

(上接B053版)

网址: www.q1zq.com.cn
(53)大通证券股份有限公司
住所: 辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大连期货大厦38、39层
法定代表人: 张智河
联系人: 谢立军
电话: 0411—39673202
客服电话: 4008—169—169
网址: www.daton.com.cn
(54)民生证券股份有限公司
住所: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16—18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: 余政
联系人: 赵明
电话: 010—85127622
传真: 010—85127917
客服电话: 4006198888
公司网址: www.msxzq.com
(55)世纪证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
法定代表人: 姜味军
联系人: 袁震
电话: 0755—83199599
传真: 0755—83199545
客服电话: 0755—83199599
网站: www.csco.com.cn
(56)山西证券股份有限公司
住所: 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: 郭耀
电话: 0351—8686659
传真: 0351—8686619
客服电话: 400—666—161895573
公司网址: www.1618.com.cn
(57)国联证券股份有限公司
注册地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
法定代表人: 姚志勇
电话: 0510—82831662
传真: 0510—82830162
联系人: 沈刚
客服电话: 95570
网站: www.glsc.com.cn
(58)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
办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人: 余磊
联系人: 崔成
电话: 027—87610052
传真: 027—87618863
客户服务电话: 4008005000
公司网站: www.tfzq.com
(59)国都证券股份有限公司
住所: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
10层
法定代表人: 常喆
联系人: 黄静
电话: 010—84183333
客服电话: 400—818—8118
公司网址: www.guodu.com
(60)中山证券有限责任公司
住所: 深圳市南山区科技中一路西华强高新新发展大楼7层、8层
法定代表人: 黄扬录
联系人: 罗艺琳
电话: 0755—82570586
客服电话: 400—102—2011
公司网址: www.zszq.com
(61)中国民族证券有限责任公司
注册地址: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F—43F
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F—43F
法定代表人: 赵大建
联系人: 李薇
电话: 010—59355491
传真: 010—66553791
客服电话: 400—889—5618
公司网址: www.es618.com
(62)华龙证券股份有限公司
办公地址: 兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法定代表人: 李晓安
联系人: 刘鹏怡
电话: 0931—4890208
客服电话: 09368
公司网址: www.hljzq.com
(63)日信证券有限责任公司
注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人: 孔佑杰
联系人: 陈文彬
电话: 010—83991737
传真: 010—66412516
客户服务电话: 400—660—9839
公司网站: www.rxzq.com.cn
(64)华宝证券有限责任公司
住所: 上海世纪大道100号环球金融中心57楼
办公地址: 上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57楼
法定代表人: 陈林
联系人: 汪明丽
电话: 021—68778075
客服电话: 400—820—9898
网址: www.cnhbstock.com
(65)东吴证券股份有限公司
注册地址: 苏州工业园区星阳街5号
办公地址: 苏州工业园区星阳街5号
法定代表人: 范力
联系人: 方晓丹
电话: 0512—65581136
客服电话: 400—860—1555
公司网址: www.dwzq.com.cn
(66)国海证券股份有限公司
住所: 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: 张雅锋
联系人: 牛孟宇
电话: 0755—83709350
客服电话: 95563
公司网址: www.gzhq.com.cn
(67)西南证券股份有限公司
住所: 重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人: 余维佳
联系人: 张煜
电话: 023—63786633
客服电话: 4008096096
公司网址: www.swsc.com.cn
(68)国金证券股份有限公司
注册地址: 成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人: 冉云
联系电话: 028—86690057
传真: 028—86690126
联系人: 刘婧漪
客户服务电话: 400—660—0109
网站: www.gjzq.com.cn
(69)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1218号1栋202室
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: 朱晓晓
电话: 021—60897840
传真: 0571—26697013
客服电话: 4000—766—123
公司网址: www.fund123.cn
(70)北京展恒基金销售有限公司
住所: 安苑路11号院邮编新闻大厦2层
法定代表人: 闫振杰
联系人: 翟飞飞
电话: 010—52703350转6006
传真: 010—62020355
客服电话: 400—888—6661
公司网址: www.mylfund.com
(71)上海好买基金销售有限公司
住所: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
法定代表人: 杨文斌
联系人: 张茹
电话: 021—20613999
传真: 021—68596916

客服电话: 400—700—9665
公司网址: www.ehowbuy.com
(72)深圳众禄基金销售股份有限公司
住所: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼6楼
法定代表人: 薛峰
联系人: 童彩平
电话: 0755—33227950
传真: 0755—33227951
客服电话: 4006—788—887
公司网址: www.jmmw.com, www.zlfund.cn
(73)和讯信息科技有限公司
办公地址: 北京市朝阳区外大街22号泛利大厦10层
法定代表人: 王利
联系人: 吴卫东
电话: 021—20835789
传真: 021—20835885
客服电话: 400—920—0022
公司网址: licaikae.hexun.com
(74)上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址: 上海市浦东新区浦东大道655号裕景国际B座16层
法定代表人: 张跃伟
联系人: 单丙辉
电话: 021—20691832
传真: 021—20691861
客服电话: 400—820—2899
公司网站: www.erichfund.com
(75)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2层
法定代表人: 其实
联系人: 潘世友
电话: 021—54509988
传真: 021—64395308
客服电话: 400—1818—188
公司网址: www.1234567.com.cn
(76)上海利得基金销售有限公司
办公地址: 上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
法定代表人: 盛大
联系人: 叶志杰
电话: 021—50683533
传真: 021—50683633
(77)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所: 上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12层
法定代表人: 汪静波
联系人: 谢远敏
电话: 021—38509639
传真: 021—38509777
客服电话: 400—821—5399
公司网址: www.noah—fund.com
(78)万银财富(北京)基金销售有限公司
住所: 北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人: 李招弟
联系人: 张刚
电话: 010—59497363
传真: 010—59393074
客服电话: 400—081—6655
公司网址: www.wy—fund.com
(79)中期资产管理有限公
住所: 北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人: 路瑶
联系电话: (010)65807865
传真: (010)65807864
联系人: 侯英建
客户服务电话: 010—65807609
网站: www.cicofund.com
(80)北京增财基金销售有限公司
住所: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人: 罗细安
联系电话: (010)67000988
传真: (010)67000988—6000
联系人: 孙晋峰
客户服务电话: 400—001—8811
网站: www.zvcvc.com.cn
(81)北京钱景财富投资管理有限公司
住所: 北京市海淀区上地楼街6号1幢9层1008—1012
法定代表人: 赵荣春
联系人: 高静
电话: 010—59158281
传真: 010—57569671
客服电话: 400—678—5095
公司网址: www.qianjing.com
(82)一路财富(北京)信息科技有限公司
住所: 北京市西城区阜成门内大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人: 吴雪秀
联系人: 段京璐
电话: 010—88312877
传真: 010—88312099
客服电话: 400—001—1566
公司网址: www.yilucaifu.com
(83)中国国际期货有限公司
住所: 北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址: 北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人: 王兵
联系电话: 010—59539864
传真: 010—59539806
联系人: 赵森
客户服务电话: 95162, 400—8888—160
网站: www.cicfo.net
(84)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
住所: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法定代表人: 沈伟彬
联系人: 程刚
电话: 010—52857113
传真: 010—85894285
客服电话: 400—6099—200
公司网站: www.yixinfund.com
(85)上海联泰资产管理有限公司
办公地址: 上海市浦东新区金钟路658号2号楼B座6楼
法定代表人: 燕斌
联系电话: 021—51507071
传真: 021—62990063
联系人: 凌秋艳
客户服务电话: 4000—466—788
网站: www.66zichan.com
(86)上海汇付金融服务有限公司
办公地址: 上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人: 冯修敏
联系电话: 021—33323999—8318
传真: 021—33323830
联系人: 周丹
客户服务电话: 400—820—2819
网站: fund.bundtrade.com
(87)泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
法定代表人: 林翠
客户服务电话: 400—6411—999
网站: www.taichengcaifu.com
(88)深圳市新华德证券投资咨询有限公司
办公地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
20层
法定代表人: 杨懿
客户服务电话: 400—166—1188
网站: http://81jrj.com.cn
(二)注册登记机构
名称: 华富基金管理有限公司
联系人: 潘伟
电话: 021—68868996
传真: 021—68887997
其他同上
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称: 上海市通力律师事务所
住所: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人: 韩凯
电话: 021—31358666
传真: 021—31358600
联系人: 黎明
经办律师: 吕红、黎明
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称: 天健会计师事务所(特殊普通合伙)
主要经营场所: 杭州市西溪路128号9楼?
执行事务合伙人: 胡少先
电话: 021—62281910
传真: 021—62286290
联系人: 曹小勤
经办注册会计师: 曹小勤、林磊
华富竞争力优选混合型证券投资基金
契约型开放式
六、基金的投资目标

本基金采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略,对基金投资风险控制遵循“事前防范、事中控制、事后评估”的风险控制程序,运用华富PMC选股系统,力求实现基金资产的中长期稳定增值。

七、基金的投资方向

股票投资方面,本基金管理人相信,企业的基本面变化是驱动股价的最主要因素,而竞争优势又将决定企业基本面的变化。本基金管理人将运用华富PMC选股系统,对行业及企业的竞争格局进行系统的分析和实地调研,投资于行业内具有竞争力且估值合理的上市公司,力争将中国经济增长最大限度地转换为基金资产的长期稳定增值。

在债券投资方面,本基金将通过定量分析方法,从市场失衡中把握投资机会,力争实现稳定回报。

八、基金的投资策略

(1) 国家有关法律法规和基金合同的有关规定。依法决策是基金进行投资的前提;

(2) 宏观经济发展环境、微观企业经济运行态势和证券市场走势。这是基金投资决策的基础;

(3) 投资对象收益与风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策,是基金维护投资人利益的重要保障。

2、决策程序

(1) 研究发展部通过自身研究及借助外部研究机构形成有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据,并通过华富PMC选股系统构建及维护基金股票池;

(2) 投资决策委员会定期召开会议,并依据上述报告对本基金的资产配置比例等提出指导性意见;如遇重大事件,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策;

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断,形成本基金投资计划,包括资产配置、行业配置、股票/债券选择,以及买卖时机;

(4) 交易室依据基金经理的指令,制定交易策略,统一执行证券投资组合计划,进行交易品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和执行下单权严格分离的规定;

(5) 风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施,监察部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制,基金经理依据基金份额申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险;

(6) 基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

3、投资组合管理的方法 and 标准

(1) 资产配置

在资产配置方面,采用自上而下的方法,确定各类资产的权重。在长期内,本基金将通过以宏观经济分析为重点的资产类别风险预测框架来调整资产配置,关键因素为宏观经济预测、利率水平判断、国家的经济政策等;短期内,本基金将基于经济结构调整过程中政策、法规的相关变化,通过及时把握来调整资产配置。

此外,在资产配置的动态调整上,基金管理人将持续关注多个市场的联动关系,包括国内与国际市场之间,国内股票、债券、期货等市场之间两个层次上的互动分析。力争从多维的角度对单个市场风险收益状况进行衡量,从而提高对单个市场走势判断准确的概率。

(2) 行业及股票选择

该系统首先通过财务指标筛选,构建初选股票池,然后通过运用定量及定性分析相结合的方法,对初选股票池中的个股从所处行业、公司基本面及估值三方面进行评价,并根据综合评价的结果对个股进行排序,形成精选股票池。为基金投资组合的构建提供科学精确的支持。

本基金行业及股票选择的流程如下图:

1) 初选股票池的建立

本基金管理人认为,在行业内具有竞争力而估值适中的企业具有以下几个特点:

首先,主营业务相对突出;

其次,现金流状况相对较好;

第三,盈利能力相对可观;

第四,估值的安全边际相对较高。

按照以上四个标准本基金管理人设计了四个指标进行首次筛选(见下表),并根据首次筛选的结果初步构建初选池。

表 初选股票池的筛选指标

指标	指标数值
主营业务收入规模	连续两年分布于行业前30%的区域
经营产生的现金流/净利润	连续两年分布于行业前30%的区域
净资产收益率	连续两年分布于行业前30%的区域
市盈率	当期数值分布于行业前30%的区域

本基金管理人研究发展部组建由研究发展部经理和分管行业研究员组成的股票池小组,负责股票池的构建与维护工作。在股票初选池的维护中,以财务指标为基准,结合研究人员的实地调研情况进行及时调整,以保证公司基本面的变动直接反映为股票池的调整;

a、股票池小组在深入调研的基础上,对上市公司财务指标的真实性进行鉴别,将财务指标虚报的上市公司剔除出初选股票池;

b、股票池小组在深入调研的基础上,对公司基本面已经明显转好,但财务指标尚未反映公司基本面改观,从而未能通过财务指标初选的上市公司,在经研究发展部股票池小组讨论后加入初选股票池;

在初选股票池的股票构成中,通过财务指标初选产生的股票不得低于股票池股票总量的70%,股票池小组对未通过财务指标初选,但经研究调整后进入股票池的股票比例最大不得超过30%,力求最大限度地做到投资程序的严密性与灵活性的有机结合。

(2) 华富PMC选股系统辅助下的行业评价

a、华富PMC选股系统的行业分类

华富PMC选股系统在行业分类上参考天相数据库系统的行业分类方法对上市公司所处的行业进行划分,共分为33个行业(见下表)。

表 华富PMC选股系统行业分类

名称	流通市值(亿元)	名称	流通市值(亿元)
交通运输	88857	石化	29454
电力	63056	有色	26636
机械	10903	计算机硬件	26023
钢铁	65413	元器件	2533
医药	67636	建筑业	21113
服装	63829	通信设备	21137
汽车及配件	61713	软件与服务	16719
金融	59096	石油	15949
化工	16216	化纤	12865
家电	53403	电气设备	20956
通信	44567	贸易	14251
食品	37791	供水供气	14252
纺织服装	36311	传媒	12379
商业	32976	煤炭	1735
农业	29559	通信设备	10376
建材	28639	日用化工	3621
综合	31754		

注:依据2004年6月30日的流通市值计算。

b、行业评价的总体思路

基金管理人对于初选股票池中个股所处行业的评价是在华富PMC选股系统的辅助下完成。华富PMC选股系统通过把握经济结构及消费结构变迁的趋势,在行业周期性分析及行业景气度分析的基础上,结合对行业竞争结构的评价,形成对行业的总体评价。

d、行业景气因素

在关注经济结构及消费结构变化的同时,华富PMC选股系统同时加强对行业基本面的研判,跟踪各行业发展动态,运用华富行业景气评价方法和行业指数对基本面的敏感程度进行分析,以及数据支持系统,对行业投资机会进行把握。

e、行业竞争结构因素

华富PMC选股系统的行业竞争分析针对决定产业竞争环境的五种合力进行评级,包括产业内既有厂商竞争、潜在进入者威胁、替代品威胁、供应商的议价实力、客户的议价实力。从产业竞争结构的角度解析产业的盈利能力。

图 决定产业竞争环境的五种合力

图 华富PMC行业评价流程

c、行业评价的出发点

多年以来,市场化改革、工业化、城市化、农业改革深化及人口结构的变化这五大推动力持续推动着中国经济的高速增长。本基金管理人认为,这五股合力在未来多年仍将继续发挥其作用。并在较长的时间对相关的行业及上市公司产生重大影响。因此,关注这五股合力对经济结构及消费结构的影响,是基金管理人进行行业评价的出发点。

(3) 其他资产配置:

对于债券资产的选择,本基金将以价值分析为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合投资,并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理;

在类属配置层次,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的权重;

在债券选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,合理运用利率预期、久期管理、换券利差交易与凸性交易等投资管理策略,实施积极主动的债券投资管理。

九、基金的业绩比较标准

本基金股票投资部分的业绩比较基准是中信标普300指数,债券投资部分的业绩比较基准是中信标普全债指数;

基金整体业绩比较基准=60%×中信标普300指数+35%×中信标普全债指数+5%×同业存款利率。

十、基金的风险收益特征

本基金属于中等风险的混合型基金,其风险收益特征从长期平均来看,介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间。

十一、基金的投资组合报告

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2015年6月30日,报告中所列财务数据未经审计。

1、报告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	1,300,701,417.69	87.05
其中:股票	1,300,701,417.69	87.05	
2	固定收益投资	85,141,441.22	6.78
其中:债券	85,141,441.22	6.78	
	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	66,636,392.34	5.31
7	其他资产	3,260,639.71	0.26
8	合计	1,255,819,290.00	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)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	-	-
B	采矿业	31,365,000.00	2.63
C	制造业	923,596,463.43	77.35
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	248,330.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	126,090.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,870.00	0.01
J	金融业	10,248,807.30	0.86
K	房地产业	29,780,000.00	2.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,290.00	0.00
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	105,314,566.96	8.82
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,100,781,417.69	92.19

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	002018	华信国际	4,460,500	146,482,820.00	12.27
2	000887	中顺股份	4,389,929	114,222,156.84	9.57
3	600416	湘电股份	6,008,370	107,860,241.50	9.03
4	600150	中国船舶	1,559,921	80,335,931.50	6.73
5	002030	达安基因	1,691,967	74,963,696.10	6.28
6	300016	北陆药业	1,650,729	70,887,025.59	5.94
7	600763	通策医疗	800,000	67,784,000.00	5.68
8	300038	梅泰诺	1,299,911	58,469,996.78	4.90
9	002022	科华生物	1,309,870	55,679,054.20	4.68
10	600685	南汇集团	999,960	57,737,850.40	4.50

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,979,000.00	2.51
其中:政策性金融债	29,979,000.00	2.51	
4	企业债券	39,769,400.00	3.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,403,041.22	1.29
8	其他	-	-
9	合计	85,141,441.22	7.13

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122288	13农发13	380,000	39,769,400.00	3.33
2	150413	15农发13	300,000	29,979,000.00	2.51
3	113008	电气转债	50,000	9,062,000.00	0.76
4	128009	歌尔转债	39,999	6,351,041.22	0.53

6、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。

7、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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末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

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

本报告期内本基金未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	499,220.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	241.50
4	应收利息	1,281,291.78
5	应收申购款	1,480,127.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,260,639.71

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	6,351,041.22	0.53

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限期间的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	146,482,820.00	12.27	长期停牌
2	000887	中顺股份	114,222,156.84	9.57	长期停牌
3	600416	湘电股份	107,860,241.50	9.03	长期停牌
4	600763	通策医疗	67,784,000.00	5.68	长期停牌

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	净值增长率(2)	业绩比较基准收益率(
----	----------	----------	------------