

(上接B069版)

法定代表人:陈林  
联系人:宋歌  
电话:021-68778081  
传真:021-68778117  
客服电话:4008209898  
公司网址:www.cnhbstock.com  
(42)平安证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
(510408)  
法定代表人:谢永林  
联系人:吴琼  
电话:0755-22621866  
传真:0755-62400062  
客服热线:95511-8  
公司网址:www.PINGAN.com  
(43)长江证券股份有限公司  
注册地址:武汉市新华路特8号江汉证券大厦  
办公地址:武汉市新华路特8号江汉证券大厦  
法定代表人:杨泽柱  
联系人:李良  
电话:027-65799999  
传真:027-85481900  
客服电话:95579或4008-888-999  
公司网址:www.95579.com  
(44)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  
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  
电话:010-63081000  
传真:010-63090078  
客服电话:400-800-8899  
公司网址:www.cindasc.com  
(45)华安证券有限责任公司  
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号  
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号智财中心B1  
法定代表人:李工  
联系人:甘霖  
电话:0551-65161821  
传真:0551-65161672  
客服电话:0551-96518或4008096518  
公司网址:www.hazzq.com  
(46)上海证券有限责任公司  
注册地址:上海市西藏中路336号  
办公地址:上海市西藏中路336号  
法定代表人:郁忠民  
联系人:张瑾  
电话:021-53519888-1915  
传真:021-33033353  
客服电话:4008918918  
公司网址:www.shzq.com  
(47)广州证券股份有限公司  
注册地址:广州市珠江西路6号广州国际金融中心主塔19,20楼  
办公地址:广州市珠江西路6号广州国际金融中心主塔19,20楼  
法定代表人:邵三发  
联系人:林洁茹  
电话:020-88369999  
传真:020-88336654  
客服电话:020-961303  
公司网址:www.gzs.com.cn  
(48)长城瑞证券有限公司  
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
法定代表人:傅毅辉  
联系人:卢金文  
电话:0592-5161642  
传真:0592-5163588  
公司网址:www.xmzq.com.cn  
(49)中信证券股份有限公司  
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第八层  
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  
联系人:陈忠  
电话:010-60833722  
传真:010-60833739  
客服热线:95568  
公司网址:www.cs.ecitic.com  
(50)五矿证券有限公司  
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层  
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49层  
法定代表人:张永衡  
联系人:鞠君伟  
电话:0755-23902400  
传真:0755-62545500  
客服热线:40018-40028  
公司网址:www.wkzq.com.cn  
(51)九州证券有限公司  
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  
联系人:聂晗  
电话:0755-33331188  
传真:0755-3329815  
客服热线:4006543218  
公司网址:www.tyzq.com.cn  
(52)上海华信证券有限责任公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼  
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼  
法定代表人:罗浩  
联系人:倪丹  
电话:021-38794818  
传真:021-68777877  
公司网址:www.cf-clsa.com  
(53)万联证券有限责任公司  
注册地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、  
19层  
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、  
19层  
法定代表人:张建军  
联系人:王鑫  
电话:020-38296588  
传真:020-38296588  
客服热线:400988133  
公司网址:www.wlzb.com.cn  
(54)深圳众禄金融控股股份有限公司  
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I,J单  
元  
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I,J单  
元  
法定代表人:薛峰  
联系人:张玉静  
电话:0755-33227953  
传真:0755-82080798  
客服热线:4006-788-887  
公司网址:www.zifund.com 及 www.jjmmw.com  
(55)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  
(b)单元  
法定代表人:俞洋  
电话:021-64339000  
注册资本:16亿元人民币  
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号  
邮政编码:200030  
联系人:杨莉娟  
业务联系电话:021-54967202  
传真电话:021-54967293  
华鑫证券公司网站:www.cfsc.com.cn  
客户服务电话:021-32109999-029-68918888;4001099918  
(56)国海证券股份有限公司  
注册地址:广西桂林市辅星路13号  
办公地址:广西南宁市滨湖路46号  
法定代表人:张雅峰  
联系人:牛孟宇  
电话:0755-83709350  
传真:0755-83704850  
客服热线:95563  
公司网址:www.ghzq.com.cn  
(57)国金证券股份有限公司  
注册地址:四川省成都市东城根上街96号

办公地址:四川省成都市东城根上街96号  
法定代表人:冉云  
联系人:刘婧漪  
电话:028-86690057  
传真:028-86690126  
客服热线:4006600109  
公司网址:www.gjzq.com.cn  
(58)浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址:浙江省杭州市西湖区文二西路1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:凌顺平  
联系人:杨翼  
电话:0571-8891818转8665  
传真:0571-86800423  
客服热线:4008-773-772  
公司网址:www.5ifund.com  
(59)诺亚正行(上海)基金销售顾问有限公司  
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼  
法定代表人:王静波  
联系人:方成  
电话:021-39600735  
传真:021-38509777  
客服热线:400-821-5399  
公司网址:www.noah-fund.com  
(60)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2楼2层  
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼  
法定代表人:其实  
联系人:潘世发  
电话:021-54509998  
传真:021-64395308  
客服热线:400-1818-188  
公司网址:www.1234567.com.cn  
(61)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东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:021-60897840  
传真:0571-26695333  
客服热线:4000-766-123  
公司网址:www.fund123.cn  
(62)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  
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:张伟洪  
联系人:张裕  
电话:021-20835779  
传真:021-20835895  
客服热线:400-920-0022  
公司网址:www.hicaikehexun.com/  
(63)上海长量基金销售有限公司  
代销机构: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626号2幢220室  
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层  
法定代表人:张伟洪  
联系人:敖玲  
电话:021-5878678-8201  
传真:021-58786938  
客服电话:400-089-1289  
公司网址:www.erichfund.com  
(64)上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号  
办公地址:上海市浦东新区南泉路1118号鄂尔多斯国际大厦  
法定代表人:王莉  
联系人:于杨  
电话:021-20835779  
传真:021-20835895  
客服热线:400-700-9665  
公司网址:www.ewhbuy.com  
(65)上海汇付金融服务有限公司  
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼  
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼  
法定代表人:陈云卉  
联系人:敖玲  
电话:021-33323999  
传真:021-33322380  
客服热线:4008202819  
公司网址:http://www.chinapnr.com/  
(66)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:郭坚  
联系人:宁博宇  
电话:021-20665962  
传真:021-22066563  
联系人邮箱:NDINGBOYOU657@pingan.com.cn  
客户服务电话:4008219031  
网址:www.lufunds.com  
(68)上海联泰资产管理有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特路277号3层310室  
办公地址:上海市长宁区福泉北路618号8层3层  
法定代表人:燕斌  
联系人:陈东  
电话:021-52262033  
传真:021-52975270  
客服热线:400-466-788  
公司网址:www.66zichan.com  
(69)大泰金石投资管理有限公司  
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼  
办公地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼  
A500室  
办公地址:上海市长宁区虹桥路1396号文广大厦16楼  
法定代表人:袁顾明  
联系人:朱真卿  
电话:18616752315  
传真:021-22268089  
客服热线:021-22267943  
公司网址:www.dtfortune.com/  
(70)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号楼一层  
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼一层  
法定代表人:徐黎云  
联系人:宋舒  
电话:0571-88337888  
传真:0571-88337666  
客服热线:400-068-0058  
公司网址:www.jincheng-fund.com  
(67)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:021-20665962  
传真:021-22066563  
联系人邮箱:NDINGBOYOU657@pingan.com.cn  
客户服务电话:4008219031  
网址:www.lufunds.com  
(68)上海联泰资产管理有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特路277号3层310室  
办公地址:上海市长宁区福泉北路618号8层3层  
法定代表人:燕斌  
联系人:陈东  
电话:021-52262033  
传真:021-52975270  
客服热线:400-466-788  
公司网址:www.66zichan.com  
(69)大泰金石投资管理有限公司  
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼  
办公地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼  
A500室  
办公地址:上海市长宁区虹桥路1396号文广大厦16楼  
法定代表人:袁顾明  
联系人:朱真卿  
电话:18616752315  
传真:021-22268089  
客服热线:021-22267943  
公司网址:www.dtfortune.com/  
(70)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号楼一层  
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼一层  
法定代表人:徐黎云  
联系人:宋舒  
电话:0571-88337888  
传真:0571-88337666  
客服热线:400-068-0058  
公司网址:www.jincheng-fund.com  
(71)国金基金管理有限公司  
注册地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)  
办公地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)  
法定代表人:王炯  
联系人:钱巍  
电话:021-50509888  
传真:021-50509884  
客户服务电话:400-821-0588(免长途话费)  
网站:www.sctfund.com.cn  
(72)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)31356600  
联系人:陆奇  
经办律师:黎黎,陆奇  
四,审计会计师事务所  
名称:江苏天衡会计师事务所有限公司  
注册地址:南京市正洪街18号东宇大厦6楼  
办公地址:南京市正洪街18号东宇大厦6楼  
法定代表人:余瑞华

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01,B01  
(b)单元  
法定代表人:俞洋  
电话:021-64339000  
注册资本:16亿元人民币  
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号  
邮政编码:200030  
联系人:杨莉娟  
业务联系电话:021-54967202  
传真电话:021-54967293  
华鑫证券公司网站:www.cfsc.com.cn  
客户服务电话:021-32109999-029-68918888;4001099918  
(56)国海证券股份有限公司  
注册地址:广西南宁市滨湖路46号  
法定代表人:张雅峰  
联系人:牛孟宇  
电话:0755-83709350  
传真:0755-83704850  
客服热线:95563  
公司网址:www.ghzq.com.cn  
(57)国金证券股份有限公司  
注册地址:四川省成都市东城根上街96号

经办银行会计师:谈建忠 魏娜  
电话:025-84711188  
传真:025-8471688  
四,基金的名称  
本基金名称:东吴配置优化混合型证券投资基金  
五,基金的类型  
基金的类别:混合型基金  
六,基金的投资目标  
该基金主要投资于具有持续竞争优势的企业,追求基金资产长期增值。  
七,基金的投资范围  
该基金投资范围限于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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),债券、货币市场工具、权证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(但须符合中国证监会的相关规定)。  
该基金投资组合的资产配置范围为:股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为30%~80%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为20%~70%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
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。  
八,基金的投资策略  
(一)投资目标  
该基金主要投资于具有持续竞争优势的企业,追求基金资产长期增值。  
(二)投资范围  
该基金投资范围限于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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),债券、货币市场工具、权证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(但须符合中国证监会的相关规定)。  
该基金投资组合的资产配置范围为:股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为30%~80%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为20%~70%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
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。  
(三)投资策略  
该基金在严格风险控制的基础上,追求稳健收益。  
1,资产配置策略  
对于大类资产的配置,该基金主要由投资研究团队根据对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势和风险收益水平,在各大类资产投资比例限制前提下,根据各大类资产风险收益分析结果,并结合该基金风险收益目标,最终确定、调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例。  
2,股票投资策略  
(1)行业配置策略  
在中国经济成长和结构转型的发展过程中,不同时期各行业显示的景气度将不同。该基金采用定性和定量相结合的方法,动态优选不同经济周期阶段的景气行业。首先对行业进行定性筛选,该基金主要从市场需求、技术进步、政策变动、行业整合等因素,同时结合行业的特性,把握各行业发展趋势和市场波动特征,优选出明期超越市场平均收益率的行业,其次使用量方法对行业配置比例进行优化。该基金采用行业配置模型为行业配置比例提供参考,该基金的投资研究团队将根据定量分析结果对定性研究的结果进行调整之后,形成最终的资产配置方案。  
(2)股票配置策略  
本基金将严格按照、但不限于以下七个成长性指标、五个价值性指标以及5%的净资产增长率为标准,具体将对上市公司的成长性进行筛选,精选出具有较大成长性优势的上市公司。  
A,成长性模块  
本基金将按照、但不限于以下七个成长性指标对上市公司的成长性进行筛选,精选出具有较大成长性优势的上市公司。  
表11-1:成长模块衡量成长性定量指标  
表11-2:价值模块衡量股票价值定量指标  
B,价值性模块  
本基金将按照、但不限于以下五个价值性指标对上市公司价值性进行筛选。  
表11-2:价值模块衡量股票价值定量指标  
C,东吴基金企业竞争优势评价体系  
该基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”,精选出具有综合竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。  
(3)股票池调整法则  
原则上,本基金根据上市公司定期报告对股票池进行相应调整。在宏观经济环境、行业基本面和市场指数发生重大变化情况下,可进行临时调整,同时,可根据行业研究员调研情况和研究成果,综合考虑上市公司的行业趋势、公司基本面、估值水平等方面的情况对该基金股票池进行个别调进调出。  
3,债券投资策略  
本基金将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的扩张特征,制定相应的债券投资策略,以获取利息收益为主、资本利得为辅。  
(1)积极的流动性管理  
本基金将紧密关注央行对于流动性的调节以及市场的资金松紧,该基金的申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等,建立组合流动性管理框架,实现对基金资产的结构化管理,以确保基金资产的整体变现能力。  
(2)基于收益率预期的期限配置和类别配置  
在预期基准利率下降时,适当增加组合久期,以较多地获得债券价格上涨带来的收益,同时获得比较稳定的利息收入;在预期基准利率上升时,缩短组合久期,以规避债券价格下降的风险。  
(3)基于收益率曲线形态的调整策略  
在确定组合久期的情况下,预期收益率曲线的形态调整债券组合的基本配置。当我们预期收益率曲线变陡时,我们可能采用子弹策略;而当预期收益率曲线变平时,我们可能采用杠铃策略,总体而言,就是在仔细评估收益率曲线形态情况下,分别在子弹组合、梯式组合和杠铃组合中进行个别调进调出。  
(4)基于相对利差分析调整信用产品配置  
观察金融债(国债、短期融资券)的相对利差调整组合的信用产品,在稳定的信用产品风险情况下,可在利差扩大时,适当增加信用产品比重;在利差缩小时,适当减持信用产品。  
4,权证投资策略  
本基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其理论定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。具体投资方法如下:  
考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值。  
根据权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。  
九,基金的业绩比较基准  
基金业绩比较基准=60%\*沪深300指数+40%\*中国债券综合全价指数  
十,基金的风险收益特征  
本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金,债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。  
十一,基金投资组合报告  
东吴配置优化混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金管理人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2016年1月15日复核了本报表中的财务指标、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。  
本报表及所载数据截至2015年12月31日(未经审计)  
1,报告期末基金资产组合情况  
表12-1:报告期末基金资产组合情况  
2,报告期末按行业分类的股票投资组合  
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  
票投资明细  
表12-2: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  
票投资明细  
4,报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
表12-3:报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
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  
券投资明细  
表12-4: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  
券投资明细  
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  
本基金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  
投资明细  
本基金报告期末未持有权证。  
9,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证券  
券投资明细  
本基金报告期末未持有证券。  
10,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基金  
投资明细  
本基金报告期末未持有基金。  
11,报告组合报告附注  
本基金报告期末未持有权证。  
12,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基金  
投资明细  
本基金报告期末未持有基金。  
13,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基金  
投资明细  
本基金报告期末未持有基金。  
14,投资组合报告附注  
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。  
十二,基金的业绩  
本基金管理人承诺以诚实信用、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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
1,东吴配置优化混合型基金历史时间段净值增长率与同期业绩比  
较基准收益率  
本基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”,精选出具有综合竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。  
2,基金净值增长率  
在确定组合久期的情况下,预期收益率曲线的形态调整债券组合的基本配置。当我们预期收益率曲线变陡时,我们可能采用子弹策略;而当预期收益率曲线变平时,我们可能采用杠铃策略,总体而言,就是在仔细评估收益率曲线形态情况下,分别在子弹组合、梯式组合和杠铃组合中进行个别调进调出。  
3,基金净值增长率  
本基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”,精选出具有综合竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。  
4,基金净值增长率  
本基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”,精选出具有综合竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。  
5,基金净值增长率  
本基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”,精选出具有综合竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。  
6,基金净值增长率  
本基金将根据“东吴