

## 广发聚瑞股票型证券投资基金招募说明书【更新】摘要

(上接 B67 页)  
一级股票资产:主要根据本基金管理人开发的“发企业价值评估系统,通过考察企业的基本面状况,筛选出基本面良好的股票资产一级股票资产。

二级股票资产:在一级股票资产的基础上,根据主行业配置策略确定的各个主题策略资产进行了进一步选股和持仓调整,形成关于主行业股票资产,通过定性、定量分析,精选出成长力大、盈利能力强、现金流充沛的优质上市公司,构成本基金的二级股票资产。二级股票资产是基金的风险投资策略。

(三)债券投资策略  
在债券投资上,坚持稳健投资的原则,通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现和识别市场机会,把握投资机会,在良好控制利率风险和信用风险的前提下,为投资者获得稳定的收益。具体包括利率预期策略、收益率曲线策略、债券资产类别配置和债券选择。

利率预期:本基金将在利率合理预期的基础上,通过久期管理,稳健地进行债券投资,控制债券投资风险,尤其是在预期利率上升的时,严格控制,保持债券投资组合较高的久期,降低债券投资风险。  
收益率曲线策略:将收益率曲线变动变动的类型以及各种变动对组合收益率变动的影响,具体包括子弹策略、杠铃策略和梯式策略,在此基础上对收益率曲线形状变动的预期为依据建立资产配置组合。

债券配置:本基金将依据收益率及风险特征对债券资产进行分类配置,确定投资组合,并随着市场环境的变化调整投资组合。

债券分析:本基金根据以下因素和特点进行分析:  
(1)国债:重点关注利率水平及国债的供求关系分析;

(2)企业债:重点关注发债企业的信用评级、收益率、债券的流动性以及债券的发行期限等因素;

(3)可转债:本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性,以期通过转换条款获取股票上市带来的增值收益;本基金将重点关注可转债的转换价值,市场价值与其转换价值的溢价,转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等。

(四)权证投资策略  
权证为一种高风险的金融衍生品,其价格波动幅度往往高于其所标的股票,本基金将采用权证估值模型,对权证进行合理定价,并据此进行权证的投资。

如果权证估值模型与市场价格存在较大差异,本基金将采用市场普遍接受的估值方法进行估值,本基金可以在权证估值模型与市场价格存在较大差异时,进行套利操作。

九、业绩比较基准  
本基金业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。  
如果中证全债指数有限,本基金将采用中证全债指数。

如果中证全债指数有限,本基金将采用中证全债指数。  
如果中证全债指数有限,本基金将采用中证全债指数。

十、风险收益特征  
本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

二十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

三十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

四十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

五十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

六十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

七十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十一、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十二、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十三、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十四、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十五、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十六、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十七、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十八、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

八十九、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

九十、基金投资组合报告  
本基金管理人遵规守信,未发现存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

本投资组合报告所载数据截至 2010 年 3 月 31 日,本报告中所有财务数据未经审计。

(一)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 3,548,063,061.89 90.41

其中:股票 3,548,063,061.89 90.41

2 固定收益投资 -- --

其中:债券 -- --

资产支持证券 -- --

3 金融衍生品投资 -- --

4 买入返售金融资产 -- --

5 银行存款和结算备付金合计 370,883,776.16 9.46

6 其他资产 5,306,068.47 0.14

7 合计 3,924,251,912.52 100.00

(二)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) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔 14,609,863.20 0.38

B 采掘业 59,603,430.88 1.55

C 制造业 2,096,566,810.64 54.56

CO 食品饮料 206,857,402.28 5.36

C1 纺织服装、皮毛 -- --

C2 木材、家具 -- --

C3 造纸印刷 14,202,000 0.00

C4 石油、化学、塑胶、塑料 172,500,823.43 4.47

C5 电子 27,104,889.80 0.71

C6 金属、非金属 2,122,520.00 0.06

C7 机械、设备、仪表 1,231,531,506.06 32.06

C8 医药、生物制品 444,044,093.28 11.56

C9 其他制造业 13,381,326.69 0.35

D 电力、煤气及水的生产和供应业 5,543,562.96 0.17

E 建筑业 2,108,896.52 0.06

F 交通运输、仓储业 30,069,387.01 0.78

G 信息技术业 913,843,283.14 23.78

H 批发和零售贸易 283,203,727.11 7.37

I 金融、保险业 1,309,597.03 0.03

J 房地产业 26,739,189.29 0.70

K 社会服务业 -- --

L 传播与文化业 -- --

M 综合类 63,465,933.78 1.65

合计 3,548,063,061.89 92.34

(三)期末基金投资前十名股票明细

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 600690 青岛海尔 13,836,220 289,730,446.60 7.54

2 000063 中兴通讯 5,556,387 236,146,570.65 6.15

3 002024 苏宁电器 10,656,666 200,219,946.35 5.21

4 400027 美的电器 7,172,588 160,962,201.52 4.19

5 000538 云南白药 2,076,811 114,723,090.49 2.99

6 600487 亨通光电 10,415,070 203,273,273.27

7 000044 华夏银行 10,091,572 103,943,191.60 2.71

8 600178 东安动力 6,042,618 94,204,414.62 2.45

9 600084 鹏博士 8,201,616 93,354,074.56 2.43

10 000999 华润三九 3,289,915 79,527,161.64 2.07

(四)按券种分类的债券投资组合  
本报告期末本基金未有债券投资。

(五)债券投资前五名组合  
本报告期末本基金未有债券投资。

(六)投资组合报告附注  
1. 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内本基金投资的前十名股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产构成

序号 项目名称 金额(元)

1 存出保证金 3,751,890.01

2 应收证券清算款 -- --

3 应收利息 -- --

4 应收股利 -- --

5 应收申购款 57,691.98

6 其他应收款 1,685,504.80

7 待摊费用 -- --

8 合计 -- --

9 其他 -- --

10 合计 5,306,068.47

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本报告期末本基金未有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明

6. 本报告期末本基金未主动或被动持有权证投资。

7. 本报告期末本基金未持有资产支持证券投资。

8. 本报告期末本基金未持有股指期货投资。

9. 本报告期末本基金未持有国债期货投资。

10. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

11. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

12. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

13. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

14. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

15. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

16. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

17. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

18. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

19. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

20. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

21. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

22. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

23. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

24. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

25. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

26. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

27. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

28. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

29. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

30. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

31. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

32. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

33. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

34. 本报告期末本基金未持有其他衍生品投资。

本投资组合报告所载数据截至 2010 年 3 月 31 日,本报告中所有财务数据未经审计。

(一)期末基金资产组合情况