

(上接A31版)

联系人:申丹萍
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichund.com
(7)上海好买基金销售有限公司
住所: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室
法定代表人:杨文斌
传真:(021)68596916
联系人:薛华
客户服务电话:400-700-9606
网址:www.howbuy.com
(74)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
住所:上海市虹口区吴淞路360弄9号372室
办公地址:上海市虹口区吴淞路360弄9号372室
法定代表人:汪静波
传真:(021)38600777
联系人:方成
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(75)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王利
电话:(021)20835789
传真:(021)20835879
联系人:周欣
客户服务电话:4009200022
网址:http://licaike.hexun.com/
(76)上海天基基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路180号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路196号39楼10楼
法定代表人:吴实
电话:(021)15450998
传真:(021)64385308
联系人:潘世友
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com
(77)北京展恒财富管理股份有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街6幢119层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6幢119层1008-1012
法定代表人:赵圣春
电话:(010)157418829
传真:(010)15763671
联系人:魏争
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.111111.net
(78)深圳前海广信证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006H
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C9层
法定代表人:陈熹
电话:(010)58325395
传真:(010)58325362
联系人:刘兰文
客户服务电话:400-850-7771
网址:http://8rj.com.cn/
(79)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区后沙峪安福街6号
办公地址:北京市朝阳区安福路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振杰
电话:(010)15601366-7024
传真:(010)162020356
联系人:马林
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com
(80)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9号五层大厦C座702
办公地址:北京市西城区阜成门内大街9号五层大厦C座702
法定代表人:董文贵
电话:(010)88292063
传真:(010)15237570
联系人:李俊梅
客户服务电话:4000-468-788
网址:www.66zichan.com
(81)上海大智慧财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区富阳路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区富阳路428号1号楼10-11层
法定代表人:申健
电话:(021)120219931
传真:(021)120219923
联系人:付江
客户服务电话:021-120219931
网址:http://www.yilucaifu.com/
(82)上海聚泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市中环路福康里1818号8楼3楼
法定代表人:燕斌
电话:(021)15292063
传真:(021)15237570
联系人:凌波梅
客户服务电话:4000-468-788
网址:www.66zichan.com
(83)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
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:沈伟彬
电话:(010)152856713
传真:(010)88694285
联系人:程刚
客户服务电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com
(84)浙江恒顺金销售服务有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌佩华
电话:(0571)88911818
传真:(0571)168004423
联系人:吴昊
客户服务电话:400-877-3772
网址:www.51fund.com
(85)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人:罗细安
电话:(010)167000888
传真:(010)167000888-6000
联系人:李皓
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zengcaiwang.com
(86)泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区星海广场龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场龙园3号
法定代表人:林卓
电话:(0411)88981212
传真:(0411)8430636
联系人:薛长平
客户服务电话:4006411999
网址:www.taichengcaifu.com
(87)上海煜晨基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长海镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路618号A1002室
法定代表人:王翔
电话:(021)65370077
传真:(021)150585931
联系人:俞华莉
客户服务电话:(021)65370077
网址:www.jiayufund.com.cn
(88)珠海盈泰财富管理有限公司
住所:珠海市香洲区翠海路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
电话:(020)189629099
传真:(020)189629011
联系人:黄敏敏
客户服务电话:(020)189629066
网址:www.yingtaicn.com
(89)深圳益融资产管理有限公司
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号恒惠集团二期418室
法定代表人:齐小勇
电话:(0755)83999077-802
传真:(0755)83999026
联系人:马力佳
客户服务电话:(0755)83999097
网址:www.jianqianwo.com
(90)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:卢朝燕
电话:(021)20665962
传真:(021)22666653
联系人:宁博宇
客户服务电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(91)上海汇付金融服务有限公司
住所:上海市中环路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市虹口区临平路1801号凯利国际大厦7楼
法定代表人:冯修敏
电话:(021)33232999
传真:(021)33232837
联系人:陈云升
客户服务电话:4008213999
网址:https://tty.chinapaymtr.com
(92)北京众安财富管理有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人:董浩
电话:(010)15658666
传真:(010)15659066
联系人:张婷婷
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.jimufund.com

(93)上海凯石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区西藏南路延安路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈雄武
电话:(021)63333319
传真:(021)63332523
联系人:李晓明
客服电话:4000 178 000
网址:www.lingxiantianfund.com
(94)上海利得基金销售有限公司
住所:上海浦东新区陆家嘴91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
法定代表人:沈伟彬
电话:(021)150585333
传真:(021)150583633
联系人:徐娜
客服电话:400-005-6355
网址:admin.leadfund.com.cn
(95)大泰金石投资管理有限公司
住所:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B座4A506室
办公地址:上海市中虹区虹桥路1386号方广大厦15楼
法定代表人:袁颖明
电话:(025)16820646
传真:(021)22268089
联系人:何庭宇
客户服务电话:400-928-2266(021)-22627995
网址:www.dtfunds.com
基金管理人应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)登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:(010)19378839
传真:(010)19378807
联系人:宋立元
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海锦泰律师事务所
住所:上海浦东新区256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东新区256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:(021)151150298
传真:(021)151150398
联系人:廖海
经办律师:梁丽云、刘佳
(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:上海市湖路路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)12323888
传真:(021)12323800
联系人:沈兆杰
经办注册会计师:薛竟、沈兆杰

四、基金的名称
五、基金的投资目标
本基金为一只监管混合型基金,主要通过投资于业绩优良、发展稳定,在行业内占有支配性地位,分红稳定的蓝筹上市公司股票,在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,追求在控制风险的基础上实现基金资产的长期稳定增长。

六、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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和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的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。

七、基金的投资策略
本基金的投资对象重点为业绩优良、发展稳定,在行业内占有支配性地位,分红稳定的蓝筹上市公司股票,满足上述条件的蓝筹股票占全部股票投资组合市值的比例不低于80%。

在正常市场情况下,基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%(基金保留的现金以及投资于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5%)。在基金实际管理过程中,本基金资产配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场阶段性变化做出调整,以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超过基金合同约定的限定范围。本基金资产配置原则如下表所示:

表一:资产类别和配置比例

| 资产类别 | 资产配置范围 |
|------------------------|---------|
| 股票、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券 | 60%-95% |
| 债券及法律法规和中国证监会允许的其他证券品种 | 5%-40% |

八、基金的投资流程
本基金基金管理人,将遵循“严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,通过优选业绩优良、发展稳定,在行业内占有支配性地位,分红稳定的蓝筹上市公司股票进行投资,以谋求基金资产的长期稳定增长。”

1.资产配置
本基金采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统,结合定性分析和定量分析,形成对不同市场的判断和预期,确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例,并随着宏观经济及市场风险收益特征的变化,动态调整股票、债券资产和货币市场工具的比例,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。

2.资产配置
本基金将通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测,确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值与投资风险,并据此对基金股票资产的行业分布进行动态调整。一般而言,对于国民经济快速增长中的领先行业,受国家政策重点扶持的行业,以及受国内外宏观经济运行有利因素影响的行业景气良好的行业,为本基金重点投资的行业。

具体而言,我们通过以下几方面的分析对行业资产配置进行优化调整:
(1)宏观环境分析:通过对宏观经济数据如季度GDP增长率、每月CPI数据、通胀速度、每月工业增加值增长速度等的跟踪研究,对宏观经济环境变动趋势进行预判分析,并对人眼研究国家宏观政策和监管政策对市场各个行业的影响,分析行业政策环境,从而判断宏观经济周期对行业的影响;
(2)行业景气度分析:以全球性的数据对各行业的未来发展趋势进行分析,判断行业发展前景,通过商业模式和竞争力的分析寻找优势行业,通过对行业主营业务收入、产品价值、毛利率的变化等数据进行分析,寻找财务稳健和景气反转的行业作为投资的重点;
(3)行业估值和动量分析:通过对市场和各个行业估值水平PE、PB等数据的横向、纵向分析,进行估值比较,并跟踪各个行业的资金流向,分析盈利预测指数、机构持仓特征等,进行行业轮动配置。

3.股票选择
本基金综合运用罗德集团的股票研究分析方法和其它投资分析工具,挑选具有分红稳定特征的蓝筹上市公司股票构建股票投资组合。具体分以下三个层次进行:
(1)品质筛选
筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基金品质要求的上市公司,构建备选股票池。主要筛选指标包括:盈利能力(R/P、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等),经营效率(如ROE、ROA、Return on operating assets等)和财务状况(如D/A、流动比率等)等。

(2)蓝筹股优选
在备选股票池中,投资人把那些在其所属行业内占有重要支配性地位、业绩优良、分红优厚的大公司称为蓝筹股。借鉴蓝筹股市场成熟的投资策略,结合中国股票市场的实际情况,本基金根据下述定性指标和量化的标准来筛选品质优良的备选股票池中筛选出中国蓝筹上市公司构建蓝筹股票池,并严格按股票池按照风险划分对个股的股票池:

1)蓝筹核心股票池
①具有相对规模:总市值排名位于整个A股市场的前30%之列,或者总市值排名位于所属行业内的25%之列;(按照GICS行业分类标准进行行业划分);
②在所属行业内占有重要支配性地位,具有较大市场占有率、市场影响力和较高的品牌价值,其中主营业务收入排名位列所属行业前50%;
③公司具有良好成长性,通过对控制企业盈利增长质量的因素(如ROIC、WACC、EVA等)进行评估,挑选EVA不断增长或改善的优质公司;
④公司治理结构良好,管理透明,信息披露;
⑤主营业务明确,盈利能力强,收入和利润稳定增长;
⑥分红稳定且具有较高的现金股息收益率;
2)蓝筹成长股票池
我们对于蓝筹核心股票池进行风格划分:指标蓝筹、成长蓝筹和红利蓝筹。指标蓝筹选取市值最大的股票;成长蓝筹选取每股收益持续增长且增长率高的企业;红利蓝筹选取连续分红股息收益率的企业。
本基金管理人根据上述蓝筹股选择标准,在定量指标筛选和定性指标评价的基础上,自下而上优选具有稳定分红特征的蓝筹股,并根据市场波动特征在蓝筹股票池中确定行业配置,满足上述条件的蓝筹上市公司股票占全部股票投资组合市值的比例不低于80%。

3)多元价值投资组合
对上述核心股票池中的蓝筹上市公司进行内在价值的评估,在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可持续的股票投资标的。

4.债券投资
在债券投资方面,本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,本基金的投资策略采取主动的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上超越股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

在全球经济的框架下,本基金管理人从宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化出发,运用数量化工具,对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出判断,并结合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素,构造债券组合。在具体操作中,本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杠放大策略和换券等多种策略,获取债券组合的长期稳定收益。

5.权证投资策略
本基金将在权证投资以权证的市值价格分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,通过主动的科学投资管理手段,充分考量权证资产的风险性、流动性及风险性特征,进行权证资产配置,品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

6.资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合信用期限久期管理、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,通过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。

九、基金的投资业绩比较基准
本基金的整体业绩比较基准为:
75%×中证100指数+25%×中债综合债券指数
本基金股票投资部分的业绩比较基准是中证100指数,债券投资部分的业绩比较基准是中债综合债券指数。
本基金采用中证100指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要基于以下原因:
1.中证100指数是我国官方由官方推出的沪深两市统一指数——沪深300的样本中挑选规模较大的100只股票组成该样本,以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批市值公司的整体状况。
2.该指数科学地反映了我国资本市场上市公司市场变化水平,具有较高的权威性、及市场代表性,投资者可以方便地获取、互联网等财经媒体中获取。
3.本基金的股票投资对象以蓝筹股为主,而这些股票通常都是中证100指数中重要的成分股,因此中证100指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商一致后调整本基金的业绩评价基准,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
本基金是一只混合型基金,以优质蓝筹股为主要投资对象,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

十一、基金投资组合报告
本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。
本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2016年1月20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。
报告期末(2015年12月31日)至2015年12月31日。本报告财务资料未经审计师审计。

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 | 2,606,578,883.06 | 80.83 |
| | 其中:股票 | 2,606,578,883.06 | 80.83 |
| 2 | 固定收益投资 | 166,250,000.00 | 5.16 |
| 3 | 其中:债券 | 166,250,000.00 | 5.16 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 贵金属投资 | - | - |
| 6 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 7 | 其他投资 | 199,760,439.88 | 6.20 |
| 8 | 银行存款和拆入资金 | - | - |
| 9 | 其他资产 | 247,126,841.85 | 7.67 |
| 10 | 合计 | 4,940,476,803.00 | 0.15 |
| 11 | 合计 | 3,223,566,641.19 | 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) | 占净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|----------|
| A | 农林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,476,887,979.92 | 47.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 91,326,647.40 | 2.83 |
| E | 建筑业 | 76,587,663.70 | 2.44 |
| F | 批发和零售业 | 123,214,604.01 | 3.83 |
| 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 | 185,036,173.66 | 5.89 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 66,612,739.28 | 2.12 |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,099,383.28 | 1.26 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 94,542,926.29 | 2.89 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 141,660,000.00 | 4.51 |
| O | 居民服务、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 | 260,861,143.34 | 8.31 |
| S | 综合 | 57,430,206.25 | 1.83 |
| T | 合计 | 2,606,578,883.06 | 80.83 |

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 | 600266 | 东安汽车 | 4,500,000 | 159,426,000.00 | 5.08 |
| 2 | 600054 | 黄山旅游 | 6,000,000 | 141,660,000.00 | 4.51 |
| 3 | 000460 | 康得新 | 3,222,330 | 122,789,823.00 | 3.91 |
| 4 | 002555 | 康美药业 | 2,500,000 | 122,150,000.00 | 3.89 |
| 5 | 002131 | 利欧股份 | 5,307,653 | 103,499,233.50 | 3.30 |
| 6 | 002566 | 歌华有线 | 2,989,944 | 93,068,883.28 | 2.96 |
| 7 | 600000 | 长江电力 | 6,779,915 | 91,326,647.40 | 2.83 |
| 8 | 600104 | 上汽集团 | 4,000,972 | 86,091,676.94 | 2.71 |
| 9 | 002508 | 中航资本 | 1,800,000 | 80,910,000.00 | 2.58 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 8,000,000 | 76,587,663.70 | 2.44 |

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 | 国债投资 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 140,322,000.00 | 4.47 |
| 4 | 其中:政策性金融债 | 140,322,000.00 | 4.47 |
| 5 | 企业债券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 短期融资券(可转换债) | 26,968,000.00 | 0.83 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 166,250,000.00 | 5.16 |

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 | 150416 | 15国债16 | 1,400,000 | 140,322,000.00 | 4.47 |
| 2 | 110031 | 国债转融 | 200,000 | 26,968,000.00 | 0.83 |

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
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序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
本基金本报告期末未持有股指期货。

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持有国债期货。

11.投资组合报告附注
(1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。
(2)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的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 | 2,239,573.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,924,779.60 |
| 5 | 应收申购款 | 676,122.23 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 预付款项 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,840,476.80 |

(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 | 110031 | 国债转融 | 26,968,000.00 | 0.83 |

(5)报告期末前十名股票中存在受流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在受流通受限情况。
(6)投资受限情况说明
由于以下原因,投资受限、分派和与支付之项目可能存在误差。
(一)基金的投资
本基金业绩截止日为2015年12月31日,所披露的数据未经审计师审计。
本基金管理人,依照相关法律法规、规范性文件,遵照基金的投资目标和基金合同,在保证基金资产安全、流动性、收益性的前提下,本基金管理人并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金业绩比较基准包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于下列列示:
1.基金业绩比较基准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① | 净值增长率② | 业绩比较基准增长率③ | 业绩比较基准增长率④ | ①-③ | ②-④ |
|------------------------------|---------|--------|------------|------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 26.10% | 1.79% | 11.26% | 1.19% | 13.76% | 0.60% |
| 2015年度 | 47.46% | 2.59% | 1.76% | 1.85% | 46.70% | 0.74% |
| 2014年度 | 8.88% | 0.09% | 46.81% | 1.01% | -36.93% | -0.92% |
| 2013年度 | 5.40% | 1.24% | -9.19% | 1.10% | 14.59% | 0.14% |
| 2012年度 | 10.24% | 1.06% | 9.41% | 0.91% | 9.33% | 0.15% |
| 2011年度 | -22.85% | 1.06% | -15.01% | 0.96% | -7.74% | 0.11% |
| 2010年度 | -0.70% | 1.38% | -13.92% | 1.19% | 4.14% | 0.13% |
| 2009年度 | 71.61% | 1.76% | 61.89% | 1.53% | 9.72% | 0.23% |
| 2008年度 | -56.01% | 1.92% | -53.02% | 2.26% | 3.01% | -0.34% |
| 2007年度(自基金合同生效日至2007年12月31日) | 36.11% | 1.37% | 11.93% | 1.50% | -2.11% | -0.13% |

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×中证100指数+25%×中债综合债券指数”变更为“75%×中证100指数+25%×中债综合债券指数”,详情见本基金管理人于2015年9月20日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。
①、②基金合同生效以来本基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动比较

交银施罗德基金业绩比较基准收益率历史走势图(2007年8月8日至2015年12月31日)

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产投资比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

十三、基金的费用与税收
(一)基金费用的种类
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.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
5.基金合同生效后与基金相关的审计费;
6.基金持有人大会费用;
7.基金在证券交易所上市的费用;
8.在中国境内证券交易场所产生的前提下,本基金可以在基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。
上述基金费用由基金管理人按法律法规的范围内参照公允的市场价格确定,

法律法规另有规定时从其规定。
本基金基金合同终止时基金财产清算时发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.与基金运作有关的费用
(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%的年费率计提。管理费的计算方法如下:
 $H = E \times 1.5\%$ (当年天数)
H为每日应付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,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%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
 $H = E \times 0.25\%$ (当年天数)
H为每日应付的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
(3)除管理费及托管费之外的基金费用
基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
2.与基金销售有关的费用
(1)申购费
本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。
本基金的申购费率如下:

| 申购金额(含申购费) | 前端申购费率 |
|----------------|-----------|
| 50万元以下 | 1.5% |
| 50万元(含)至100万元 | 1.2% |
| 100万元(含)至200万元 | 0.8% |
| 200万元(含)至500万元 | 0.6% |
| 500万元以上(含500万) | 每笔交易1000元 |

| 申购金额(含申购费) | 后端申购费率 |
|------------|--------|
| 1年以内(含) | 1.8% |
| 1年-3年(含) | 1.2% |
| 3年-5年(含) | 0.6% |
| 5年以上 | 0 |

| 申购金额(含申购费) | 前端特定申购费率 |
|------------|----------|
|------------|----------|