com.cn

(35)国信证券股份有限公司

注册地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
办公地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	0755-40789999
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.guoxin.com.cn

(36)国信证券股份有限公司

注册地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
办公地址:	深圳市福田区福中三路100号投行大厦10楼
信息披露负责人:	王宇
联系电话:	0755-40789999
电子邮箱:	wangyu@chinafund.com.cn
网址:	http://www.guoxin.com.cn

六、基金的投资目标

本基金在追求基金资产长期增值的前提下,本基金在多次复合投资策略的基础上,采取低风险收益模式,以长期投资方式,寻找价值低估的上市公司进行投资,追求基金资产的长期稳定增长。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于经沪、深两市精选的高质量的上市公司中具有成长性的上市公司股票,这部分投资比例将不超过基金资产净值的90%。

本基金采用定期定额投资策略的多层次复合投资策略。

四、基金的名称

五、基金的类型

六、基金的投资目标

在力求基金资产长期增值的前提下,本基金在多次复合投资策略的基础上,采取低风险收益模式,以长期投资方式,寻找价值低估的上市公司进行投资,追求基金资产的长期稳定增长。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于经沪、深两市精选的高质量的上市公司中具有成长性的上市公司股票,这部分投资比例将不超过基金资产净值的90%。

本基金采用定期定额投资策略的多层次复合投资策略。

[illegible]

九、业绩比较基准

自本基金成立日至2008年8月31日,本基金业绩比较基准为:基金管理人通过自身的投资管理,创造出一种能够长期持续实现非负增长之势的安全收益基准,简称价值增长线。

为使本基金的业绩与其业绩比较基准具有更直观的对比性,本公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案同意后,自2008年9月1日起本基金业绩比较基准变更为:70%×沪深300指数收益率+30%×中国债券总指数收益率。

今后如果市场出现更具代表性的投资基准,或者更科学的复合指数权重比例,在与基金托管人协商一致后,基金管理人可

基金的風險收益特征

本基金属于投资于权益类资产的中等风险品种, 以在风险约束下期收益最大化为核心, 在收益稳定性上追求下跌风险有限, 上收益接近无风险的目标。

十一、基金的投资

博时基金管理有限公司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。

基金管理人根据本基金基金合同规定, 复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容, 保证该报告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 2017 年 3 月 30 日, 本报告中所列财务数据未经审计。

序	類別	金額(元)	備註(元)	資產負債表中的金額(元)
1	現金及現金等價物	5,272,049,176.00		5,272,049,176.00
2	其中：貨幣	5,272,049,176.00		5,272,049,176.00
3	存放中央銀行款項	963,750,000.00		963,750,000.00
4	其中：準備	963,750,000.00		963,750,000.00
5	存放同業及其他金融機構款項	--		--
6	其中：拆出資金	--		--
7	存放保險公司款項	--		--
8	其中：拆出資金	--		--
9	存放非銀行金融機構款項	--		--
10	其中：拆出資金	--		--
11	存放中央銀行準備金	--		--
12	其中：法定存款準備金	--		--
13	其中：超額存款準備金	--		--
14	其中：其他存款準備金	--		--
15	存放同業及其他金融機構款項	--		--
16	其中：拆出資金	--		--
17	存放保險公司款項	--		--
18	其中：拆出資金	--		--
19	存放非銀行金融機構款項	--		--
20	其中：拆出資金	--		--
21	存放中央銀行準備金	--		--
22	其中：法定存款準備金	--		--
23	其中：超額存款準備金	--		--
24	其中：其他存款準備金	--		--
25	存放同業及其他金融機構款項	--		--
26	其中：拆出資金	--		--
27	存放保險公司款項	--		--
28	其中：拆出資金	--		--
29	存放非銀行金融機構款項	--		--
30	其中：拆出資金	--		--
31	存放中央銀行準備金	--		--
32	其中：法定存款準備金	--		--
33	其中：超額存款準備金	--		--
34	其中：其他存款準備金	--		--
35	存放同業及其他金融機構款項	--		--
36	其中：拆出資金	--		--
37	存放保險公司款項	--		--
38	其中：拆出資金	--		--
39	存放非銀行金融機構款項	--		--
40	其中：拆出資金	--		--
41	存放中央銀行準備金	--		--
42	其中：法定存款準備金	--		--
43	其中：超額存款準備金	--		--
44	其中：其他存款準備金	--		--
45	存放同業及其他金融機構款項	--		--
46	其中：拆出資金	--		--
47	存放保險公司款項	--		--
48	其中：拆出資金	--		--
49	存放非銀行金融機構款項	--		--
50	其中：拆出資金	--		--
51	存放中央銀行準備金	--		--
52	其中：法定存款準備金	--		--
53	其中：超額存款準備金	--		--
54	其中：其他存款準備金	--		--
55	存放同業及其他金融機構款項	--		--
56	其中：拆出資金	--		--
57	存放保險公司款項	--		--
58	其中：拆出資金	--		--
59	存放非銀行金融機構款項	--		--
60	其中：拆出資金	--		--
61	存放中央銀行準備金	--		--
62	其中：法定存款準備金	--		--
63	其中：超額存款準備金	--		--
64	其中：其他存款準備金	--		--
65	存放同業及其他金融機構款項	--		--
66	其中：拆出資金	--		--
67	存放保險公司款項	--		--
68	其中：拆出資金	--		--
69	存放非銀行金融機構款項	--		--
70	其中：拆出資金	--		--
71	存放中央銀行準備金	--		--
72	其中：法定存款準備金	--		--
73	其中：超額存款準備金	--		--
74	其中：其他存款準備金	--		--
75	存放同業及其他金融機構款項	--		--
76	其中：拆出資金	--		--
77	存放保險公司款項	--		--
78	其中：拆出資金	--		--
79	存放非銀行金融機構款項	--		--
80	其中：拆出資金	--		--
81	存放中央銀行準備金	--		--
82	其中：法定存款準備金	--		--
83	其中：超額存款準備金	--		--
84	其中：其他存款準備金	--		--
85	存放同業及其他金融機構款項	--		--
86	其中：拆出資金	--		--
87	存放保險公司款項	--		--
88	其中：拆出資金	--		--
89	存放非銀行金融機構款項	--		--
90	其中：拆出資金	--		--
91	存放中央銀行準備金	--		--
92	其中：法定存款準備金	--		--
93	其中：超額存款準備金	--		--
94	其中：其他存款準備金	--		--
95	存放同業及其他金融機構款項	--		--
96	其中：拆出資金	--		--
97	存放保險公司款項	--		--
98	其中：拆出資金	--		--
99	存放非銀行金融機構款項	--		--
100	其中：拆出資金	--		--
101	存放中央銀行準備金	--		--
102	其中：法定存款準備金	--		--
103	其中：超額存款準備金	--		--
104	其中：其他存款準備金	--		--
105	存放同業及其他金融機構款項	--		--
106	其中：拆出資金	--		--
107	存放保險公司款項	--		--
108	其中：拆出資金	--		--
109	存放非銀行金融機構款項	--		--
110	其中：拆出資金	--		--
111	存放中央銀行準備金	--		--
112	其中：法定存款準備金	--		--
113	其中：超額存款準備金	--		--
114	其中：其他存款準備金	--		--
115	存放同業及其他金融機構款項	--		--
116	其中：拆出資金	--		--
117	存放保險公司款項	--		--
118	其中：拆出資金	--		--
119	存放非銀行金融機構款項	--		--
120	其中：拆出資金	--		--
121	存放中央銀行準備金	--		--
122	其中：法定存款準備金	--		--
123	其中：超額存款準備金	--		--
124	其中：其他存款準備金	--		--
125	存放同業及其他金融機構款項	--		--
126	其中：拆出資金	--		--
127	存放保險公司款項	--		--
128	其中：拆出資金	--		--
129	存放非銀行金融機構款項	--		--
130	其中：拆出資金	--		--
131	存放中央銀行準備金	--		--
132	其中：法定存款準備金	--		--
133	其中：超額存款準備金	--		--
134	其中：其他存款準備金	--		--
135	存放同業及其他金融機構款項	--		--
136	其中：拆出資金	--		--
137	存放保險公司款項	--		--
138	其中：拆出資金	--		--
139	存放非銀行金融機構款項	--		--
140	其中：拆出資金	--		--
141	存放中央銀行準備金	--		--
142	其中：法定存款準備金	--		--
143	其中：超額存款準備金	--		--
144	其中：其他存款準備金	--		--
145	存放同業及其他金融機構款項	--		--
146	其中：拆出資金	--		--
147	存放保險公司款項	--		--
148	其中：拆出資金	--		--
149	存放非銀行金融機構款項	--		--
150	其中：拆出資金	--		--
151	存放中央銀行準備金	--		--
152	其中：法定存款準備金	--		--
153	其中：超額存款準備金	--		--
154	其中：其他存款準備金	--		--
155	存放同業及其他金融機構款項	--		--
156	其中：拆出資金	--		--
157	存放保險公司款項	--		--
158	其中：拆出資金	--		--
159	存放非銀行金融機構款項	--		--
160	其中：拆出資金	--		--
161	存放中央銀行準備金	--		--
162	其中：法定存款準備金	--		--
163	其中：超額存款準備金	--		--
164	其中：其他存款準備金	--		--
165	存放同業及其他金融機構款項	--		--
166	其中：拆出資金	--		--
167	存放保險公司款項	--		--
168	其中：拆出資金	--		--
169	存放非銀行金融機構款項	--		--
170	其中：拆出資金	--		--
171	存放中央銀行準備金	--		--
172	其中：法定存款準備金	--		--
173	其中：超額存款準備金	--		--
174	其中：其他存款準備金	--		--
175	存放同業及其他金融機構款項	--		--
176	其中：拆出資金	--		--
177	存放保險公司款項	--		--
178	其中：拆出資金	--		--
179	存放非銀行金融機構款項	--		--
180	其中：拆出資金	--		--
181	存放中央銀行準備金	--		--
182	其中：法定存款準備金	--		--
183	其中：超額存款準備金	--		--
184	其中：其他存款準備金	--		--
185	存放同業及其他金融機構款項	--		--
186	其中：拆出資金	--		--
187	存放保險公司款項	--		--
188	其中：拆出資金	--		--
189	存放非銀行金融機構款項	--		--
190	其中：拆出資金	--		--
191	存放中央銀行準備金	--		--
192	其中：法定存款準備金	--		--
193	其中：超額存款準備金	--		--
194	其中：其他存款準備金	--		--
195	存放同業及其他金融機構款項	--		--
196	其中：拆出資金	--		--
197	存放保險公司款項	--		--
198	其中：拆出資金	--		--
199	存放非銀行金融機構款項	--		--
200	其中：拆出資金	--		--
201	存放中央銀行準備金	--		--
202	其中：法定存款準備金	--		--
203	其中：超額存款準備金	--		--
204	其中：其他存款準備金	--		--
205	存放同業及其他金融機構款項	--		--
206	其中：拆出資金	--		--
207	存放保險公司款項	--		--
208	其中：拆出資金	--		--
209	存放非銀行金融機構款項	--		--
210	其中：拆出資金	--		--
211	存放中央銀行準備金	--		--
212	其中：法定存款準備金	--		--
213	其中：超額存款準備金	--		--
214	其中：其他存款準備金	--		--
215	存放同業及其他金融機構款項	--		--
216	其中：拆出資金	--		--
217	存放保險公司款項	--		--
218	其中：拆出資金	--		--
219	存放非銀行金融機構款項	--		--
220	其中：拆出資金	--		--
221	存放中央銀行準備金	--		--
222	其中：法定存款準備金	--		--
223	其中：超額存款準備金	--		--
224	其中：其他存款準備金	--		--
225	存放同業及其他金融機構款項	--		--
226	其中：拆出資金	--		--
227	存放保險公司款項	--		--
228	其中：拆出資金	--		--
229	存放非銀行金融機構款項	--		--
230	其中：拆出資金	--		--
231	存放中央銀行準備金	--		--
232	其中：法定存款準備金	--		--
233	其中：超額存款準備金	--		--
234	其中：其他存款準備金	--		--
235	存放同業及其他金融機構款項	--		--
236	其中：拆出資金	--		--
237	存放保險公司款項	--		--
238	其中：拆出資金	--		--
239	存放非銀行金融機構款項	--		--
240	其中：拆出資金	--		--
241	存放中央銀行準備金	--		--
242	其中：法定存款準備金	--		--
243	其中：超額存款準備金	--		--
244	其中：其他存款準備金	--		--
245	存放同業及其他金融機構款項	--		--
246	其中：拆出資金	--		--
247	存放保險公司款項	--		--
248	其中：拆出資金	--		--
249	存放非銀行金融機構款項	--		--
250	其中：拆出資金	--		--
251	存放中央銀行準備金	--		--
252	其中：法定存款準備金	--		--
253	其中：超額存款準備金	--		--
254	其中：其他存款準備金	--		--
255	存放同業及其他金融機構款項	--		--
256	其中：拆出資金	--		--
257	存放保險公司款項	--		--
258	其中：拆出資金	--		--
259	存放非銀行金融機構款項	--		--
260	其中：拆出資金	--		--
261	存放中央銀行準備金	--		--
262	其中：法定存款準備金	--		--
263	其中：超額存款準備金	--		--
264	其中：其他存款準備金	--		--
265	存放同業及其他金融機構款項	--		--
266	其中：拆出資金	--		--
267	存放保險公司款項	--		--
268	其中：拆出資金	--		--
269	存放非銀行金融機構款項	--		--
270	其中：拆出資金	--		--
271	存放中央銀行準備金	--		--
272	其中：法定存款準備金	--		--
273	其中：超額存款準備金	--		--
274	其中：其他存款準備金	--		--
275	存放同業及其他金融機構款項	--		--
276	其中：拆出資金	--		--
277	存放保險公司款項	--		--
278	其中：拆出資金	--		--
279	存放非銀行金融機構款項	--		--
280	其中：拆出資金	--		--
281	存放中央銀行準備金	--		--
282	其中：法定存款準備金	--		--
283	其中：超額存款準備金	--		--
284	其中：其他存款準備金	--		--
285	存放同業及其他金融機構款項	--		--
286	其中：拆出資金	--		--
287	存放保險公司款項	--		--
288	其中：拆出資金	--		--
289	存放非銀行金融機構款項	--		--
290	其中：拆出資金	--		--
291	存放中央銀行準備金	--		--
292	其中：法定存款準備金	--		--
293	其中：超額存款準備金	--		--
294	其中：其他存款準備金	--		--
295	存放同業及其他金融機構款項	--		--
296	其中：拆出資金	--		--
297	存放保險公司款項	--		--
298	其中：拆出資金	--		--
299	存放非銀行金融機構款項	--		--
300	其中：拆出資金	--		--
301	存放中央銀行準備金	--		--
302	其中：法定存款準備金	--		--
303	其中：超額存款準備金	--		--
304	其中：其他存款準備金	--		--
305	存放同業及其他金融機構款項	--		--
306	其中：拆出資金	--		--
307	存放保險公司款項	--		--
308	其中：拆出資金	--		--
309	存放非銀行金融機構款項	--		--
310	其中：拆出資金	--		--
311	存放中央銀行準備金	--		--
312	其中：法定存款準備金	--		--
313	其中：超額存款準備金	--		--
314	其中：其他存款準備金	--		--
315	存放同業及其他金融機構款項	--		--
316	其中：拆出資金	--		--
317	存放保險公司款項	--		--
318	其中：拆出資金	--		--
319	存放非銀行金融機構款項	--		--
320	其中：拆出資金	--		--
321	存放中央銀行準備金	--		--
322	其中：法定存款準備金	--		--
323	其中：超額存款準備金	--		--
324	其中：其他存款準備金	--		--
325	存放同業及其他金融機構款項	--		--
326	其中：拆出資金	--		--
327	存放保險公司款項	--		--
328	其中：拆出資金	--		--
329	存放非銀行金融機構款項	--		--
330	其中：拆出資金	--		--
331	存放中央銀行準備金	--		--
332	其中：法定存款準備金	--		--
333	其中：超額存款準備金	--		--
334	其中：其他存款準備金	--		--
335				

代码	行次	名称	金额(元)	占营业收入比例(%)
A	合计			
B	流动资产		16,537,269.94	7.65
C	货币资金		1,919,762,302.94	93.85
D	应收账款、应收票据及应收款项融资		429,726,217.78	20.29
E	预付款项			
F	其他应收款			
G	交易性金融资产		221,000,000.00	10.71
H	存货			
I	合同资产			
J	其他流动资产			
K	非流动资产		65,866,209.58	3.15
L	长期股权投资			
M	债权投资			
N	其他权益工具投资			
O	其他非流动金融资产			
P	固定资产			
Q	在建工程			
R	无形资产			
S	开发支出			
T	商誉			
U	长期待摊费用			
V	递延所得税资产			
W	其他非流动资产			

這座的前山夕陽西照。

序号	资产名称	账面价值	公允价值	公允价值与账面价值的差额	公允价值与账面价值的差额占账面价值的比例
1	000000	大资金类	36,000,000	479,138,102.12	9.95
2	000000	中产资金类	38,520,110	428,103,377.78	9.95
3	000000	零资产类	29,352,000	36,273,062.20	6.23
4	000000	理财类资产	36,757,700	36,307,400	6.23
5	002004	理财产品	2,140,460	218,500,470.00	5.50
6	000000	基金类资产	34,798,750	375,500,000	5.49
7	000000	银行理财产品	33,800,000	325,198,020	5.49
8	000000	货币类资产	3,000,000	3,000,000	5.49
9	000000	基金类资产	6,750,750	807,598,000	5.49
10	000000	货币基金	6,650,400	80,590,000	5.50

序号	投资品种	公允价值(元)	公允价值变动率(%)
1	银行存款	100,873,600.00	2.53
2	买入返售金融资产	-	-
3	应收票据	713,845,000.00	16.35
4	资产减值准备	713,845,000.00	16.35
5	公允价值变动损益	-	-
6	公允价值变动损益	-	-
7	可供出售金融资产	-	-
8	其他应收款	-	-
9	其他流动资产	503,763,700.00	20.84

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票投资明细

数量 (枚)

3	140025	140025101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
4	140026	140026101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
5	140027	140027101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
6	140028	140028101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
7	140029	140029101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
8	140030	140030101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
9	140031	140031101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
10	140032	140032101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
11	140033	140033101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
12	140034	140034101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
13	140035	140035101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
14	140036	140036101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
15	140037	140037101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
16	140038	140038101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
17	140039	140039101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
18	140040	140040101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
19	140041	140041101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
20	140042	140042101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
21	140043	140043101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
22	140044	140044101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
23	140045	140045101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
24	140046	140046101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
25	140047	140047101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
26	140048	140048101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
27	140049	140049101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
28	140050	140050101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
29	140051	140051101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
30	140052	140052101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
31	140053	140053101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
32	140054	140054101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
33	140055	140055101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
34	140056	140056101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
35	140057	140057101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
36	140058	140058101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
37	140059	140059101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
38	140060	140060101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
39	140061	140061101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
40	140062	140062101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
41	140063	140063101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
42	140064	140064101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
43	140065	140065101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
44	140066	140066101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
45	140067	140067101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
46	140068	140068101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
47	140069	140069101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
48	140070	140070101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
49	140071	140071101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
50	140072	140072101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
51	140073	140073101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
52	140074	140074101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
53	140075	140075101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
54	140076	140076101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
55	140077	140077101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
56	140078	140078101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
57	140079	140079101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
58	140080	140080101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
59	140081	140081101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
60	140082	140082101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
61	140083	140083101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
62	140084	140084101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
63	140085	140085101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
64	140086	140086101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
65	140087	140087101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
66	140088	140088101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
67	140089	140089101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
68	140090	140090101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
69	140091	140091101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
70	140092	140092101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
71	140093	140093101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
72	140094	140094101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
73	140095	140095101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
74	140096	140096101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
75	140097	140097101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
76	140098	140098101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
77	140099	140099101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
78	140100	140100101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
79	140101	140101101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
80	140102	140102101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
81	140103	140103101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
82	140104	140104101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
83	140105	140105101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
84	140106	140106101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
85	140107	140107101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
86	140108	140108101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
87	140109	140109101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
88	140110	140110101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
89	140111	140111101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
90	140112	140112101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
91	140113	140113101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
92	140114	140114101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
93	140115	140115101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
94	140116	140116101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
95	140117	140117101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
96	140118	140118101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
97	140119	140119101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
98	140120	140120101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
99	140121	140121101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
100	140122	140122101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
101	140123	140123101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
102	140124	140124101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
103	140125	140125101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
104	140126	140126101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
105	140127	140127101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
106	140128	140128101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
107	140129	140129101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
108	140130	140130101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
109	140131	140131101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
110	140132	140132101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
111	140133	140133101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
112	140134	140134101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
113	140135	140135101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
114	140136	140136101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
115	140137	140137101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
116	140138	140138101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
117	140139	140139101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
118	140140	140140101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
119	140141	140141101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
120	140142	140142101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
121	140143	140143101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
122	140144	140144101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
123	140145	140145101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
124	140146	140146101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
125	140147	140147101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
126	140148	140148101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
127	140149	140149101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
128	140150	140150101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
129	140151	140151101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
130	140152	140152101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
131	140153	140153101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
132	140154	140154101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
133	140155	140155101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
134	140156	140156101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
135	140157	140157101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
136	140158	140158101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
137	140159	140159101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
138	140160	140160101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
139	140161	140161101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
140	140162	140162101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
141	140163	140163101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
142	140164	140164101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
143	140165	140165101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
144	140166	140166101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
145	140167	140167101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
146	140168	140168101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
147	140169	140169101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
148	140170	140170101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
149	140171	140171101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
150	140172	140172101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
151	140173	140173101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
152	140174	140174101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
153	140175	140175101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
154	140176	140176101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
155	140177	140177101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
156	140178	140178101	5,000,000.00	80,000,000.00	6.10
157					

没有林牧等部門立案

[illegible]

在。

15. 报告期内前十名股票中存在流通受限情况的, 请说明
本基金报告期内前十名股票不存在流通受限情况。

16. 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在误差。

三、基金的投资

基金管理人依照职责严守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。投资的业绩并不表示其未来表现。投资有风险, 投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效至报告期末, 本基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比情况

增长指标	③ 业绩比较基准
------	----------

2005 年 1 月 1 日	-1.78%	0.80%	0.00%	0.00%	-1.78%	0.80%
2005 年 12 月 31 日	19.48%	0.00%	0.45%	0.00%	19.48%	0.00%
2006 年 1 月 1 日	-1.77%	1.15%	0.38%	0.15%	-10.77%	1.15%
2006 年 12 月 31 日	19.48%	0.00%	0.45%	0.00%	19.48%	0.00%
2007 年 1 月 1 日	19.48%	0.00%	0.45%	0.15%	79.48%	1.00%
2007 年 12 月 31 日	19.48%	0.00%	0.45%	0.15%	79.48%	1.00%
2008 年 1 月 1 日	-0.76%	0.00%	0.45%	0.15%	-10.76%	1.00%
2008 年 12 月 31 日	19.48%	1.57%	0.17%	0.14%	-10.52%	1.17%
2009 年 1 月 1 日	-1.78%	1.00%	0.45%	1.15%	1.20%	0.00%
2009 年 12 月 31 日	-1.78%	0.00%	0.45%	1.15%	1.20%	0.00%
2010 年 1 月 1 日	-1.78%	0.00%	0.45%	1.15%	1.20%	0.00%
2010 年 12 月 31 日	-1.78%	0.00%	0.45%	1.15%	1.20%	0.00%
2011 年 1 月 1 日	-1.78%	1.15%	0.45%	0.00%	1.16%	0.00%
2011 年 12 月 31 日	-1.78%	1.15%	0.45%	0.00%	1.16%	0.00%
2012 年 1 月 1 日	-1.78%	0.00%	0.45%	1.15%	1.16%	0.00%
2012 年 12 月 31 日	-1.78%	0.00%	0.45%	1.15%	1.16%	0.00%
2013 年 1 月 1 日	-1.78%	1.15%	1.00%	0.00%	-1.16%	0.00%
2013 年 12 月 31 日	-1.78%	0.00%	0.45%	1.15%	-1.16%	0.00%

三、基金的费用概算

(一)与基金运作有关的费用

1. 管理费
2. 基金管理人报酬费;
3. 基金托管人报酬费;
4. 销售服务费;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金合同生效前的相关费用;
7. 基金信息披露费用;
8. 按照国家有关规定和合同约定应当由本基金承担的其他费用。

(二)基金资产估值费用、会计核算和支付方式

1. 基金管理人报酬费

基金管理人报酬费以基金资产净值中的1.9%年费率计算，计算方法如下：

$H = H_0 \times 1.9\%$ （H为当日应计提的基金管理费）

H为每日应计提的基金管理费

H₀为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬费每月计算一次，每月支付，由基金托管人于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2. 基金托管人报酬费

基金托管人报酬费按前一日基金资产净值中的0.25%的年费率计算，计算方法如下：

$H = H_0 \times 0.25\%$ （H为当日应计提的基金托管费）

H为每日应计提的基金托管费

H₀为前一日的基金资产净值

基金托管人报酬费每月计算一次，每月支付，由基金托管人于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

若遇法定节假日或公休假日，款项顺延至下一个工作日支付。

3. 其他费用

(三)与基金运作有关的费用说明：基金合同生效后所约定的规定，投资使用超出支出范围，列入当期基金费用。

(四)申购费用

本基金的申购费率为基金申购金额的1%，赎回费率为基金赎回金额的1%。

本基金的赎回费的按照申请和赎回金额未超过100万元的，对单笔赎回金额人民币1000万元以上（含1000万元）的，统一按每笔收，每笔赎回费不超过5000元的情况，费率表如下：

赎回金额M	赎回费率
M<100,000元	1.0%
100,000≤M<1,000,000元	0.5%
M≥1,000,000元	0.25%

对于申购金额在15万元（含）以上申购时应当将申购“本基金金额”分为两部分：第一部分为申购本金，当日申购本金按照T+1日的T+1日的申购价计算，申购费率按照1.5%的费率计算；第二部分为申购费用，申购费率按照0.5%的费率计算。申购费用=申购金额×申购费率/（1+申购费率），申购费用不计入基金资产，由基金份额持有人承担。本基金的申购费率各档均为固定费率在申购本基金时可以选择不同申购费率，且持有待本基金满两年后赎回时，赎回费率随持有天数增加而递减，费率如下：

申购期限	申购费率
申购期限在1天以内	0.50%
申购期限在1天以上2天以内	0.40%
申购期限在2天以上3天以内	0.30%
申购期限在3天以上4天以内	0.20%
申购期限在4天以上5天以内	0.10%
申购期限在5天以上	0

申购金额=申购总金额÷（1+申购费率）×（1+申购费率÷申购费率），申购金额以人民币元为单位，取小数点后两位舍去。
 后申购金额的计算公式为本次申购的基金份额在申购时所占的申购金额，具体表示为：为申购本次赎回的份额的申购金额×赎回的基金份额/本次赎回的基金份额+本次赎回的基金份额在申购时所占的申购金额，具体表示为：为申购本次赎回的份额的申购金额×赎回的基金份额/本次赎回的基金份额+本次赎回的基金份额在申购时所占的申购金额。

2. 管理费用	基本费用的明细表	
	项目或名称	期间费率
（1）基本费用	诉讼费	4.0%
	律师费	4.0%
	资产评估费	4.0%
	审计费	4.0%
（2）其他费用	其他费用	4.0%
	其他费用	4.0%

上海证券报、证券时报

[illegible]