

(上接D085版)

公司网站:bankscitic.com  
(8)中国民生银行股份有限公司  
住所:北京市西城区复兴门内大街2号  
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号  
法定代表人:洪崎  
电话:010-58560666  
传真:010-57092611  
联系人:王继伟  
客户服务电话:96568  
公司网站:www.cmbc.com.cn  
(9)平安银行股份有限公司  
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号  
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号  
法定代表人:孙建一  
联系电话: 021-38637673  
传真电话: 021-50979507  
联系人:张莉  
客户服务电话:95611-3  
公司网站:www.bank.pingan.com  
(10)上海浦东发展银行股份有限公司  
住所:上海市中山东一路12号  
办公地址:上海市中山东一路12号  
法定代表人:吉晓辉  
电话:021-61616193  
传真:021-63604196  
联系人:高天、杨文川  
客户服务电话:95628  
公司网站:www.spdb.com.cn  
(11)温州银行股份有限公司  
住所:温州市车站大道196号  
办公地址:温州市车站大道196号  
法定代表人:邢增福  
联系电话:0577-88990082  
传真:0577-88995217  
联系人:林波  
客户服务电话:96699 (浙江省内)、962699 (上海地区)、0577-96699 (其他地区)  
公司网站:www.wzbank.cn  
(12)华夏银行股份有限公司  
住所:北京市东城区建国门内大街22号  
法定代表人:吴建  
联系人:王若凤  
电话:010-85238990  
客户服务电话:95677  
公司网站:www.hxb.com.cn  
(13)上海农村商业银行股份有限公司  
住所:上海市银城中路8号15-20楼、22-27楼  
办公地址:上海市银城中路8号15-20楼、22-27楼  
法定代表人:胡平西  
联系人:施传荣  
电话: (021) 38576666  
传真: (021) 560165124  
客户服务电话: (021) 962999  
公司网站: www.srbch.com  
(14)国联证券股份有限公司  
住所:无锡市太湖新城金融一街8号7-9层  
办公地址:无锡市太湖新城金融一街8号7-9层  
法定代表人:姚志勇  
电话:0510-82831662  
传真:0510-82830162  
联系人:沈刚  
客户服务电话:95670  
公司网站:www.gsl.com.cn  
(15)长江证券股份有限公司  
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦  
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦  
法定代表人:胡运训  
电话:027-68799999  
传真:027-85481900  
联系人:李晨  
客户服务电话:95579或4008-888-999  
公司网站:www.95579.com  
(16)海通证券股份有限公司  
住所:上海市广东路689号  
办公地址:上海市广东路689号  
法定代表人:王开国  
电话:021-23219000  
传真:021-23219100  
联系人:金芸、李笑鸣  
客户服务电话:95653  
公司网站:www.htsec.com  
(17)中国银河证券股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
法定代表人:陈共安  
电话: 010-66568430  
传真:010-66568990  
联系人:田薇  
客户服务电话:4008-888-888  
公司网站:www.chinastock.com.cn  
(18)中信建投证券股份有限公司  
住所:北京市朝阳区安立路6654号楼  
办公地址:北京市朝阳区朝阳门内大街118号  
法定代表人:王常青  
联系人:权越、许梦圆  
电话:400-8888-108  
开放式基金业务传真:010-65182261  
公司网站:www.csc108.com  
(19)国泰君安证券股份有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号?  
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼  
法定代表人:杨德武  
电话:021-38676161  
传真:021-38670161  
联系人:芮铁祺  
客户服务电话:400-888-8666/95521  
公司网站:www.gtja.com  
(20)申万宏源证券股份有限公司  
住所:上海市徐汇区长乐路989号45层  
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层  
法定代表人:李梅  
电话:021-33388888  
传真:021-33388224  
联系人:黄莹  
客户服务电话:95623或4008895523  
公司网站:www.swhysc.com  
(21)广发证券股份有限公司  
住所:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316)房  
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  
电话:020-87565888  
传真:020-87565305  
联系人:黄岚  
客户服务电话:95675或致电各地营业网点  
公司网站:www.gf.com.cn  
(22)湘财证券股份有限公司  
住所: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  
法定代表人:林俊波  
电话:021-68634510-8193  
传真:021-68665680  
联系人:张新霞  
客户服务电话:400-888-1851  
公司网站:www.xcsc.com.cn  
(23)兴业证券股份有限公司  
住所:福建省福州市湖东路268号  
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21楼  
法定代表人:兰荣  
电话:021-38565785  
传真:021-38565655  
联系人:谢高得  
客户服务电话: 95652  
公司网站:www.xyzq.com.cn  
(24)华泰证券股份有限公司  
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦  
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: 025-67038523  
传真: 025-84579763  
联系人:朱嘉裕  
客户服务电话:95697  
公司网站:www.htsc.com.cn  
(25)东方证券股份有限公司  
住所:上海市中山南路318号2号楼21层-29层  
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层-29层  
法定代表人:潘鑫荣  
电话:021-63325888  
传真:021-63326173  
联系人:吴宇  
客户服务电话:021-95503或4008-888-506  
公司网站:www.dfzq.com.cn  
(26)东吴证券股份有限公司  
住所:江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层  
办公地址:江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层  
法定代表人:范力  
电话:0512-65681136  
传真:0512-65689021  
联系人:方晓丹  
客户服务电话:0512-33396288  
公司网站:www.dwzq.com.cn  
(27)金元证券股份有限公司  
住所:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层  
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层  
法定代表人:陆涛  
电话:0755-83025666  
传真:0755-83025625  
联系人:马贤清  
客户服务电话:4008-888-2228  
公司网站:www.jyzq.cn  
(28)东海证券股份有限公司  
住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场10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:朱科敏  
电话:021-20333333  
传真:021-50498871  
联系人:姜旭  
客户服务电话:400-888-8588  
公司网站:www.longone.com.cn  
(29)招商证券股份有限公司  
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层  
法定代表人:宫少林  
电话:0755-82943666  
传真:0755-82943636  
联系人:林生迎  
客户服务电话:95565  
公司网站:www.newone.com.cn  
(30)中银国际证券有限责任公司  
住所:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层  
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层  
法定代表人:中银  
电话:021-68604866  
传真:021-50372474  
联系人:李丹  
客户服务电话:400-620-8888  
公司网站:www.bocichina.com  
(31)平安证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区金田路中华国际交易广场裙楼8楼  
办公地址:深圳市福田区金田路中华国际交易广场裙楼8楼  
法定代表人:杨宇翔  
电话:4008963338  
传真:0755-82400862  
联系人:郑舒丽  
客户服务电话:95511-8  
公司网站:stock.pingan.com  
(32)西南证券股份有限公司  
住所:重庆市北区桥北苑8号西南证券大厦8楼  
法定代表人:王珠林  
联系人:陈诚  
电话:023-63789464  
传真:023-63789311  
客户服务电话:400-8096-096  
公司网站:www.swsc.com.cn  
(33)安信证券股份有限公司  
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦34层、28层A02单元  
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层  
法定代表人:王冠英  
电话:021-68801217  
联系人:张杨  
客户服务电话:4008-001-001  
公司网站:www.essence.com.cn  
(34)光大证券股份有限公司  
住所:上海市静安区新闸路1508号  
办公地址:上海市静安区新闸路1508号  
法定代表人:薛峰  
电话:021-22169999  
传真:021-22169134  
联系人:刘晨  
客户服务电话:95525  
公司网站:www.ebscn.com  
(35)华龙证券股份有限公司  
住所:甘肃省兰州市静宁路308号  
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦  
法定代表人:李晓安  
电话:0931-8784666、4890208  
传真:0931-4890628  
联系人:李昕田  
客户服务电话:0755-33227950  
公司网站:www.hljsc.com.cn  
(36)国信证券股份有限公司  
住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼  
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:董彩平  
电话:0755-33227950  
公司网站:www.guosen.com.cn  
(37)华泰证券股份有限公司  
住所:山东省济南市经七路86号23层经纪业务总部  
法定代表人:李伟  
电话:0531-68889112  
传真:0531-68889755  
联系人:吴阳  
客户服务电话:95638  
公司网站:www.hqzq.com.cn  
(38)第一创业证券股份有限公司  
住所:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼  
办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼  
法定代表人:刘学民  
联系人:吴昊  
电话:0755-23838751  
传真:0755-82485081  
客户服务电话:400-888-1888  
公司网站:www.firstcapital.com.cn  
(39)万联证券股份有限公司  
住所:广州市中山二路18号广东电信广场36、37层  
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼  
法定代表人:张建军  
电话:020-37895070  
联系人:王鑫  
开放式基金咨询电话:400-8888-133  
开放式基金接收传真:020-22373718-1013  
公司网站:www.wljz.com.cn  
(40)申万宏源西部证券有限公司  
注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室  
办公地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(邮编:830002)  
法定代表人:李捷  
电话:010-88086858  
传真:010-88086195  
联系人:李巍  
客户服务电话:400-800-0562  
网站:www.hysec.com  
(41)中国中投证券有限责任公司  
住所: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层?  
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层及21层?  
法定代表人:高涛  
联系人:刘锐  
电话0755-82022442  
电话0755-82065397  
客服电话95632  
公司网站:www.china-invsc.com  
(42)国元证券股份有限公司  
住所:安徽省合肥市寿春路179号  
法定代表人:吴凤志  
联系人:李飞  
客户服务电话:400-8888-777  
公司网站: www.gyzq.com.cn  
(43)渤海证券股份有限公司  
住所:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室  
办公地址:天津市开发区永泰西道2号  
法定代表人:杜广平  
联系人:王兆权  
电话:022-28451861  
传真:022-28451892  
客户服务电话:400-651-5988  
公司网站: www.bhzc.com  
(44)国元证券股份有限公司  
住所:成都市东城根上街95号  
办公地址:成都市东城根上街95号6、16、17楼  
法定代表人:冉云  
联系人:陈静  
客户服务电话:400-660-0109  
公司网站:www.gjzq.com.cn  
(45)信达证券股份有限公司  
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
办公地址: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  
联系电话:010-63081000  
传真:010-63080978  
客户服务电话:400-800-8999  
公司网站:www.cindasc.com  
(46)中信证券股份有限公司  
住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座  
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  
法定代表人:王东明  
联系电话:010-60838888  
传真:010-60833739  
联系人:顾凌  
客户服务电话:400-889-5548  
公司网站:www.cscitec.com  
(47)方正证券股份有限公司  
住所:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层  
法定代表人:雷杰  
联系人:彭博  
联系电话:0731-85832343  
传真:0731-85832214  
客户服务电话:95671  
公司网站:www.foundersc.com  
(48)东北证券股份有限公司  
住所:长春市自由大路1138号  
办公地址:长春市自由大路1138号证券大厦1005室  
法定代表人:郭正  
联系人:安岩岩  
电话:0431-85096517  
客户服务电话:4006000686  
公司网站:www.nesc.cn  
(49)华福证券有限责任公司  
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
办公地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7至10层  
法定代表人:黄金琳  
联系人:张琳  
业务电话:0591-87383623  
系统传真:0591-87383610  
统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)  
公司网站:www.hfzq.com.cn  
(50)东兴证券股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街65号新盛大厦B座12-15层  
法定代表人:魏巍  
联系人:汤慧  
电话:010-66555316  
传真:010-66555246  
客户服务电话:400-888-8993  
公司网站:www.dxzq.net.cn  
(51)天相投资顾问有限公司  
住所: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505  
法定代表人:林义相

电话:010-66045529  
住所:辽宁省大连市沙河口区星海广场龙号3号  
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场龙号3号  
法定代表人:林卓  
联系人:薛长平  
联系电话:0411-88891212  
客服电话:4006411999  
公司网站:www.taichengcaifu.com  
(76) 华西证券股份有限公司  
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  
法定代表人:杨炯洋  
联系人:周志超  
电话:028-86135991  
传真:028-86150040  
客户服务电话:95684和4008-888-818  
公司网站:http://www.hx168.com.cn  
(77) 上海陆金所资产管理有限公司  
住所: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  
联系电话:021-20666562  
传真:021-22066653  
客服电话:4008219031  
公司网站:www.lufunds.com  
(78) 北京乐融多源投资咨询有限公司  
住所:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603  
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603  
法定代表人:李浩  
联系人:张婉婷  
联系电话:18510450202  
传真:010-65806060  
客服电话:4000681176  
公司网站:www.jimufund.com  
(79) 大泰金石投资管理有限公司  
住所:南京市建邺区江东南路359号国睿大厦一号楼B区4A506室  
办公地址:上海市市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼  
法定代表人:袁志刚  
联系人:何国章  
联系电话:13917225742  
传真:021-22269547  
客服电话:021-22267956/400-928-2266  
公司网站:www.dtfunds.com  
(80) 深圳富济财富管理有限公司  
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室  
法定代表人:齐小贺  
联系人:陈勇华  
联系电话:0755-83999907-806  
传真:0755-83999626  
客服电话:0755-83999913  
公司网站:www.jinjiawo.cn  
(81)上海凯石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室  
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼  
法定代表人:陈维武  
联系人:李晓明  
联系电话:021-63333319  
传真:021-63332594  
客服电话:4000178000  
公司网站:www.lingxiangfund.com  
(82)珠海盈米财富管理有限公司  
住所: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:黄敏娜  
联系电话:020-89629099  
传真:020-89629011  
客服电话:020-89629066  
公司网站:www.yingmi.cn  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。  
(二)注册登记机构  
注册登记人:中海基金管理有限公司  
住所:上海市浦东新区银城中路68号2906-2908室及30层  
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2906-2908室及30层  
法定代表人:黄贇  
电话:021-28429008  
传真:021-68419525  
联系人:周琳  
(三)律师事务所和经办律师  
名称:上海市锦天城律师事务所  
住所:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦14楼  
办公地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦14楼  
法定代表人:史晓章  
电话:021-53860388  
传真:021-53860399  
经办律师:沈国权、杨俊  
(四)会计师事务所和经办注册会计师  
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:上海市湖滨道202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:杨绍信  
联系电话:(021)23238888  
传真:(021)23238800  
联系人:赵钰  
经办会计师:薛竞、赵钰  
七、基金的投资  
中海分红增利混合型证券投资基金  
契约型开放式  
六、基金的投资目标  
主要投资于中国证券市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法  
公开发行的上市的各种债券,在控制风险、确保基金资产流动性的前提下,以获取超过例行分红收益和资本相对增值的方式谋求基金资产的长期稳定增值。  
基金的投资方向  
投资于具有中国证监会市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司所发行的股票。本基金投资这类公司股票的比例将不低于基金股票资产的80%。  
七、基金的投资策略  
八、基金的投资策略  
本基金采用现金股利精选的投资策略,即:通过公司开发的DM模型和IPOD模型筛选出现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司。  
依据上市公司股利分配政策、历年分红情况不仅考察上市公司当期分红的绝对值还要考察上市公司分红的连续性、稳定性。主要从以下方面考察上市公司股利分配情况:①、财务健康、经营性现金流净额充沛;②、公司在所属行业内享有领先地位,行业具有自然垄断性、资源垄断性,公司本身具有比较显著的竞争优势;③、过去分红派现能力强,公司当期分红能力强说明上市公司有较强的盈利能力,如果上市公司连续分红,则上市公司重视对股东的投资回报,有较好的、稳定的股利分配政策决策机制,公司已进入回报期。④、未来分红潜力。过去分红能力强的上市公司对未来分红有良好的示范效应,本基金更重视上市公司的未来分红潜力。  
通过对上市公司盈利能力的持续分析及财务分析,特别是注重上市公司市价市现、经营性现金流净额及每股净利润等指标的分析,挖掘出上市公司未来分红潜力。  
七、基金的投资策略  
股票投资组合构建通过以下三个阶段进行:  
第一阶段:历史上分红能力强股票筛选  
本基金运用本公司开发的DM模型,对所有上市公司(投资决策委员会禁止投资的股票除外)进行过去分红能力筛选。主要通过现金股息率、3年平均分红额等6项指标进行综合评价以反应上市公司过去分红强度、持续性、稳定性及分红投资回报。初步筛选出除上证红利指数60家成份股外的150家左右的上市公司,连同上证红利指数成份股60家,共200家左右股票作为中海分红增利基金股票备选库(1)。  
第二阶段:分红潜力股票筛选  
针对第一阶段筛选出的股票备选库(1),本基金运用POD模型对其分红潜力进行筛选。  
中海POD模型由3个大的分析单元和5个量化的核心指标构成。模型所用数据全部为上市公司公布的历史数据,以保证客观性。中海POD模型3个大的分析单元分别是:企业盈利能力、财务健康状况及资产管理能力。通过企业盈利能力分析,判断企业分红能力的基础是否坚实,未来分红潜力是否巨大;通过企业管理能力、长期负债财务健康指标的分析,判断企业分红意愿;资产管理能力高的企业表明公司的经营效率高,管理层能力很强,有较好的核心竞争力。  
中海POD模型设置充分体现了量化、客观、易操作的评价原则。模型中量化指标的设置保证了选股过程客观性和可对比性。  
中海POD模型对备选库(1)中的股票进行进一步精选,形成100家左右上市公司的股票作为本基金股票备选库(II)。  
第三阶段:股票投资组合构造  
基金经理小组依据市场、行业景气度及内外、外部研究报告,特别是研究员的实地调研报告,确定60只左右分红红利股票。依据投资决策委员会确定的资产配置,完成股票资产投资组合的构造。  
二、债券投资策略  
本基金可投资国债、金融债和企业债(包括可转债)。根据基金资产总体配置计划,在对利率走势和债券发行人基本面上进行分析的基础上,综合考虑不同品种债券的流动性、收益率水平、信用风险等级、流动性的好坏等因素,建立由不同类型、不同期限债券品种构成的投资组合。  
个券选择原则:  
(1)流动性较好、交投活跃的品种;  
(2)有较高当期收入的债券;  
(3)预期有增长、价格被低估的品种;  
(4)对于信用等级相同的债券,在满足流动性的前提下,选取收益率高的债券;  
(5)预期信用等级得到改善,到期收益率预期可能下降的债券。  
三、权益投资策略  
运用B-S模型、二叉树模型、隐含波动率等方法对权证估值进行测试,通过权证交易策略锁定投资,通过承担适度风险,进行主动投资以获取超额收益。  
九、基金的业绩比较标准  
本基金采用上海证券交易所以上证红利指数作为股票投资部分的业绩比较基准。本基金将基金产品定位为能为投资者带来实实在在的收益的高品质的、收益型价值产品,上证红利指数十分恰当地反映了我们的投资目标;另外在一级股票池的选择思路里,上基金与上证红利指数编制方法中样本股票选择方法类似,二者业绩将更具有可比性。  
对于基金的整体投资策略,采用以下方法加权的结果作为评价基准  
中海分红增利基金总体业绩评价基准 = 上证红利指数×70% + 上证国债指数×25% + 银行一年定期存款利率×5%。  
十、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。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告财务数据真实、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。  
1.报告期末基金资产组合情况  
截至2015年9月30日,中海分红增利混合型证券投资基金资产净值为620,853,372.88元,基金份额净值为0.7931元,累计基金份额净值为1.21931元。其资产组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	522,097,904.47	83.93
2	其中:股票	522,097,904.47	83.93
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	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	119,639,771.08	18.56
7	其他资产	3,367,482.29	0.52
7	合计	645,105,528.44	100.00

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	203,814,369.16	32.83
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	6,097,126.00	1.06
F	批发和零售业	36,383,033.00	5.70
G	交通运输、仓储和邮政业	94,943,807.12	15.29
H	住宿和餐饮业	51,344,636.04	8.26
I	信息传输、软件和信息技术服务	12,776,349.00	2.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	71,704,313.66	11.55
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	国防商务、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	40,036,506.60	6.45
S	合计	5,406,092.00	0.89
	合计	522,097,904.47	83.93

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	600836	飞龙实业	2,242,770	59,747,392.80	9.62
2	600764	锦江股份	1,777,246	51,344,636.04	8.27
3	600818	中银股份	829,151	43,896,263.94	7.07
4	600063	陆家嘴	820,889	42,618,476.16	6.86
5	002099	奥通文化	1,333,220	40,036,506.60	6.45
6	600969	烟台港	763,261	22,385,300.00	3.59
7	600930	云铝股份	1,129,400	20,977,466.00	3.38
8	000797	金瑞矿业	1,090,629	16,967,799.60	2.74
9	600893	中航动力	412,700	16,862,522.00	2.72
10	600885	吉祥航空	323,398	16,312,106.12	2.63

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	存出保证金			906,006.48	0.15
2	应收证券清算款			2,027,263.94	0.33
3	应收股利			-	-
4	应收利息			21,102.61	0.00
5	应收申购款			322,703.68	0.05
6	其他应收款			-	-
7	待摊费用			-	-
8	其他			-	-
9	合计			3,367,482.29	0.52

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因	占基金资产净值比例(%)	流通受限期间说明
1	600764	锦江股份	51,344,636.04	8.27	重大资产重组
2	002099	奥通文化	40,036,506.60	6.45	重大资产重组

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因	占基金资产净值比例(%)	流通受限期间说明
1	600764	锦江股份	51,344,636.04	8.27	重大资产重组
2	002099	奥通文化	40,036,506.60	6.45	重大资产重组

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因	占基金资产净值比例(%)	流通受限期间说明
1	600764	锦江股份	51,344,636.04	8.27	重大资产重组
2	002099	奥通文化	40,036,506.60	6.45	重大资产重组

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因	占基金资产净值比例(%)	流通受限期间说明
1	600764	锦江股份	51,344,636.04	8.27	重大资产重组
2	002099	奥通文化	40,036,506.60	6.45	重大资产重组

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因	占基金资产净值比例(%)	流通受限期间说明
1	600764	锦江股份	51,344,636.04	8.27	重大资产重组
2	002099	奥通文化	40,036,506.60	6.45	重大资产重组

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因	占基金资产净值比例(%)	流通受限期间说明
1	600764	锦江股份	51,344,636.04	8.27	重大资产重组
2	002099	奥通文化	40,036,506.60	6.45	重大资产重组

(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