

上接B031版

注册地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：董永成
联系人：汪晖
电话：0411-39673301
传真：0411-39673219
客户服务电话：4008-169-169
网址：www.estock.com.cn
66. 方正证券股份有限公司
注册地址：长沙市长麓区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：长沙市长麓区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
客户服务电话：96571
网址：www.founderscc.com
67. 国海证券股份有限公司
注册地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅峰
联系人：吴斌
联系电话：0755-83707413
传真：0755-83700205
客户服务电话：400888100（全国）、96563（广西）
网址：www.gdzzq.com.cn
68. 财达证券有限责任公司
注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23层
办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23层
法定代表人：翟建强
客户服务电话：4006128888
网址：www.s10000.com
69. 华安证券股份有限公司
注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人：李工
客户服务电话：96518
网址：www.hazq.com
70. 天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座8层
法定代表人：林义相
电话：010-66045529
传真：010-66045518
联系人：尹伶
客户服务电话：010-66045678
天相投资顾问网-网址：http://www.txsc.com
天相基金网-网址：http://tj.jin.txsc.com
71. 招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82960141
联系人：黄健
客户服务电话：95565、0755-26951111
网址：www.newone.com.cn
72. 南京证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人：张华成
电话：025-83364032
传真：025-83320066
联系人：胥春阳
客户服务电话：400-828-5888
网址：www.njzq.com.cn
73. 华福证券有限责任公司（原广发华福证券有限公司）
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张璐
联系电话：0591-87383623
业务传真：0591-87383610
客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）。
网址：www.hfzq.com.cn
74. 华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-84457777-950
传真：025-84579763
联系人：李金龙
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
75. 华泰联合证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道4011号香港中旅大厦25层
办公地址：深圳市福田区深南大道4011号香港中旅大厦5层、17层、18层、24层、26层
法定代表人：马明贤
电话：0755-82492000
传真：0755-82492062
联系人：盛宗波
客户服务电话：400-8888-555
网址：www.lhzq.com
76. 德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市福州路510号南半幢9楼
办公地址：上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼
法定代表人：姚文平
电话：021-68761616
传真：021-68767981
联系人：罗芳
客户服务电话：400-8888-128
网址：www.tebon.com.cn
77. 国联证券股份有限公司
注册地址：无锡市县前东街168号
办公地址：无锡市县前东街168号6楼7楼
法定代表人：雷建峰
电话：0510-82316622
传真：0510-8230162
联系人：袁丽萍
客户服务电话：400-888-5288、0510-82588168
网址：www.glsc.com.cn
78. 中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人：王东明
电话：010-84863893
传真：010-84865560
联系人：陈忠
客户服务电话：010-84588888
网址：www.cscitic.com.cn
79. 西南证券股份有限公司
注册地址：渝中区临江路2号合景国际大厦A幢
办公地址：重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢22层
法定代表人：王殊林
客户服务电话：4008096096
网址：www.swsc.com.cn
80. 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）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：崔海峰
客户服务电话：4008-888-993
网址：www.dxzq.net
81. 中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：菅明军
基金业务对外联系人：程月艳 耿晓
联系电话：0371-69099882
传真：0371-65658599
客户服务电话：0371-967218；400-813-9666
网址：www.ccnew.com
82. 国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街96号
办公地址：成都市东城根上街96号成证大厦16楼
法定代表人：冉云
联系电话：028-86690021 86690206
传真：028-86696681
客户服务电话：400-600109
网址：www.gjzq.com.cn
83. 华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市陕西街239号
办公地址：四川省成都市陕西街239号
法定代表人：杨炯洋
客户服务电话：400-8888-818
网址：www.hx168.com.cn
84. 中信证券（山东）有限责任公司（原中信万通证券有限责任公司）
注册地址：青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼
办公地址：青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼
基金业务联系人：吴忠超
电话：0532-85022365
传真：0532-85022605
客户服务电话：96548
公司网址：www.citicssd.com
85. 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路156号附1号
办公地址：云南省昆明市北京路156号附1号红塔大厦7-11楼
法定代表人：况雨林
客户服务电话：0871-3577930
网址：www.hongtaizq.com
86. 第一创业证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人：刘学民
客户服务电话：400-888-1888
网址：www.firstcapital.com.cn
87. 国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市西湖区北京西路88号（信信国际金融中心）
办公地址：江西省南昌市西湖区北京西路88号（信信国际金融中心）
法定代表人：曾小春
客户服务电话：400-822-2111
网址：www.gsstock.com
88. 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法人代表：马令海
客户服务电话：400-850-7771
网址：8.jrj.com.cn
89. 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦大道655号裕景国际B座16层
法定代表人：张俊杰
联系人：敖静
电话：021-58788678-8201
传真：021-58787698
客户服务电话：400-089-1289
网址：www.erichfund.com
90. 上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路196号30楼10楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
91. 北京增财基金销售有限公司
注册地址：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1208-1209室
法定代表人：罗纪安
联系人：孙晋峰
电话：010-67000892
传真：010-68068927
客户服务电话：400-001-8811
网址：www.zcfund.com
92. 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海曙路2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
电话：021-60897869
传真：0571-26698533
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.dumidum.com
93. 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1J单
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1J单
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客户服务电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn；www.jimw.com
94. 上海好实基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦大道1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张丽
电话：021-58870011
传真：021-69596916
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com
95. 和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区大望路22号泛利大厦10层
法定代表人：王利
客户服务电话：400-920-0022
传真：021-20835879
网址：licaike.hexun.com
96. 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：吴顺平
联系电话：0571-88911818
传真：0571-86900423
客户服务电话：0571-88920897、4008-773-772
网址：www.5ifund.com
97. 深圳腾元基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼407室
办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼407室
法定代表人：卓熹熹
客户服务电话：4006-877-899
网址：www.tenyuanfund.com
98. 北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市顺义区沙峪镇安富街6号
法定代表人：闫振杰
客户服务电话：400-888-6661
网址：www.myfund.com
99. 一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
法定代表人：吴雪涛
客户服务电话：400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com
100. 北京景顺财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人：赵庆春
客户服务电话：400-678-5085
网址：www.niuji.net
101. 北京晨讯天下投资管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区金田路735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座202层
法定代表人：蒋辉
客户服务电话：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com.cn
102. 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼151809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
客户服务电话：400 6099 200
网址：www.yixinfund.com
联系人：程刚
电话：010-52856713
103. 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A座303
法定代表人：王岩
客户服务电话：400-819-8869
网址：www.tdyfund.com
104. 中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人：徐福耀
客户服务电话：010-68998820
联系人：陈望
电话：010-68998820-8306
网址：www.bzfunds.com
105. 上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人：张磊
联系人：周丹
电话：021-33323999
传真：021-33323993
客户服务电话：400-828-2819
手机客户端：天天基金
网址：fund.bundtrade.com
106. 上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈海斌
联系人：赵茜然
联系电话：021-50569533
传真：021-50569533
客户服务电话：400-005-6355
网址：www.leaddbank.com
107. 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦1幢10楼1001室
法定代表人：陈静
联系人：周立祺
联系人电话：0571-88337888
客户服务电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com
108. 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
客服电话：4008219031
公司网址：www.lufund.com
109. 大同证券经纪有限责任公司
注册地址：山西省大同市迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
客户服务电话：4007121212
网址：www.dtsbc.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。
（三）注册服务机构
名称：诺安基金管理有限公司
住所：深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层
法定代表人：秦维丹
电话：0755-83026688
传真：0755-83026677
（四）出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称：北京颐合中鸿律师事务所（即北京市颐合律师事务所）
住所：北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1910室
法定代表人：负责人：付朝晖
电话：010-65178866 传真：010-65180276
经办律师：虞发芳、高平功
（五）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市延安东路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人：卢伯珉
电话：021-61418808
传真：021-63350003
联系人：余志亮
经办注册会计师：洪悦明、王明静
四、基金名称
诺安主题精选混合型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式基金

本基金通过精选主题，稳健投资，力图在不同的市场环境下降可突破局限，在长期内获得超过比较基准的超额收益。
七、基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
如法律法规或监管机构以后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。
基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的60%-95%，其中不低于90%的股票资产投资于与基金管理人构建的备选主题库相关联的个股；债券等固定收益类资产占基金资产的0%-40%；权证占基金资产净值的0%-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的95%。
八、基金的投资策略
1.资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。
在具体的大类资产配置过程中，本基金拟采用在市场中验证有效的LEP模型，根据市场流动性、经济发展状况、国家政策倾向以及市场整体估值水平的状况，判断类别资产的配置比例和时机，从而动态优化资产组合，以达到建立一个在承受一定风险前提下可获取较高收益的组合的目标。
2.股票投资策略方面，本基金的股票投资策略由构建备选主题库、筛选主题、精选个股和构建组合四个步骤组成。
（1）备选主题的构建
本基金将从宏观经济、政策制度、行业特征、特殊事件等角度进行深入分析，精选主题，建立备选主题库，并且积极调整主题库，至少每季度更新一次主题库。
1）主题发掘
我们将从定性和定量的角度，对宏观经济、政策制度、行业特征、特殊事件等因素进行深入分析，从而力求完备地、前瞻性地发掘可应用于市场中的投资主题，构建备选主题库。
①宏观经济
宏观经济角度主要是从宏观经济发展状况、宏观经济的结构性特征、经济周期以及投资者对宏观经济的预期等角度进行观察和研究。
②政策制度
中国经济在发展阶段上呈现出较明显的政策驱动性特征，受益于财政刺激等利好政策的主题将获得超过社会平均水平的增长速度，我们以政策制度倾向为标准发掘该类主题。
③行业特征
行业特征包括行业生命周期、行业竞争强度和行业发展趋势等方面的特征。例如，在产业资本利益的驱动下，并构建组成为某些行业的必然发展趋势，比较突出的，是在争夺资源产品定价权的动机下，资源型产业的并购重组提速的趋势较为明显，而并购重组能给上市公司带来价值增值型投资主题，从而具备了主题性的投资意义。
④特殊事件
市场上还有一些主题存在时间相对较短，其驱动因素可能仅仅是某个事件。发掘和研究事件性的主题，有助于把握较为短期的投资机会。
除以上观察角度外，随着时间的推移，可能会出现新的观察投资主题的角度，我们也将经过详细的研究之后，纳入到我们主题挖掘的体系当中。
2）主题库更新
主题研究不是一劳永逸的过程，我们将从上述逻辑出发，持续地跟踪相关要素的趋势性和结构性变化，至少每季度更新一次主题库，以实现备选主题库的动态更新。
（2）主题筛选
在建立了备选主题库的基础上，我们将按照前瞻性、标的可投资性以及市场关注度等标准，筛选当前具有投资价值主题，并按照我们对主题的重要程度的判断赋予备选主题以不同的权重。
1）前瞻性是指从宏观经济和宏观市场环境，以及政策预期的结构性或趋势性变化的角度出发，判断所选主题是否已被市场充分理解。若在市场之前介入前瞻性的主题，便可享受时间上的溢价，而若此主题已被市场充分理解，则介入风险可能较大。我们将从宏观经济和市场宏观环境结构性或趋势性变化的角度出发，关注敏感时间窗口，前瞻性地把握主题。
2）标的可投资性是指所选主题是否有足够的投资标的与之相对应（具体应看股票数量、市值覆盖是否足够），以及投资标的本身是否具有投资价值。若可关联股票足够多，则在一定程度上分散了投资风险，而若可关联股票较少，则存在较大的集中度风险。
3）市场关注度主要是指市场对所选主题的理解和预期程度，我们将从市场情绪、资金流向、卖方研究报告集中度等方面进行判断。市场对该主题的投资情绪高涨、资金流向明确、卖方研究报告集中度较高，则认为该主题的市场关注度较高。
在挑选出合适的主题的基础上，我们将从上述三个标准出发，按照我们对主题的重要程度的判断筛选备选主题以不同权重：最具有前瞻性、同时市场关注度良好、标的可投资性强的主题将被赋予最高权重；前瞻性和市场关注度中等、具有合适的标的可投资性的主题将被赋予中等权重；前瞻性和市场关注度较低，同时具有稍差的标的可投资性的主题将被赋予最低权重。
（3）个股精选
本基金将按照最大范围覆盖原则将筛选出来的主题关联到相应股票群中，从而这些不同主题所关联的股票群便组成了对应主题库的备选股票库。而本基金覆盖原则是指在将主题关联到相应股票群的过程中，本基金的研究团队会根据主题筛选的结果，结合第三方研究和市场认知程度，从该主题是否对个股基本状况产生影响，是否历史上存在联动关系、未来产生联动关系的可能性等角度出发，在本基金允许投资的基本股票库中，最大可能的筛选出与备选主题相关联的股票群。
本基金将综合考虑个股与既定主题的关联度以及股票本身的投资价值，精选股票，并根据定量以及定性分析的结果，赋予备选股票以不同的投资价值权重。
1）构建主题库对应的备选股票库
本基金将按最大范围覆盖原则将所选主题关联到相应股票群中，从而这些不同主题所关联的股票群便组成了对应主题库的备选股票库。
2）关联度分析
在经由最大范围覆盖原则产生的股票群中，我们需要对其中的个股与相关主题的关联度做出分析。我们主要从盈利影响度、市场认知度和历史关联关系等方面进行考察。
3）投资价值分析
在个股的投资价值分析层面，我们将从定性和定量的角度，对股票的基本面情况、估值水平进行分析，并结合基金经理和研究团队的实际判断，对个股赋予投资价值权重。
在定量方面，本基金主要从两个层面进行分析：一是通过对企业财务指标（包括盈利能力指标、营运能力指标、偿债能力指标和成长能力指标）进行分析，判断企业的基本面情况或成长空间；二是通过对估值指标的分析，判断企业的投资价值。
从财务角度而言，我们主要关注四方面的指标：
①盈利能力指标，如净资产收益率（ROE）、销售毛利率、净利润/营业总收入、每股收益（EPS）等——这是判断企业赚取利润能力的基本指标，我们会结合历史数据、卖方研究以及实地调研对未来数据变化做出研判，从而力图对企业的成长性作出基本的判断；
②营运能力指标，如总资产周转率（ATO）——这是销售额和总资产的比率，其综合考察了长期资产和短期资产，显示了公司总体的投资效率，周转率越快反映公司销售能力越强。
③偿债能力指标，如资产负债率（TDO）——这是负债总额（长期债务加短期债务）与资产总额（债务类资产加权益类资产）的比率。

④成长能力指标，如三年净利润平均增长率——这是企业三年内净利润增长率的平均值，反映企业的利润增长趋势和效益稳定程度，较好地体现了企业的发展状况和成长能力。
从估值角度来看，我们主要关注股票的P/B、P/E、P/S、PEG等相对估值指标和自由现金流价值（PCF）等绝对估值指标。
在定性方面，我们主要从上市公司股权结构、信息透明度、公司治理情况、产品创新能力等方面进行考量。
我们将结合个股基本面情况、估值水平分析，以及定性分析的结果赋予个股投资价值权重。基本面情况良好、估值水平合理、同时公司治理结构和治理结构合理、信息透明度高、产品创新能力强的股票赋予较高权重；反之则赋予较低权重。
（4）组合构建
最后，本基金将综合考虑备选个股的主题权重和投资价值权重，并结合其他投资机会的挖掘，筛选在备选主题库之外的具有投资价值的个股，共同构建股票投资组合。之后结合行业集中度、组合流动性等因素的考量，进行组合的再平衡，得到最终的投资组合。
3.债券投资策略方面，本基金的债券投资组合部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。
4.权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为沪深300指数与中证全债指数的混合指数，即：
75%沪深300指数+25%中证全债指数
沪深300指数为中证指数公司于2005年4月8日发布的综合反映沪深证券市场整体状况的指数；同时，中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。从而，沪深300指数与中证全债指数的混合指数作为本基金的业绩比较基准具备良好的代表性。
如果中证指数有限公司变更或停止沪深300指数或中证全债指数的编制及发布，或沪深300指数或中证全债指数由其他指数替代，或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或中证全债指数不宜继续作为基准指数，或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，取得基金托管人同意后，变更本基金的业绩比较基准。
十、基金的风险收益特征
本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中高风险、中收益收益的基金品种
十一、基金投资组合报告
本投资组合报告所载数据截止日为2015年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。
（一）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	639,723,915.25	81.08
其中：股票	639,723,915.25	81.08	
2	固定收益投资	—	—
其中：债券	—	—	
3	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—	
7	银行存款和结算备付金合计	76,707,089.09	9.72
8	其他资产	72,598,421.86	9.20
8	合计	789,030,326.20	100.00

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农林、牧、渔业	15,121,288.17	2.24
B	采矿业	8,102,656.28	1.32
C	制造业	194,888,061.66	27.41
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	22,723,370.00	3.37
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	121,561,773.87	18.02
J	金融业	141,386,111.51	20.97
K	房地产业	80,861,626.03	11.99
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	64,327,023.86	9.84
O	国防、军备和其他服务业	—	—
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		639,723,915.25	94.86

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	000094	招商转债	1,121,629	66,200,283.77	9.67
2	601318	中国平安	791,134	64,824,700.66	9.61
3	000009	中信银行	4,864,887	64,327,023.86	9.54
4	600048	中国铁建	5,541,670	62,287,069.60	9.30
5	600036	招商银行	1,770,221	62,807,441.08	9.31
6	002008	大族数控	975,746	58,749,573.95	7.91
7	601106	华能国际	2,306,463	40,131,243.26	5.96
8	600061	东方证券	628,890	31,063,851.00	4.61
9	600511	国药股份	460,960	22,723,370.00	3.37
10	601028	中国人寿	591,040	18,111,372.80	2.74

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
（五）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债券投资组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
（六）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。
（七）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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
（八）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。
（九）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
本基金本报告期末未投资股指期货。
2.本基金投资股指期货的投资策略
本基金本报告期末未投资股指期货。
（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.本期国债期货投资策略
本基金本报告期末未投资国债期货。
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资国债期货。
3.本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
（十一）投资组合报告附注
本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体。除中国平安外，报告期内没有出现过被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
2014年12月8日，中国平安保险（集团）股份有限公司（下称“中国平安”，股票代码：601318）控股子公司平安证券收到中国证监会开出《行政处罚决定书》，因其推荐海联讯IPO过程中，出具的保荐书存在虚假记载以及未审慎审查海联讯公开发行业务文件的真实性和准确性，被中国证监会给予警告，没收保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2867万元，并处以440万元罚款。
截至本报告期末，中国平安（601318）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，由于平安证券的利润占整个平安保险的比较低，而我们看好的是平安保险一直以来的竞争力，平安证券受处罚不影响中国平安作为保险集团的价值。我们认为该公司估值较低，有恢复增长的潜力，上述监管措施并不会影响公司的长期投资。因此本基金将继续持有中国平安。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。
3.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	864,741.18
2	应收证券清算款	71,219,567.77
3	应收股利	—
4	应收利息	15,401.84
5	应收申购款	288,770.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	72,598,421.86

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持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流通受限情况的说明
（一）报告期末基金资产组合情况
6.投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。
十二、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010.03.15-2010.12.31	0.20%	1.44%	3.71%	1.29%	-35.51%	0.15%
2011.1.1-2011.12.31	-20.90%	1.11%	-17.93%	0.98%	-3.03%	0.13%
2012.1.1-2012.12.31	7.32%	1.04%	6.64%	0.90%	0.38%	0.09%
2013.1.1-2013.12.31	17.76%	1.18%	-6.94%	1.06%	24.40%	0.13%
2014.1.1-2014.12.31	53.04%	1.09%	40.69%	0.91%	12.35%	0.18%
2015.1.1-2015.6.30	36.03%	2.21%	20.97%	1.70%	15.06%	0.51%
2010.03.15-2015.6.30	108.39%	1.29%	46.17%	1.09%	62.22%	0.20%



十三、基金的费用概览
（一）与基金运作有关的费用
1.费用的种类
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）基金财产规划支付的银行费用；
（4）基金合同生效后的基金信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后与基金有关的会计师事务所、律师费、诉讼费；
（7）基金的证券交易费用；
（8）依法可以在基金财产中列支的其他费用。
（9）本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式
（1）基金管理人的管理费
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：
H = E × 年管理费率 ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。
（2）基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：
H = E × 年托管费率 ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。
（3）除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。
3.不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行合同或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
4.费用调整
基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。
（二）与基金销售有关的费用
1.申购费
本基金在申购时收取申购费用。申购费用按单个交易账户单笔申购计算，