

(上接B058版)

传真:0756-82568356
 统一客服电话:4008001001
 公司网址:www.esence.com.cn
 (36) 长城证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
 办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
 法定代表人:黄耀华
 联系人:李春芳
 电话:0756-83616089
 传真:0756-83615667
 客户服务热线:0755-33680000 400-6666-888
 公司网址:www.cqws.com
 (37) 红塔证券股份有限公司
 注册地址:昆明市北京路156号附1号红塔大厦9楼
 办公地址:昆明市北京路156号附1号红塔大厦9楼
 法定代表人:况雨林
 联系人:高国泽
 电话:0871-3577946
 客户服务电话:0871-3577930
 公司网址:www.hongtastock.com
 (38) 瑞银证券有限责任公司
 注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
 法定代表人:刘弘
 联系人:牟冲
 电话:010-5832-8112
 客户服务热线:400-887-8827
 公司网址:www.ubssecurities.com
 (39) 申银万国证券股份有限公司
 注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层~21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元?
 办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层?
 法定代表人:刘戈?
 联系人:张毅?
 电话:0755-82023442
 传真:0755-82026539
 客服电话:400-600-8008/956532
 公司网址:www.china-invs.cn
 (40) 华安证券股份有限公司
 注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
 法定代表人:陈林
 联系人:楼斯佳
 联系电话:021-50122107
 客户咨询电话:400-820-9898
 公司网址:www.cnhsstock.com
 (41) 中航证券有限公司
 注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
 法定代表人:杜航
 联系人:戴鑫
 电话:0791-86769681
 客户服务热线:400-8866-567
 公司网址:www.avicsec.com
 (42) 德邦证券有限责任公司
 住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
 办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
 法定代表人:方加春
 联系人:罗芳
 电话:021-68761616
 传真:021-68767981
 客户服务电话:400-888-8128
 公司网址:www.tebon.com.cn
 (43) 信达证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 法定代表人:张志刚
 联系人:唐静
 电话:010-63081000
 传真:010-63080978
 客服电话:400-900-8899
 公司网址:www.cindasc.com
 (44) 中信证券股份有限公司
 注册地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦
 法定代表人:王东明
 联系人:于长爱
 电话:010-84864818
 传真:010-84865560
 公司网址:www.citicic.com
 (45) 民生证券股份有限公司
 注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
 办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
 法定代表人:岳献春
 客服热线:4006 19 8888
 公司网址:www.msxzq.com
 (46) 五矿证券有限公司
 注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公47层01单元
 办公地址:深圳市福田区金田路4028号经贸中心47-49楼
 法定代表人:张永衡
 联系人:魏君伟
 电话:0756-23302400
 传真:0756-82545600
 客服电话:40018-40028
 公司网址:www.wkzq.com.cn
 (47) 中国国际金融有限公司
 住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
 法定代表人:金立群
 联系人:罗春蓉、武明朋
 联系电话:010-65051166或直接联系各营业部
 公司网址:www.cicc.com.cn
 (48) 国金证券股份有限公司
 注册地址:成都市东城根上街95号
 办公地址:成都市东城根上街95号
 法定代表人:冉云
 联系人姓名:刘一宏
 联系人电话:028-86690700??
 联系人传真:028-86690112
 全国统一服务热线:4006-600109
 地区服务热线:95105111(四川)
 公司网址:www.gkjz.com
 (49) 华龙证券有限责任公司
 注册地址:甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦
 办公地址:甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦21楼
 法定代表人:李晓安
 联系人:李昕田
 电话:0931-8888088
 传真:0931-4890515
 客户服务电话:4006898888、0931-96668
 公司网址:www.hlzqgs.com
 (50) 江海证券有限公司
 注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
 办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
 法定代表人:孙名扬
 联系人:张宇宏
 电话:0451-82336863
 传真:0451-82287211
 客户服务热线:400-666-2288
 公司网址:www.jhzq.com.cn
 (51) 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28层A01、B01(b)单元
 办公地址:上海市肇嘉浜路750号
 法定代表人:洪家荣
 联系人姓名:陈敏
 联系人电话:021-64339000
 联系人传真:021-64333051
 客户服务电话:021-32109999、029-68918888
 公司网址:www.cfsc.com.cn
 (52) 华融证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街8号
 办公地址:北京市西城区金融大街8号
 法定代表人:宋郁刚
 基金业务联系人:黄恒
 联系电话:010-58568235
 传真:010-58568062
 客服电话:010-58568118
 公司网址:www.hrsc.com.cn
 (53) 山西证券股份有限公司
 办公(注册)地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
 法定代表人:侯巍
 联系人:郭刚
 联系电话:0351-8696659
 传真:0351-8696619
 客服电话:400-666-1618、95673
 公司网址:www.jl18.com.cn
 (54) 东兴证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
 办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
 法定代表人:魏庆华
 联系人:汤翔川
 电话:010-66856316
 传真:010-6665
 客服电话:4008888993
 公司网址:www.dxzq.net
 (55) 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华侨国际大厦22-24层
 公司地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
 法定代表人:雷杰
 联系人:郭军瑞
 电话:0731-85832503
 传真:0731-85832214
 客户服务电话:95671
 公司网址:www.founders.com
 (56) 国海证券股份有限公司
 注册地址:广西桂林市辅星路13号
 办公地址:广西南宁市滨湖路46号
 法定代表人:张雅维
 联系人:牛孟宇
 电话:0756-83709360
 传真:0756-83704850
 客户服务电话:95663
 公司网址:www.guohai.com.cn
 (57) 财通证券股份有限公司
 注册地址:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
 办公地址:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
 法定代表人:沈坚宁
 联系人:徐秋青
 电话:0571-87822359
 传真:0571-87918328
 客户服务电话:96336(浙江)、40086-96336(全国)
 公司网址:www.ctsec.com
 (58) 华安证券股份有限公司
 注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
 法定代表人:李工
 联系人:甘霖
 电话:0551-5161821
 传真:0551-5161672

客户服务电话:96518 (安徽)、4008096518 (全国)
 公司网址:www.hazq.com
 (59) 湘财证券股份有限公司
 注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A栋11楼
 办公地点:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A栋11楼
 法定代表人:林俊波
 电话:021-68634510-8620
 传真:021-68865680
 联系人:赵小明
 客服电话:400-888-1551
 公司网址:www.xcsc.com
 (60) 兴业证券股份有限公司
 注册地址:福州市湖东路268号
 办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
 法定代表人:兰荣
 联系人:谢高伟
 电话:021-38665785
 传真:021-38665955
 客服电话:95662
 公司网址:www.xyqz.com.cn
 (61) 深圳众禄基金销售有限公司
 注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
 办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
 法定代表人:薛峰
 联系人:彭锦辉
 联系电话:0755-33227950
 传真:0755-62080798
 客服电话:4006-788-887
 公司网站:www.zlfund.cn 及 www.jmmw.com
 (62) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
 注册地址:上海市金山区廊下镇漕康公路7650号205室
 办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼
 法定代表人:王静波
 联系人:张姚杰
 联系电话:021-38609636
 传真:021-38609777
 客服电话:400-821-5399
 公司网址:www.noah-fund.com
 (63) 北京展恒基金销售有限公司
 住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
 办公地址:北京市朝阳区华严北里2号楼民生大厦6层
 法定代表人:闫振杰
 联系人:林科
 联系电话:010-62020088-8220
 传真:010-62020355
 客服电话:400-888-6661
 公司网站:http://www.mytf.cn
 (64) 上海天天基金销售有限公司
 住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
 办公地址:上海市徐汇区龙田路195号30C座九层
 法定代表人:其实
 联系人:何春燕
 联系电话:021-64509988
 传真:021-64585308
 客服电话:400-1818-188
 公司网站:http://www.1234567.com.cn/
 (65) 杭州数米基金销售有限公司
 住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路82号
 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
 法定代表人:陈柏青
 联系人:张裕
 联系电话:021-60897840
 客服电话:4000-766-123
 公司网站:http://www.fund123.cn
 (66) 深圳市新华德证券投资有限公司
 住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
 办公地址:北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层
 法定代表人:马令海
 联系人:邓洁
 联系电话:010-58321105
 传真:010-58325282
 客服电话:4008050771
 网站:www.jjcom.cn
 (67) 和讯信息科技有限公司
 住所:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 法定代表人:王莉
 联系人:王宝俊
 联系电话:021-20835771
 客服电话:400-900-0022
 网站:http://licaike.hexun.com
 (68) 上海好买基金销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区区中路685弄37号4号楼449室
 办公地址:上海浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
 法定代表人:杨文斌
 联系人:张茹
 开放式基金咨询电话:400-700-9665
 开放式基金业务传真:021-68596916
 公司网站:www.ehowbuy.com
 (69) 浙江同花顺基金销售有限公司
 注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
 办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
 法定代表人:凌骥平
 联系人:陈希
 联系电话:010-57766019
 传真:010-57765199
 客服电话:4007-868-868
 网站:http://www.chtfund.com
 (二) 注册登记机构
 名称:中国证券登记结算有限责任公司
 办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
 法定代表人:周明
 电话:(010) 59378888
 传真:(010) 166210938
 联系人:朱立元
 (三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师
 名称:国浩律师集团(北京)事务所
 注册地址:北京市东城区贡院前大街6号B座5层
 办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
 法定代表人:王卫东
 电话:(010) 65890699
 传真:(010) 65176900
 经办律师:李永飞、王卫东
 (四) 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)
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦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:杨绍信
 电话:(021) 22228898
 传真:(021) 22228800
 经办会计师:江凌、沈兆杰
 联系人:沈兆杰
 五、基金的名称
 本基金名称:长盛中证100指数证券投资基金
 六、基金的类型
 基金类型:契约型开放式
 七、基金的投资目标
 本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年度跟踪误差在4%以下,以实现与基准指数的有效跟踪。
 八、基金的投资方向
 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场公开发行或增发)等、现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。
 九、基金的投资策略与程序
 (一) 投资管理
 本基金认为,我国经济增长将保持持续稳定的发展态势,为指数投资获取长期稳定收益奠定了良好的宏观经济基础。本基金选择了以市值弹性强、流动性高、大盘蓝筹为特色的中证100指数为股票组合的跟踪基准,力求通过被动指数化、分散化的投资方式,通过买入并持有的长期投资策略,获取中国资本市场长期增长的稳定收益,以使投资者能够分享中国经济增长的长期收益。
 (二) 投资策略
 本基金为被动式指数基金,原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪基准指数。
 当期预期成份股发生调整和成份股发生分红、配股、增发等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况(如股权分置改革等)导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和微调,并辅之以金融衍生品投资管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。
 本基金建仓时间为3个月,3个月之后本基金投资组合比例达到基金合同相关规定。
 1、资产配置
 本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨,采用自上而下的两次资产配置策略,首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例,再进一步以复制基准指数的方法,确定不同股票之间的配置比例。
 图中长盛中证100指数基金投资策略体系

本基金原则上采用复制基准指数的方法,按照个股在基准指数中的基准权重构建指数化股票投资组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
 (2) 股票组合构建方法
 本基金原则上采用复制基准指数的方法,按照个股在基准指数中证100指数中的基准权重进行指数化投资组合构建。复制方法将使用下列模型:

$$A_{i,t} = w_{i,t} \times P_{i,t}$$
 这里, $w_{i,t}$: 中证100指数中第i个成份股时刻t在指数中所占的权重
 $A_{i,t}$: 本基金对中证100指数中第i个成份股时刻t的投资额度
 $Volume_{i,t}$: 本基金对中证100指数中所有成份股在t时刻购买的股票数量
 $Netvalue_{i,t}$: 本基金在t时刻投资在股票上的总资产
 $P_{i,t}$: 中证100指数中第i个成份股在t时刻的市场价格
 3、股票组合调整
 (1) 组合调整原则
 本基金指数化基金,基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数之间的高度正相关和跟踪误差最小化。
 (2) 投资组合调整方法
 ①对基准指数的跟踪调整
 A、定期季度调整
 本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的中证100指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。
 中证指数委员会每过半年召开审核会议,根据指数编制规则,使用最后一个交易日收盘后的资料进行成份股审核,决定成份股及其权重。本基金将根据中证100指数成份股及其权重的调整方案,在考虑跟踪误差风险的基础上,对股票投资组合进行相应调整。
 B、不定期调整
 根据指数编制规则,当中证100指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及需调整的股权比例,进行相应调整。
 调整原则原则上定为:中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。
 ②限制制调整
 A、大额赎回调整
 由于本基金开放式基金的特点,当发生大额赎回超过现金保有比例时,本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整,以保证基金正常运作。
 B、流动性调整
 如果因基准指数成份股停牌限制、交易不足等市场流动性因素,使得基金管理人无法依照基准指数权重购买某成份股,本基金管理人将视当时市场情况,综合考虑跟踪误差最小化 and 投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。
 替代股票的选取主要依照行业、规模相似的前提下,计算需替代的基准指数成分股票和替代股票历史收益率之间的相关系数,原则上要求最近一年的日收益率相关系数达到0.8以上,相关系数的计算方法如下

$$r = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}}$$
 这里COV函数表示样本协方差,VAR函数表示样本方差。
 C、如果跟踪指数成份股将会发生调整,本基金管理人将视情况对基金资产进行前瞻性的调整,以更好地跟踪基准指数。
 D、针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将在其规定有期之后的一定时间内卖出。
 E、为使基金收益最大化并能地贴近所跟踪基准指数的收益率,本基金可能使用投资金融衍生产品,以对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。
 F、在其他影响指数复制的情况下,本基金管理人可以根据市场情况,在跟踪误差最小化的条件下,对基金资产进行适当的调整。
 (三) 基金投资决策与程序
 1、投资决策依据
 (1) 国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。
 (2) 宏观经济运行环境、微观企业经营运行态势和证券市场走势。
 2、投资决策机制
 本基金的投资决策机制为:实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。
 (1) 投资决策委员会
 负责制定基金投资方面的整体战略和原则;审定基金季度投资检讨报告;决定基金禁止的投资事项等。
 (2) 基金配置
 负责资产配置与投资组合构建的日常管理。
 3、投资决策程序
 (1) 金融工程小组运用风险监控模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行跟踪测算,并提供数量化风险分析报告;研究部对基准指数成份股中基本面恶化的企业情况提供及时的风险分析报告;市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告,供基金经理决策参考。
 (2) 投资决策委员会定期召开会议,依据上述报告对资产配置提出指导性意见;如遇重大事项,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。
 (3) 基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告,在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下,采取适当的方法、控制与指数的偏差风险、流动性风险、降低交易成本。
 (4) 交易所依据基金经理的指令,制定交易策略,通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖。
 (5) 风险控制委员会根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议;风险管理小组对投资组合的偏离度风险进行实时跟踪和评估,并对风险隐患提出预警;监察稽核部对指数化投资组合的执行流程进行实时监控;基金经理依据基金申购和赎回的情况控制指数化投资组合的流动性风险。
 4、投资评价
 在正常市场情况下,本基金净值收益率与业绩衡量基准之间年度跟踪误差不超过4%。如因指数编制错误或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差扩大,跟踪误差进一步扩大的。
 (四) 投资管理
 1、基金财产不得用于下列投资或者活动
 (1) 承销证券
 (2) 向他人贷款或者提供担保;
 (3) 从事承担无限责任的投资;
 (4) 买卖其他基金资产,但是国务院另有规定的除外;
 (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
 (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券;
 (7) 从事内幕交易操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
 (8) 依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动;
 2、本基金投资组合比例将符合以下限制
 (1) 基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过该基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
 (2) 股票、债券和现金的投资比例不得违反本基金合同有关投资范围、投资比例、投资比例等内容的约定;
 (3) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。
 基金的投资组合应在基金合同生效之日起3个月内达到规定的标准。
 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。
 十、基金业绩比较标准
 中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
 十一、基金的风险收益特征
 本基金为被动式投资跟踪指数基金,风险中等,将获得证券市场平均收益。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略,在投资管理上将最大的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险,本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的跟踪误差在限定的范围内。
 十二、基金的投资组合报告
 本投资组合报告所载数据截至2014年3月31日,本报告财务资料未经会计师事务所审计。
 1. 2014年3月31日基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	573,582,618.97	94.31
	其中:股票	573,582,618.97	94.31
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:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	34,232,335.59	5.63
7	其他资产	391,557.21	0.06
8	合计	608,206,511.77	100.00

 2. 2014年3月31日按行业分类的股票投资组合
 (1) 指数化投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	40,651,599.86	6.70
C	制造业	167,179,439.42	26.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,341,841.53	2.69
E	建筑业	20,761,394.57	3.42
F	批发和零售业	5,936,757.84	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	14,987,532.92	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,794,848.12	1.45
J	金融业	272,790,176.13	44.94
K	房地产业	23,659,809.39	3.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,314,424.04	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	4,564,794.15	0.75
	合计	573,582,618.97	94.49

 (2) 非指数化投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

 3. (1) 2014年3月31日指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600036	招商银行	3,716,349	36,494,547.18	6.01
2	600016	民生银行	4,233,700	32,430,142.00	5.34
3	601318	中国平安	779,257	29,268,892.92	4.82
4	601166	兴业银行	2,448,649	21,407,138.48	3.53
5	600000	浦发银行	2,201,179	21,395,459.88	3.52
6	000002	万科A	1,987,719	16,080,646.71	2.65
7	600837	海通证券	1,615,888	14,930,805.12	2.46
8	600030	中信证券	1,367,309	14,397,763.77	2.37
9	601328	交通银行	3,780,587	14,290,618.86	2.35
10	000651	格力电器	476,720	13,348,160.00	2.20

 (2) 2014年3月31日积极投资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
 注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。
 4. 2014年3月31日按券种分类的债券投资组合:
 注:本基金本报告期末未持有债券。
 5. 2014年3月31日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细
 注:本基金本报告期末未持有债券。
 6. 2014年3月31日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
 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
 7. 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
 注:本基金本报告期末未持有贵金属。
 8. 2014年3月31日按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
 注:本基金本报告期末未持有权证。
 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 本基金报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。
 (2) 本基金股指期货投资的投资政策
 本基金基金合同中未约定股指期货投资的投资政策。
 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 (1) 本期国债期货投资政策
 本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。
 (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。
 (3) 本期国债期货投资的投资政策
 本基金报告期内未进行国债期货投资。
 11. 投资组合报告附注
 (1)
 根据中国平安股份有限公司2013年5月22日发布的《关于平安证券收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》显示,中国平安集团的控股子公司平安证券收到证监会的处罚通知书,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其工作人员方福生开发上市场项目的业务收入人民币2,556万元,并处以人民币75,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。
 本基金做出以下说明:
 1. 中国平安是中国最优秀的综合金融公司,寿险业务最具竞争力,基本面良好。本公司研究员一直保持跟踪,并有相关的跟踪报告。
 2. 基于相关研究,本基金判断,旗下平安证券受到处罚,对中国平安的影响较小。因为证券业务板块在平安集团内的地位较低,平安证券对中国平安的收入贡献1%,利润贡献不足5%。
 3. 今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其风险控制机制和经营情况。
 根据海通证券2013年4月24日发布的《关于收到上海证监局行政监管措施决定书(公告)》显示,海通证券受到上海证监局采取的行政监管措施。上海证监局发现海通证券发行的一海通银行“系列”产品发行监管规定未明确创新产品,但发行时未按照《证券公司(业务)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。对此,上海证监局对海通证券采取了责令改正的监管措施。
 本基金做出以下说明:
 1. 海通证券在行业内具有很强的竞争力,资本实力雄厚,业务发展良好。
 2. 基于相关研究,本基金判断此次处罚监管措施对海通证券的经营业绩造成的影响非常小,不影响公司价值。
 3. 今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其风险控制机制和经营情况。
 除上述事项外,本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
 (2) 声明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
 本基金投资的前十名股票,均属于基金合同规定的备选股票库。
 (3) 2014年3月31日其他资产构成

序号
