

（上接B071版）

电话:0791-86291306
传真:0791-86285337
客户服务电话:400 8222 111
网址:www.gqstoc.com
(41)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层(266601)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层(266601)
法定代表人:杨宝林
联系人:孙秋升
联系电话:0532-85020226
传真:0532-86022605
客户服务电话:96548
网址:www.citicsd.com
(42)西南证券股份有限公司
注册(办公)地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
传真:023-63786212
客服电话:400 809 6086
公司网站:www.swsc.com.cn
(43)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州藤路23号投资广场19层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:宋朱彪
电话:021-20333333
传真:021-50149825
联系人:王一峰
客服电话:05631,400-8888-598
网址:www.longone.com.cn
(44)第一创业证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
电话:0755-23838760
传真:0755-23838760
客服电话:400-888-1888
网址:www.fcsc.com
(45)川财证券有限责任公司
注册(办公)地址:成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17层
联系人:匡亚峰
电话:028-86680563
传真:028-86680563
客户服务电话:028-95105118
公司网站:http://www.ccqz.com
(46)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4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:崔浩
电话:027-87610052
传真:027-87618963
客户服务电话:4008060000
网址:www.tfzq.com
(47)中信期货有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:洪斌
电话:0755-23963913
传真:0755-83217421
客户服务电话:400-080-8826
网址:www.citicfd.com
(48)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址:上海市四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人:龚德雄
联系人:许爱华
电话:021-53686826
传真:0086-21-53686100-7008或0086-21-53686200-7008
客户服务电话:4008918918、021-962518
网址:www.962518.com www.shzq.com
(49)深圳众禄基金控股股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客户服务电话:4006-788-887
网址:众禄基金网www.zlfund.com
基金买卖网www.jmmw.com
(50)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4楼202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道358号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:朱晓锐
电话:021-60897940
传真:0671-26697010
客户服务电话:4000-786-123
网址:www.fund123.cn
(51)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区2楼
法定代表人:汪静波
联系人:万欣
电话:021-38602377
传真:021-38609707
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(52)上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号220室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路666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
(53)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路686弄37号4号楼449A
办公地址:上海市浦东新区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
电话:021-58870011
传真:021-68609691
客户服务电话:400-700-9695
网址:www.ehowbuy.com
(54)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街8号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振杰
联系人:马林
电话:010-59081366-7024
传真:010-62002355
客户服务电话:4008188000
网址:www.myfund.com
(55)和讯信息科技有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:习娟
联系电话:010-85650920
传真号码:010-85657357
全国统一客服热线:400-920-0022/021-20835588
公司网站:licaikehexun.com
(56)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100号东方财富大厦2楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路196号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:潘世华
电话:021-54509988
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
网站:http://www.1234567.com.cn
(57)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9号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠苑路2号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:杨翼
联系电话:0571-89911818-8565
传真:0571-89800423
客服电话:4006-77370571-89802897
网址:www.5ifund.com
(58)万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东四环中路72号盘古大观3201
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人:李昊男
联系人:高静芳
电话:010-59393023
传真:010-64781056
客户服务电话:400-059-8888
网址:www.wy-fund.com
(59)百信基金销售有限公司(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法定代表人:沈伟伟
联系人:程刚
电话:010-52667213
传真:010-58594285
客户服务电话:400-66-9200
网址:www.yicaifund.com
(60)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:罗细安
联系人:孙倩璐
电话:010-67000988
传真:010-67000898-6000
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zcwz.com.cn
(61)北京晟诚下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河黄坎村736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28层
法定代表人:崔煜
联系人:徐长松、林凌
电话:010-58170943/010-58170918
传真:010-58170800
客户服务电话:400-818-8896
网址:www.shengshicheng.com
(62)嘉实财富管理有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期4606-10单元
法定代表人:赵学军
联系人:景景
电话:021-20289890
传真:021-80097308
客户服务电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
(63)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1006W
办公地址:北京市西城区宣武门大街10号庄胜广场中央办公楼东7层
法定代表人:杨晓勇
电话:0755-88394666
传真:0755-88394677
客户服务电话:400-166-1188
网址:http://R3j.com.cn/

(64)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1号楼A座2028
办公地址:北京市西城区阜成门大街9号万通新世界广场A座2008
法定代表人:李望秀
联系人:段京璐
电话:010-88312877
传真:010-88312885
客户服务电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
(65)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
联系人:陈琳
电话:010-57765019
传真:010-57765198
客户服务电话:400-789-8868-5
网址:www.httfund.com
(66)北京钱景财富投资管理有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢0层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:魏冲
电话:010-57418929
传真:010-57569671
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.qianjing.com
(67)深圳前海众安金融销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
办公地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
法定代表人:曾繁
联系人:廖静莎
电话:0755-33376853
传真:0755-33065516
客户服务电话:4006-877-899
网址:www.tenyaundfund.com
(68)北京创金启源投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁睿
联系人:张晶晶
电话:010-66154828
传真:010-89067626
客户服务电话:010-89067626
网址:www.51cuh.com
(69)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甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人:王岩
联系人:胡海清
电话:010-59200955
传真:010-59200080
客户服务电话:400-819-9868
网址:www.tdyfund.com
(70)上海汇金金融服务有限公司
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:400-820-2819
手机客户端:天天基金网
(71)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区临潼路475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:沈晓伟
联系人:赵沛然
电话:021-50683533
传真:021-50685055
客户服务电话:4000676266
公司网站:www.lidfund.com.cn
(72)北京新浪乐信基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区北四环西路68号906室
法定代表人:张欣行
联系人:李丽琛
电话:010-62281444
客户服务电话:010-62675369
网址:http://www.xinala.com/
(73)泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
注册(办公)地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:薛长平
电话:0411-88891212
传真:0411-84395536
客户服务电话:4006411999
网址:www.taichengfund.com
(74)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09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20666562
传真:021-20666653
客户服务电话:4008219031
网址:www.lufund.com
(75)深圳前海利得富投资管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新科技园南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:马力佳
电话:0755-83999077-815
传真:0755-83999026
客户服务电话:0755-83999077
网址:www.lingfawo.com
(76)北京乐融多源投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层
法定代表人:董雷
联系人:于婷婷
电话:010-56400010
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.jimifund.com
(77)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏卿
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客户服务电话:020-89629066
网址:www.yingmicf.com
基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时进行公告。

二、投资范围
名称:景顺长城基金管理有限公司
住 所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人:赵如冰
电 话:0755-82370388-1668
传 真:0755-22381325
联系人:杨波
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
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、孙睿
联系人:孙睿
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)
住所: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:上海市浦东新区202号普华永道中11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23328888
传真:021-23328800
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:单峰、俞伟敏

四、基金名称
景顺长城成长之星股票型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
在中国经济转型的大背景下,深度挖掘具备未来增长潜力的产业趋势和受益企业进行投资,在有效控制风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向
本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金将基金资产90%-95%投资于股票资产,其中,投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于基金资产净值的90%;权益投资比例不超过基金资产净值的3%,将不超过20%的基金资产投资于债券等固定收益类品种,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易所保证金后,本基金保留的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%。

本基金参与股指期货投资,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

八、基金的投资策略
1.资产配置
本基金依据定期公布的宏观经济数据以及投资团队对于宏观经济、股市场、市场趋势的综合分析,运用宏观经济周期理论(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合基金合同、投资策略的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。

2.股票投资策略
本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略,利用基金管理人股票研究数据库(SRD)对企业内在价值进行深入细致的分析,并进一步挖掘出质地优秀、未来预期成长良好的上市公司股票进行投资。

2.1.股票研究数据库(SRD)
首先利用景顺长城“股票研究数据库(SRD)”中的标准分析模板对上市公司的基本面和估值水平进行鉴别,确定股票买入名单。其中重点考察:

(1) 定价价值(Franchise Value)
寻找拥有高进入壁垒的上市公司,其一般具有以下一种或多种特征:产品定价能力、创新能力、资金密集、优势资源、健全的销售网络及售后服务、规模经济等。在经济增长时它们能创造持续性的成长,经济衰退时仍能通过提价、享有高于市场平均水平的盈利能力,进而创造高业务价值,这导致长期股价增值。

(2) 估值水平(Valuation)
重点考察投资上市公司时,用衡量成长型上市公司估值水平的主要指标为PEG,即市盈率除以盈利增长率。为了使投资人能够到达长期获利目标,我们在选股时将会谨慎地买进价格与其预期增长速度相匹配的股票。

(3) 管理能力(Management)
在上市公司治理、管理团队稳定性以及管理班子构成、学历、经验等,了解其管理能力以及是否诚信。

(4) 自由现金流量及分红政策(Cash Generation Capability)
注重企业创造现金流量的能力以及稳定透明的分红派息政策。

2.2.成长股分析
对于主题股的界定

2.2.1.主题股的界定,成长(Growth、Momentum、Quality)等特性股票的界定,市场主流方法是依据选择因子(Pactor)对全市场股票进行打分(Scoring),依据因子的权重进行加权,得出每一支股票在某一特定性上的得分,依次对股票进行排序,本基金主要认同市场上成长大型股票为投资主题,因而在主要成长性主题因子的,包括:营收成长、利润成长、经营利润率、毛利增长率、净利润增长率、ROE增长、资本支出增长率等,依据一年得分,5年内,未来市场预期不同期间计算,排序并依据权重进行分数加权。本基金投资主题,将根据成长性得分的60%为主要投资范围(主题股),投资主题依据定期更新和不定期的更新两种模式,基金不定期进行调仓,每半年进行一次主题更新,针对少数特定股票,参照本基金管理人内部规定的流程启动开始调整。

2.2.2. 定性分析
在主题股的基础上,本基金管理人将通过对上市公司基本面的深入研究,重点分析其投资企业的成长性,通过对企业成长性指标、成长质量和相对价值进行评估,以构建股票投资组合并对其进行动态调整。选股标准主要包括以下几个方面:

(1) 企业处于良好发展前景的产业趋势之中;重点挖掘能够顺应未来中国经济结构调整,符合金融

环境变化需要,在产能转移、城镇化、消费升级的过程中实现高增长的产业和公司;

(2) 企业拥有较大且清晰的市场空间;重点寻找有机会成为全国性大型的中国企业,以及有机会成为国际大型企业;

(3) 具备明确的企定位和发展策略;关注企业中长期发展态势,以及中长期成长趋势的变化。

(4) 企业具有核心竞争力;所谓核心竞争力是指企业在经营与管理、产品、技术、生产等公司内在增长动力上具备的其中一方面或多个方面的突出优势;

2.3.行业配置策略
本基金在精选个股的基础上,对股票投资组合进行适度均衡的行业配置。本基金将对宏观经济发展状况及趋势、行业周期性及景气度、行业相对估值水平等方面进行研究,判断各个行业的相对投资价值。在此基础上,参考股票市场行业资产分布比例,确定和调整调整各个行业的配置比例。

3. 债券投资策略
债券投资在控制资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极型投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

3.1 自而上确定组合久期及类属资产配置
通过对宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况的研究,结合宏观经济模型(MEM)判断收益率曲线变化的趋势及幅度,确定组合久期。进而根据各类属资产的预期收益率,结合类属配置模型确定类属资产配置。

3.2 自下而上选择债券
通过预期收益率曲线变化的幅度和形状,对比不同信用等级、在不同市场交易债券的到期收益率,综合考虑流动性、票息、税赋、可否回购等其它定价价值的因素,发现市场中券种的相对失衡状况。

重点选择的债券品种包括:
a、在类似信用评级和期限的债券中到期收益率较高的债券;b、有较好流动性的债券;c、存在信用溢价的债券;d、较高溢价或期权价值的可转换债券;e、收益率水平合理的新券或者市场尚未正确定价的创新品种。

(1) 利率预期策略
基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等对宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略如子弹组合、哑铃组合或者阶梯型组合等。

(2) 信用策略
基金管理人密切跟踪国债、金融债、企业(公司)债等不同债券种类的利差水平,结合各类券种税收状况、流动性状况以及发行人信用质量状况的分析,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间的配置比例。

个券选择原则:基金管理人对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析。财务分析方面,企业财务指标为依归,对企业规模、资产负债率、偿债能力、盈利能力四方面进行分析,非财务分析方面,包括管理层素质、市场地位、研发投入、研发管理等情况。前三项主要决定企业盈利能力和成长,通过打未来评级该企业是低风险、高风险还是绝对风险的企业,重点投资于低风险的企业债券;对于高风险企业,有相应的投资限制;不投资于绝对风险的企业。

(3) 时机策略
1) 骑乘策略:当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的到期期限将缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。

2) 息差策略:利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

(4) 资产支持证券投资策略
本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。同时,基金管理人将密切关注流动性对标的的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(5) 可转换债券投资策略
① 相对价值评估:基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,判断下一阶段的市场走势,分析可转换债券品种和属性的相对价值,通过对可转换债券转股溢价率和Delta系数的度量,筛选出定价或性价比之较强的品种作为下一阶段的投资品种。

② 基本面分析:基金管理人依据内、外部研究成果,运用景顺长城股票研究数据库(SRD)对可转换债券标的公司进行多方面、多角度分析,重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优秀、流动性较好的公司。

③ 估值分析:在基本面分析的基础上,运用P/E、P/B、P/CV、EV/EBITDA、P/BV等相对估值指标以及DCP、DDM等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估,并根据标的股票的市场价格和目标价格,运用期权定价模型分别计算可转换债券当前的理论价格和未来目标价格,进行投资决策。

(6) 中小型企业私募债券投资策略
对单个品种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金要加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、盈利能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

九、基金业绩比较基准
100%沪深300指数×90%+中证全债指数×10%。

沪深300指数是中国证监会编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率最高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票价格指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。

本基金是股票型基金,基金在运作过程中将维持90%-95%的股票资产,其余资产投资于债券及其他具有较高流动性的固定收益工具。本基金业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为90%和10%,并用中证全债指数代表债券资产收益率。因此,“沪深300指数×90%+中证全债指数×10%”是衡量本基金业绩表现的理想基准。

如果上述业绩比较基准由于统计编制调整或更名,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数时,本基金管理人可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

景顺长城基金管理人及基金托管人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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

一、报告期末基金资产组合情况
已经复核了本投资组合报告,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,本报告中所有财务数据未经审计。

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 47,838,813.05 79.19

其中:股票 47,838,813.05 79.19

2 基金投资 -- --

3 固定收益投资 -- --

其中:债券 -- --

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 12,301,049.95 20.36

8 其他资产 27,576.85 0.45

9 合计 60,412,439.85 100.00

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、渔 -- --

B 采矿业 -- --

C 制造业 27,682,454.49 46.85

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 934,412.60 1.58

E 建筑业 2,500,130.12 4.23

F 批发和零售业 906,468.42 1.53

G 交通运输、仓储和邮政业 817,983.75 1.38

H 住宿和餐饮业 -- --

I 信息技术、软件和信息技术服务业 3,225,135.11 5.46

J 金融业 2,687,400.00 4.55

K 房地产业 3,182,500.00 5.39

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 1,998,490.66 3.38

O 居民服务、修理和其他服务业 -- --

P 教育 -- --

O 卫生和社会工作 -- --

R 文化、体育和娱乐业 3,903,900.00 6.61

S 综合 -- --

合计 47,838,813.05 80.96

2. 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 000786 北新建材 439,830 5,823,349.20 9.86

2 002699 美盛文化 130,000 3,903,900.00 6.61

3 000002 万科A 250,000 3,182,500.00 5.39

4 601318 中国平安 90,000 2,687,400.00 4.55

5 300427 红相电力 60,000 2,673,600.00 4.52

6 300334 津膜科技 108,141 2,614,849.38 4.43

7 000208 津源电器 68,700 2,476,635.00 4.19

8 000440 津源电器 120,457 1,952,607.97 3.30

9 000488 晨鸣纸业 300,000 1,896,000.00 3.21

10 300017 网宿科技 31,039 1,636,065.69 2.77

3. 报告期末按品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

4. 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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

6. 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7. 报告期末按公允价值占基金