

信息披露 Disclosure

(上接A27版)

(59) 华林证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:宋志江
客服电话:400-188-3888
联系人:李琳
电话:0755-82707857
传真:0755-23613751
网址:www.chinalions.com
(60) 中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
客户服务电话:4006208888
联系人:王炜哲
电话:021-20328309
传真:021-50372474
网址:www.bocichina.com.cn
(61) 国海证券有限责任公司
注册地址:广西省桂林市辅星路13号
办公地址:广东省深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F
法定代表人:何春梅
联系人:牛孟宇
电话:0755-83709350
传真:0755-83704850
客服电话:956563
网址:www.gzhq.com.cn
(62) 江海证券有限公司
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法人代表:孙本扬
客服电话:4006662288
联系人:徐世旺
网址:www.jhzq.com.cn
(63) 长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽洋
客户服务热线:95579、4008-888-999
联系人:奚博宇
电话:027-85799999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com
(64) 恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法人代表:庞介民
客户服务电话:0471-4961259
联系人:魏巍
电话:0471-3953168
传真:0471-4930707
网址:www.cnht.com.cn
(65) 国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
客户服务电话:4006600109
联系人:刘婧婧
电话:028-86690057
传真:028-86690126
网址:www.gjzq.com.cn
(66) 中航证券有限公司
注册地址: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
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
法人代表:王宜四
客户服务热线:4008866567
联系人:戴骥
电话:0791-86768681
传真:0791-86770178
网址:www.avicsec.com
(67) 爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
法定代表人:郭林
客服电话:021-63340678
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-62878783
网址:www.aijzq.com
(68) 英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:吴俊
客服电话:4000-188-688
联系人:吴尔晖
电话:0755-83007159
传真:0755-83007034
网址:www.ydsc.com.cn
(69) 华西证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西路239号
法定代表人:杨炯洋
客户服务热线:4008888818
联系人:金达明
电话:0755-83025723
传真:0755-83025981
网址:www.hx168.com.cn
(70) 国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:姚志勇
客服电话:4008985288
联系人:徐欣
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
网址:www.glsc.com.cn
(71) 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
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
联系人:林爽
传真:010-66045527
网址:www.txsec.com
(72) 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
客服电话:4008008899
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
公司网址:www.cindasc.com
(73) 华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客户服务电话:400-820-9898
联系人:刘闻川
电话:021-68778790
传真:021-68868117
网址:www.cnhbstock.com
(74) 广发证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区河北路183-187号都会广场43楼(4301-4316层)
办公地址:广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
客服电话:95575
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
网址:www.gtc.com.cn
(75) 世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:姜味军
客服电话:0755-83199599
联系人:袁媛
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网址:www.cscoc.com.cn
(76) 中国中投证券有限责任公司
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:龙增来
联系人:刘毅
客户电话:400 600 8008
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn
(77) 中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街甲6号SK大厦
法定代表人:王兵
联系人:王雪薇
客服电话:010-85679238、010-85679169
网址:www.cicc.com.cn
(78) 齐鲁证券有限公司
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
联系人:吴阳
电话:0531-81253938
传真:0531-81283900
网址:www.qizq.com.cn
(79) 日信证券有限责任公司

注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系电话:010-89086830
联系人:陈彬
传真:010-66412537
网址:www.rxzq.com.cn
(80) 华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
联系人:杨晓天
联系电话:0931-8784509
传真:0931-4890619
甘肃省客服电话:96668
网址:www.hlzqgs.com
(81) 财信证券有限责任公司
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际金融中心26层
法人代表:蔡一兵
客户服务热线:0731-84403319
联系人:郭磊
电话:0731-84779521
传真:0731-84403439
网址:www.cfzq.com
(82) 华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
客服电话:0591-96326
联系人:张腾
电话:0591-87278701/
传真:0591-87841150
网址:www.hfzq.com.cn
(83) 大通证券股份有限公司
注册地址:大连市中山区人民路24号
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦38-39层
法定代表人:李红光
联系人:谢立军
电话:0411-39673202
传真:0411-39673219
客户服务热线:4008-169-169
网址:www.daton.com.cn
(84) 中原证券股份有限公司
地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
客服电话:0371-967218、4008139666
联系人:卢琳
联系电话:0371-68899287/联系传真:0371-65585665
网址:www.ccnew.com
(85) 西南证券股份有限公司
地址:重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:余维佳
客服电话:4008096096
联系人:徐雅筠、杨巧巧
网址:www.swsc.com.cn
(86) 山西证券股份有限公司
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
客服电话:0351-8686868
联系人:张治国
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
网址:www.i618.com.cn
(87) 天源证券经纪有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:林小明
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
统一客服电话:4006543218
公司网站地址:www.tyzq.com.cn
(88) 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
法定代表人:余磊
联系人:崔耀
联系电话:(027) 87186882/(028)86711410
传真:(027) 87618863
公司网站:www.tfzq.com
(89) 国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人:曾小普
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
传真:0791-6282293
网址:www.gsstock.com
(90) 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(1)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:俞洋
联系人:陈敏
网站:www.hxsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
(91) 深圳众基基金销售有限公司
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼L、J单元
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
联系人:董彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82800798
网址:www.zifund.cn
(92) 中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:黄扬录
客服电话:400-1022-011
网址:www.zszq.com.cn
(93) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:杨德红
客服电话:95521
联系人:邵敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670161
网址:www.gtja.com
(94) 中信建投股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
客服电话:4008888108
联系人:权晨
电话:010-85130577
传真:010-65182621
网址:www.csc108.com
(95) 上海好易基金销售有限公司
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:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大
厦903-906
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人:张磊
联系电话:021-58870011
传真:021-68596916
网址:www.ehowbuy.com
(96) 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
法定代表人:祁斌
联系人:黄恒
联系电话:010-58568062
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(97) 和讯信息科技有限公司
注册地址: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:常艳艳
联系电话:0755-82721122
传真:0755-82029055
客户服务电话:4009200022
网址:http://licaike.hexun.com
(98) 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195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:高莉莉
电话:021-54509888
传真:021-64383798
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(99) 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文一西路1218号1栋202室
法人代表:陈柏青
联系人:张裕
电话:0571-2882935
传真:0571-26898533
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
(100) 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号院5号楼40层-43层
法人代表:赵大建
联系人:李微
客户服务电话:400-889-5618

网址:www.e618.com
(101) 联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法人代表:徐刚
法人代表:彭莲
客户服务电话:95564
网址:www.lxzf.com.cn
(102) 北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢0层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦(丹棱soho)11008
法定代表人:赵荣春
联系人:魏宁
网站:www.qianjing.com
客户服务电话:400-893-6885
(三) 注册登记机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:张树忠
电话:0755-83183388
传真:0755-83195239
联系人:范瑛
(四) 律师事务所和经办律师
律师事务所名称:通力律师事务所
注册地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
办公地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
经办律师:秦悦民、韩轶
电话:021-68818100
传真:021-68816890
(五) 会计师事务所和经办注册会计师
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:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法人代表:杨绍信
经办注册会计师:薛竞、叶尔甫
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:刘莉
四、基金的名称
大成价值增长证券投资基金
五、基金的类型
基金类型:契约型
六、基金的运作方式
基金运作方式:开放式
七、基金的投资目标
以价值增长类股票为主构造投资组合,在有效分散投资风险的基础上,通过资产配置和投资组合的动态调整,达到超过市场的风险收益比之目标,实现基金资产的长期稳定增值。
八、基金的投资方向
本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,主要投资对象为深、沪两市A股中P/B值低、具有良好增长潜力的上市公司。
九、基金的投资策略
本基金投资策略分三个层次:资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略,个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的国债投资比例将不低于20%。股票投资部分重点关注:低P/B值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。
十、基金投资决策依据
本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖:
(1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
(2) 国家宏观经济环境及其对证券市场的影响;
(3) 国家货币政策、产业政策以及证券市场政策;
(4) 各行业、地区发展状况;
(5) 上市公司财务状况、行业处境、经济和市场状况及其当前市场价格;
(6) 证券市场资金供求状况及未来走势。
十一、基金投资决策程序
(1) 金融工程部和股票投资部分别提出市场策略研究报告和宏观经济、行业、上市公司分析报告
金融分析师和研究员在广泛参考和利用公司外部的研究成果,尤其是研究实力雄厚的证券经营机构提供的研究报告,并经常走访上市公司,并拜访国家有关部委,了解国家宏观经济政策及行业发展状况的基础上,经过筛选、归纳和整理,定期或不定期地撰写市场策略研究报告和宏观经济分析报告、行业分析报告、上市公司分析报告。
金融工程部和股票投资部向投资决策委员会和基金经理提供研究报告,作为其投资决策依据。
(2) 投资决策委员会决议确定本基金资产配置比例
投资决策委员会根据金融工程部和股票投资部提供的策略分析报告和研究报告,决议确定本基金资产的股票、债券、现金分配比例和总体投资策略。
(3) 基金经理制定具体的投资策略和投资组合方案
基金经理根据投资决策委员会确定的基金总体投资计划,参考投资部的宏观、行业、企业及市场分析报告,制定投资仓位以及具体的资产配置比例,选择行业和个股,构造投资组合方案。
(4) 基金投资部经投资决策委员会审核后,由基金经理向集中交易室下达具体交易指令。
(5) 风险控制委员会提出风险控制建议
风险控制委员会根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督,投资计划执行完毕,本基金经理应及时向投资决策委员会提出总结报告。
(6) 本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市场环境变化和实际需要调整上述投资策略。
十二、基金的投资方法
(1) 股票投资
本基金的股票投资部分既注重股票现期价格又关注未来的收益增长,以价值型股票中增长较快的股票构造投资组合,关注市场及个股的风险控制和流动性管理。具体的选股策略如下:
① 首先将沪深所有A股上市公司按行业分类,并按P/B值大小排序,剔除各行业中P/B值最大的1/3,构成价值类股票备选库;
② 将价值类股票备选库按年报公布的净利润增长率大小排序(在行业中排序),剔除最小的1/3,构成价值增长类股票备选库;
③ 运用相对价值评估法和现金流贴现折现等价值评估方法,对以上价值增长类股票备选库进行价值评估,选出未来盈利增长最好的一批股票构造投资组合;
④ 对于范围以外的股票,本基金将根据上市公司基本面结合二级市场表现,有选择地纳入研究范围,但该部分的投资不会作为基金投资的重点;
⑤ 对于每年05月至下一年度04月上市的新股,本基金将其作为一个特殊资产进行分类单独管理。
(2) 债券投资
本基金可投资于国债、金融债和企业债(包括可转换债),并可进行债券回购,国债投资部分将不低于本基金资产净值的20%。本基金管理人将按照基金总体资产配置计划,以满足流动性需求为目标,灵活运用久期、免疫等各种利率风险管理技术,并结合对市场的判断,合理构造和调整债券品种和期限的组合,提高基金资产水平。
十三、基金业绩比较基准
我国债券市场属于新兴市场,存在市场和制度缺陷双重因素造成的市场机会,采用波段操作具有现实基础和积极意义。通过判断整个市场利率走势以及波段价格变动的趋势,运用利率预期、单个债券选择、信用利差分析、收益率曲线预测和回购放大操作等积极的债券组合管理策略,并通过银行间与交易所进行跨市场套利,提高本基金债券投资的收益率水平。在债券资产配置上,基于国内债券市场大部分品种流动性不足的现状,本基金采取“两极策略”和“梯形策略”相结合的方式,充分的提升基金的流动性。
十四、基金的业绩比较基准
为增强本基金业绩与业绩比较基准的可比性以及增强基金业绩评价的透明性,本公司决定自2015年9月14日起将本基金业绩比较基准由“沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%”变更为“沪深300指数×80%+中债综合指数×20%”。
十五、基金的风险收益特征
本基金的风险收益与风险介于价值型基金与成长型基金之间,具有风险中等的收益特征。
十六、基金的投资组合报告
基金管理人及董事会对基金管理人按照基金合同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法律责任。
基金托管人中国农业银行根据基金合同约定,于2015年11月24日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9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	1,967,240,613.79	63.32
	其中:股票	1,967,240,613.79	63.32
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	822,701,000.00	26.62
	其中:债券	822,701,000.00	26.62
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	286,725,521.76	9.57
8	其他资产	15,207,356.18	0.49
9	合计	3,090,874,400.72	100.00

二、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、渔业	-	0.00
B	采矿业	82,962.97	0.00
C	制造业	1,045,121,856.74	38.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	113,219,436.67	4.12
E	建筑业	7,306,494.00	0.27
F	批发和零售业	282,953,565.91	10.31
G	交通运输、仓储和邮政业	143.26	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息技术、软件和信息技术服务业	99,565,894.41	3.63
J	金融业	101,922,581.80	3.71
K	房地产业	136,362,821.79	4.97
L	租赁和商务服务业	144,729,536.80	5.27
M	科学研究和技术服务业	218,626.59	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	22,789,161.85	0.83
S	综合	2,967,412.00	0.11
合计		1,967,240,613.79	71.30

三、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	000910	大亚科技	10,391,572	167,518,588.64	6.10
2	600093	京投股份	15,599,194	126,741,962.44	4.69
3	300090	盛运环保	6,947,771	123,670,744.26	4.51
4	600420	现代制药	4,061,108	118,178,242.80	4.31
5	601166	兴业银行	7,000,124	101,921,805.44	3.71
6	601933	永辉超市	9,999,959	101,499,948.25	3.70
7	600718	东软集团	6,717,972	93,312,631.08	3.40
8	300058	蓝色光标	8,000,000	85,300,000.00	3.11
9	600998	九州通	5,133,606	81,983,671.85	2.99
10	600525	长园集团	5,181,833	77,727,495.00	2.83

四、报告期末按券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	50,456,000.00	1.84
2	央行票据	-	0.00
3	金融债	772,246,000.00	28.13
	其中:政策性金融债	772,246,000.00	28.13
4	企业债	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	822,701,000.00	29.97

五、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	130202	13国债02	1,000,000	100,380,000.00	3.66
2	150215	15国债15	1,000,000	99,980,000.00	3.64
3	150413	15农发13	1,000,000	99,980,000.00	3.64
4	130241	13国债41	700,000	70,427,000.00	2.57
5	070215	07国债15	500,000	50,920,000.00	1.85

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政策
本基金本报告期末未投资股指期货。
(3) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
3.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。
(4) 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。
(5) 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、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无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
(2) 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) 基金的其他资产构成

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	-	0.00
B	采矿业	82,962.97	0.00
C	制造业	1,045,121,856.74	38.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	113,219,436.67	4.12
E	建筑业	7,306,494.00	0.27
F	批发和零售业	282,953,565.91	10.31
G	交通运输、仓储和邮政业	143.26	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息技术、软件和信息技术服务业	99,565,894.41	3.63
J	金融业	101,922,581.80	3.71
K	房地产业	136,362,821.79	4.97
L	租赁和商务服务业	144,729,536.80	5.27
M	科学研究和技术服务业	218,626.59	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	22,789,161.85	0.83
S	综合	2,967,412.00	0.11
合计		1,967,240,613.79	71.30

三、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	000910	大亚科技	10,391,572	167,518,588.64	6.10
2	600093	京投股份	15,599,194	126,741,962.44	4.69
3	300090	盛运环保	6,947,771	123,670,744.26	4.51
4	600420	现代制药	4,061,108	118,178,242.80	4.31
5	601166	兴业银行	7,000,124	101,921,805.44	3.71
6	601933	永辉超市	9,999,959	101,499,948.25	3.70
7	600718	东软集团	6,717,972	93,312,631.08	3.40
8	300058	蓝色光标	8,000,000	85,300,000.00	3.11
9	600998	九州通	5,133,606	81,983,671.85	2.99
10	600525	长园集团	5,181,833	77,727,495.00	2.83

四、报告期末按券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	50,456,000.00	1.84
2	央行票据	-	0.00
3	金融债	772,246,000.00	28.13
	其中:政策性金融债	772,246,000.00	28.13
4	企业债	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	822,701,000.00	29.97

五、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	130202	13国债02	1,000,000	100,380,000.00	3.66
2	150215	15国债15	1,000,000	99,980,000.00	3.64
3	150413	15农发13	1,000,000	99,980,000.00	3.64