

(上接B126版)

| | | |
|-----|-------------|--|
| 76 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 77 | 中银证券有限责任公司 | 注册地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 办公地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 联系人:丁宇文 电话:(0755)23977888 网址:www.bocib.com |
| 78 | 中国证券基金销售分公司 | 注册地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 办公地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 联系人:李金 电话:(0755)23977888 网址:www.csf.com.cn |
| 79 | 太平资产管理有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 办公地址:广东省深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 联系人:李金 电话:(0755)23977888 网址:www.taiping.com.cn |
| 80 | 安信证券股份有限公司 | 注册地址:深圳市福田区金田路4038号安信大厦18楼 办公地址:深圳市福田区金田路4038号安信大厦18楼 联系人:李金 电话:(0755)23977888 网址:www.axxzq.com |
| 81 | 网信证券股份有限公司 | 注册地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 办公地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 联系人:李金 电话:(0755)23977888 网址:www.winfund.com |
| 82 | 长城证券股份有限公司 | 注册地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 办公地址:深圳市福田区益田路5033号中银大厦901室 联系人:李金 电话:(0755)23977888 网址:www.cgsc.com |
| 83 | 安信证券股份有限公司 | 注册地址:深圳市福田区金田路4038号安信大厦18楼 办公地址:深圳市福田区金田路4038号安信大厦18楼 联系人:李金 电话:(0755)23977888 网址:www.axxzq.com |
| 84 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 85 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 86 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 87 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 88 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 89 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 90 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 91 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 92 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 93 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 94 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 95 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 96 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 97 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 98 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 99 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |
| 100 | 诺安基金销售有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 办公地址:广东省深圳市福田区金田路4308号中心大厦20层2001室(深圳) 联系人:张格 电话:(0755)88421011 网址:www.nuoban.com |

| | | |
|-----|--------------|---|
| 101 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 102 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 103 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 104 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 105 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 106 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 107 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 108 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 109 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 110 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 111 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 112 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 113 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 114 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 115 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 116 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 117 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 118 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 119 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 120 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 121 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 122 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 123 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 124 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 125 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 126 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 127 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 128 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 129 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 130 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 131 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 132 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 133 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 134 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 135 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 136 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 137 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 138 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 139 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 140 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 141 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 142 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 143 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 144 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 145 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |
| 146 | 北方国际基金销售有限公司 | 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 联系人:李金 电话:(010)63000000 网址:www.bfjz.com |

3.2 登记机构
南方基金登记有限公司
住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层
法定代表人:张海波
电话:(0755)82763849
传真:(0755)82763868
联系人:古和鹏

3.3 出具法律意见书的律师事务所
名称:北京市盈科(深圳)律师事务所
注册地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座5层
负责人:姜敏
电话:(0755)36866820
传真:(0755)36866661
经办律师:戴端宁、付强

3.4 审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展银银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:陈燕
经办注册会计师:薛竟、陈燕

4 基金名称

南方平衡配置混合型证券投资基金

5 基金的类型

混合型

根据对宏观经济形势的研究,判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势,积极把握股票、债券等市场发展趋势,重点挖掘企业的核心竞争力,在适度控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

7 基金的投资范围

本基金可投资于股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的30%—80%;债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为20%—70%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,基金持有权证的市场不得超过基金资产净值的3%。

今后如法律法规或监管机构允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

8 基金的投资策略

8.1 投资策略
本基金将通过对资本市场发展趋势的积极把握,实现主动资产配置策略,并且在资产配置基础上,精选出具有核心竞争力的企业进行投资,本基金债券投资将优化流动性管理,分散投资风格为主要目标,同时根据需要进行积极操作,以提高基金收益。

(1)资产配置策略
本基金基于宏观经济情况、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场走势的综合分析,参考经济周期“投资时钟”,确定组合中的股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的比例,力争在适度控制风险的前提下,提高收益。

投资时钟体现的是实体经济运行与投资策略的基本联系。投资时钟经历逆周期、复苏期、过热期和滞涨期,并周而复始,相对应各时期,债券、股票、大宗商品和现金组合的表现依次超过大市。投资时钟可以给我们一个大的资产配置周期标准。如判断经济处于衰退期,则资产配置中以债券为主。如判断经济处于复苏期,则尽量提高权益类资产的投资比例。

(2)股票投资策略

本基金选股主要依托于南方基金公司的研究平台,抓住经济增长的机遇,重点挖掘企业核心竞争力。对于企业的核心竞争力,重点关注以下三方面的情况:

公司管理情况,考察管理层和董事会的治理和激励机制,这些机制是否能确保管理层以公司利益最大化为目标;管理层是否能有效控制上市公司的运营成本,有效提高资本回报率,使资本回报率处于行业的领先水平等。

公司财务状况,考察上市公司的财务信息披露的透明度,并在此基础上,对上市公司资产负债率、现金流量情况进行综合分析,考察其财务稳健状况,以及抵御风险能力及分红派息能力。

公司创新能力,通过上市公司研发投入支出费用占比、科研人员占公司总员工的比例等数据,考察上市公司的制度创新、组织创新、业务创新、产品创新能力,并把把握创新这一公司发展的源动力,挖掘公司发展为相关细分行业新龙头的内在潜力。

对于经济增长的机遇,重点关注以下三方面的情况:国货整合的机遇;国务院国资委主导下的国有资本结构的调整,国有资本有进有退。无论国有资本的进退,都可能给资本市场带来惊喜,或者是短期的现金收益或者是长期的业绩增长。

上市公司回购的机遇:上市公司回购符合国资委关于国有企业通过增持回购股份加强对上市公司控制力的政策导向,有利于促进公司进一步做大做强。上市公司回购价往往高于市场价,对股价形成积极的支撑。

国内外收购兼并的机遇:上市公司通过收购兼并,可以迅速获取关键资源、做大做强。全球经济转型,增加了上市公司收购兼并的机遇,并且视野从国内拓展到国外,为支持公司业绩的长期向好。

本基金将综合分析宏观经济、市场环境、公司管理情况、公司财务状况、公司的创新能力以及产业结构转型的机遇,构造投资组合,并持续地进行组合的调整,争取风险调整后收益的最大化。

(3)债券投资策略
本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债(包括可转换债)等。本基金将在研究利率走势的基础上做出最佳的资产配置及风险控制。根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置。在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

在选择债券品种时,本基金综合考虑国债、金融债、企业债的收益性、流动性和风险性,重点分析债券发行人的资信品质,包括发行机构以及保证机构的偿债能力、财务结构与安全性,并根据对不同期限品种的研究,构造收益率曲线,采用久期模型构造最佳债券期限组合,降低利率风险;对可转债的投资,结合对股票走势的判断,发现其套利机会,利用杠杆原理以及各种衍生工具,增加盈利性、控制风险等等,以争取获得适当的超额收益,提高整体组合收益水平。

(4)权证投资策略
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、空仓保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(5)股指期货投资策略
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运

用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

9 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

10 基金的风险收益特征

该基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金。

11 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。

基金托管人根据本基金合同规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,保证复核数据截至2017年12月31日(未经审计)。本报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(人民币元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|----------|---------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 12,025,913.24 | 49.84 |
| 2 | 债券投资 | 12,025,913.24 | 49.84 |
| 3 | 货币市场工具 | 19,136,091.09 | 78.53 |
| 4 | 买入返售金融资产 | 19,136,091.09 | 78.53 |
| 5 | 银行存款 | — | — |
| 6 | 应收利息 | 20,899,069.89 | 85.24 |
| 7 | 其他资产 | 36,800,877.22 | 147.17 |
| 8 | 负债 | 3,075,531.19 | 12.44 |
| 9 | 合计 | 53,057,281.24 | 213.69 |

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|------------------|---------------|-------------|
| A | 医药生物 | — | — |
| B | 信息技术 | — | — |
| C | 制造业 | 40,790,033.20 | 20.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,110,000.00 | 0.59 |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 交通运输、仓储和邮政业 | — | — |
| G | 房地产业 | 3,250,000.00 | 0.51 |
| H | 金融业 | 3,500,000.00 | 0.53 |
| I | 可选消费 | 3,500,000.00 | 0.53 |
| J | 日常消费 | 3,500,000.00 | 0.53 |
| K | 消费品 | 4,250,000.00 | 0.73 |
| L | 医疗保健 | 4,250,000.00 | 0.73 |
| M | 公用事业 | — | — |
| N | 其他行业 | — | — |
| O | 合计 | 53,057,281.24 | 100.00 |

2.2报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股投资股票

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 | 000042 | 深发展A | 7,272,000.00 | 22.14 | |
| 2 | 000078 | 深圳机场 | 4,000,000.00 | 12.14 | |
| 3 | 000728 | 中国国航 | 2,000,000.00 | 6.07 | |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 10,000,000.00 | 30.43 | |
| 5 | 000021 | 招商局A | 4,250,000.00 | 12.85 | |
| 6 | 000002 | 万科A | 4,250,000.00 | 12.85 | |
| 7 | 000003 | 招商银行 | 4,250,000.00 | 12.85 | |
| 8 | 000012 | 格力电器 | 1,000,000.00 | 3.07 | |
| 9 | 000087 | 长安汽车 | 8,000,000.00 | 24.21 | |
| 10 | 000043 | 深圳燃气 | 2,000,000.00 | 6.07 | |

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|---------------|--------------|
| 1 | 国债 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 地方政府债 | — | — |
| 4 | 中期票据 | 81,200,000.00 | 246.80 |
| | | | |