（上接B021版）

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：梁蓉
联系人：张晶晶
电话：010-66154828
传真：010-88067526
客户服务电话：010-88067525
网址：www.5irich.com
（93）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：胡明会
电话：010-59200855
传真：010-59200800
客户服务电话：400-819-9868
网址：www.tdyhfund.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，并及时履行公告义务。
（二）注册登记人
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
法定代表人：赵如冰
电　话：（0755）82370388－1668
传　真：（0755）22381325
联系人：杨波
（三）律师事务所及经办律师
名　称：北京市金诚同达律师事务所
住　所：北京建国门外大街甲24号东海中心17层
负责人：田予
电　话：（010）65155566
传　真：（010）65263519
经办律师：贺宝银、徐志浩
（四）会计师事务所及经办注册会计师
法定名称：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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：杨绍信
电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办注册会计师：单峰、陈熹

四、基金的名称

景顺长城景系列开放式证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、货币市场基金份额的分级

本系列基金下设货币市场基金自2010年4月30日起实行基金份额分级，根据投资者持有货币市场基金的份额等级适用不同的销售服务费率。自2010年4月30日起，货币市场基金分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。两级基金份额分设不同基金代码，两级基金份额单独公布每万份基金净收益和基金七日年化收益率。

基金费率及分级规则

1、A级与B级基金份额的交易限额和适用费率如下表所示：

	A级基金份额	B级基金份额
申购费	0	0
赎回费	0	0
销售服务费	0.25%	0.01%
首次申购最低金额	1元	1元
追加申购最低金额	不限	不限
定期定额申购最低金额	1元	不适用
单笔赎回最低限额	0.01份	0.01份
单个基金账户保留的最低持有份额	不适用	500万份
在销售机构保留的最低持有份额	1份	1份

注：货币市场基金当期基金收益结转基金份额，不受最低申购金额的限制，货币市场基金B级基金份额暂不开通定期定额投资计划。2、份额分级规则：

基金份额分级后，在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的货币市场基金份额超过500万份（包含500万份）时，注册登记机构将自动升级其单个基金账户内持有的可用基金份额为B级基金份额，未结转收益将不结转，一并带入B级份额，并于升级当日适用B级的相关费率。

基金份额分级后，在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的货币市场基金份额低于500万份（不含500万份）时，注册登记机构将自动降级其单个基金账户内持有的可用基金份额为A级基金份额，未结转收益将不结转，一并带入A级份额，并于降级当日适用A级的相关费率。

基金份额分级规则自2010年4月30日起生效，自该日起，注册登记机构将根据投资者基金账户所持有的货币市场基金份额数量，进行份额级别判断和处理，并适用A、B级相关费率。

基金份额分级后，对在开放日参与基金份额升降级确认的投资者，其在当日提交的货币市场基金转换转出、转托管转出等申请，注册登记机构将在下一开放日做失败确认处理。

七、基金的转换

（一）本系列基金的转换费用

本系列基金的转换费用由赎回费和申购补差费组成，转出时收取赎回费，转入时收取申购补差费。其中赎回费的收取标准遵循本招募说明书的约定，申购补差费的收取标准为：申购补差费＝ MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】。

（二）转换交易的计算方式

本系列基金的转换交易包括了基金转出和基金转入，其中：

①基金转出时赎回费的计算：

由优选股票基金或动力平衡基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益 （全额转出时）

赎回费用＝转出总额×转出基金赎回费率

转出净额＝转出总额－赎回费用

②基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额＝转出净额－申购补差费

其中，申购补差费＝ MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】

转入份额＝净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

例：投资者申请将持有的优选股票基金10,000份转换为景顺长城内需增长开放式证券投资基金，假设转换当日优选股票基金的基金份额净值为1.148元，投资者持有该基金18个月，对应赎回费为0.25%，申购费为1.5%，内需增长基金的基金份额净值为1.163元，申购费为1.5%，则投资者转换后可得到的内需增长基金份额为：

转出总额＝10,000×1.148＝11,480元

赎回费用＝11,480×0.25%＝28.70元

转出净额＝11,480－28.7＝ 11,451.3元

转出净额在转入基金中对应的净申购金额＝11,451.3/1.015＝11,282.07元

转出净额在转入基金中对应的申购费用＝11,451.3－11,282.07＝169.23元

转出净额在转出基金中对应的净申购金额＝11,451.3/1.015＝11,282.07元

转出净额在转出基金中对应的申购费用＝11,451.3－11,282.07＝169.23元

净转入金额＝11,451.3－MAX【169.23－169.23，0】＝11,451.3元

转入份额＝11,451.3 / 1.163＝9,846.34份

八、基金的投资目标

本系列基金的投资目标是：运用专业化的投资管理，为投资者提供长期稳定并可持续的资本增值。各基金投资目标如下：

1、优选股票基金利用“景顺长城股票数据库”对股票进行精密和系统的分析，构建具有投资价值的股票组合，力求为投资者提供长期的资本增值。

2、货币市场基金在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。

3、动力平衡基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标，注重通过动态的资产配置以达到当期收益与长期资本增值的兼顾，争取为投资者提供长期稳定的回报。

九、基金的投资方向

本系列基金下设的优选股票基金和动力平衡基金的投资范围包括股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的A股；债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转换债券等。

本系列基金下设的货币市场基金投资于以下金融工具：

1、现金；

2、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；

3、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；

4、期限在一年以内（含一年）的债券回购；

5、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；

6、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

十、基金的投资策略

1、资产配置

本系列基金下优选股票基金和动力平衡基金均有债券和股票资产，但是配置比例显著不同：

优选股票基金	动力平衡基金
股票：70－80% 债券：20－30%	股票：20－80% 债券：20－80%

*百分比为占基金资产净值比例。

2、优选股票基金和动力平衡基金的股票选择及组合构建

（1）投资流程

在构建和管理投资组合过程中，这两只基金主要采取“自下而上”的投资策略，着重选择基本面良好或价值被过分低估的股票。同时，也会结合“自上而下”的投资策略，即基于对宏观经济运行状况及政策分析、金融货币运行状况及政策分析、产行业运行景气状况及政策分析，做出产行业偏好选择，进而结合证券市场状况和政策分析，做出资产配置及组合构建的决定。

（2）选股原则

股票投资以成长、价值及收益为基础，在合适的价位买入具有高成长性的成长型股票、价值被市场低估的价值型股票以及能提供稳定收益的收益型股票。

（3）选股程序

① 通过“景顺长城股票数据库”的详细分析与其他深入的研究，如实地考察、电话会议、行业分析等，判断股票是否值得投资，然后组建“股票买进名单”；

② 在深入研究的基础上（包括对各种量化指标的分析，结合各券商的投资分析报告），综合公司的分析判断，做出对所研究股票的投资结论，并持续维护“股票买进名单”；

③ 根据基金的投资目标、投资限制和投资策略等要求，考虑收益和风险的配比、股票的流动性以及其它因素，推荐不同基金的股票买进名单。

3、债券选择和组合构建

（1）投资流程

本系列基金下各基金债券投资部分着重本金安全性和流动性。综合分析宏观经济形势，并对货币政策与财政政策以及社会政治状况等进行研究，着重利率的变化趋势预测，建立对收益率曲线变动的预测模型。通过该模型进行估值分析，确定价格中枢的变动趋势；同时，计算债券投资组合久期、到期收益率和期限等指标，进行“自下而上”的选券和债券品种配置。

（2）债券投资组合管理

① 组合久期管理：为了充分地控制利率变动风险，需要及时对债券投资组合进行调整。当预测利率将上升时，本系列基金将缩短组合债券的平均久期、持有短期债券、浮动债等来减低利率风险；反之，当预测利率将下降时，本系列基金将增大组合的平均久期并增持长期债券来提高组合的收益水平。在组合久期确定后，本系列基金将通过不同期限债券的匹配组合，从价格的相对变化中获得较高的收益。

② 资产配置：在未来利率走势预期的基础上，本系列基金通过久期与凸性管理的手段，在不同期限的债券以及固息债与浮息债之间进行配置。 同时，本系列基金以市场规模、收益率与流动性为基础，在不同市场以及不同的债券类别之间进行配置。

③ 债券选择

本系列基金在考虑信用质量和期限等因素后，将选择以下类型的债券：

- 到期收益率较高、具有较好流动性的债券
- 有较高当期收入的债券
- 有增值潜力、价格被低估（即收益率和久期过分偏离合理水平）的债券
- 预期信用质量将得到改善的金融债或企业债券
- 期权和债性突出的可转换债
- 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

④ 组合构建：本系列基金通过宏观经济分析，对利率走势做出判断，在此基础上对各类资产进行合理配置。同时，本系列基金根据收益率和流动性、债券资质“自下而上”地进行个券选择，组成最终的投资组合。在确定具体个券后，须依据下列标准构建投资组合：

- 确保执行投资策略并确保投资组合久期在规定的范围内
- 保持投资组合分散化，基金持有单一债券品种不得超过基金净值的10%
- 保持投资组合的流动性，以满足基金正常现金流的需要
- 控制投资组合风险在一定的范围内
- 债券投资组合中，债券信用等级最低为BBB+或同等信用，投资组合的平均信用等级应在AA+或以上

⑤ 组合优化：在债券组合管理中开发出独有的程序对债券组合定期进行量化分析，包括精确计算组合的VAR值、贡献分析、跟踪误差等指标，根据量化分析结果对债券组合品种进行相应的配置调整，并通过了解组合的风险特征、预算，按照宏观经济分析模型预测和企业信用分析的结果，对组合做出连续的优化调整。

⑥ 现金和回购资产：保留足够的现金以应付基金日常的现金需要。

4、货币市场基金的投资决策程序和方法：

（1）投资决策程序

①基金经理依据投资部对宏观经济、货币政策、财政政策以及市场资金供求状况的综合分析，对短期利率变化趋势做出判断，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议；

②投资决策委员会审核基金经理提交的资产配置建议，并最终决定资产配置方案；

③基金经理对各投资品种进行收益率、流动性、信用风险、平均剩余期限分析，同时根据未来利率变化的预期以及投资品种的利率敏感性来综合评定各品种的投资价值；

④基金经理结合经审定的资产配置方案、基金日常申购、赎回情况进行具体的投资组合构建。

⑤投资决策委员会审核重大基金投资组合方案，如无异议，由基金经理具体执行投资计划。

（2）投资管理方法

①深入分析宏观经济、货币政策和市场资金供求变化，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金的资产配置策略。

②通过利率预期策略，确定组合的平均剩余期限和各类资产的配置比例。

③通过流动性管理策略，在保持基金资产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。

④以严谨的研究分析为基础，积极实施时机策略。

本系列基金会持续地进行定期与不定期的投资组合回顾与风险监控，适时做出相应调整。

十一、基金的业绩比较基准

优选股票基金：上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数×80%＋中国债券总指数×20%。

货币市场基金：自2010年4月30日起，本基金的业绩比较基准由原先的“税后一年期定期存款利率”变更为“税后同期7天存款利率”。当市场上有更加适合的业绩比较基准，在不损害投资者利益的前提下，基金管理人有权按照相关规定对本基金的业绩比较基准进行变更并公告。

动力平衡基金：自2010年1月29日起，动力平衡的业绩比较基准由原先的“一年期银行定期存款年利率的2倍”变更为“沪深300指数收益率×50%＋中国债券总指数收益率×45%＋ 银行同业存款收益率×5%”。

十二、基金的风险收益特征

优选股票基金是一种具有较高波动性和较高风险的投资工具。适合风险承受能力强、追求高投资回报的投资群体。

货币市场基金具有低风险和收益稳定的特点，投资目标是在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。

动力平衡基金是一种具有中等风险的投资工具，除了结合以上景顺长城股票及债券基金的风险管理程序以外，为达到平稳回报的目的，该基金还将独立地对风险来源进行评估，并设立额外的风险控制管理手段。

十三、基金投资组合报告（未经审计）

景顺长城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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，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3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

优选股票基金投资组合报告

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	1,754,675,299.80	77.15
	其中：股票	1,754,675,299.80	77.15
2	固定收益投资	450,361,500.00	19.80
	其中：债券	450,361,500.00	19.80
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	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	53,851,417.26	2.37
7	其他资产	15,361,923.09	0.68
8	合计	2,274,250,140.15	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、渔业	－	－
B	采矿业	－	－
C	制造业	975,162,214.59	43.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	117,933,677.88	5.25
E	建筑业	166,675,729.65	7.43
F	批发和零售业	143,617,892.00	6.40
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	135,449,988.20	6.03
J	金融业	－	－
K	房地产业	－	－
L	租赁和商务服务业	171,482,670.00	7.64
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	24,131,354.40	1.07
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	20,221,773.08	0.90
S	综合	－	－
	合计	1,754,675,299.80	78.17

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	300058	蓝色光标	4,704,600	171,482,670.00	7.64
2	002081	金 螳 螂	4,739,145	166,675,729.65	7.43
3	000977	浪潮信息	2,129,644	124,903,620.60	5.56
4	000958	东方能源	5,680,813	117,933,677.88	5.25
5	600313	农发种业	6,991,930	116,275,795.90	5.18
6	300026	红日药业	3,041,202	99,751,425.60	4.44
7	300072	三聚环保	2,155,093	81,462,515.40	3.63
8	000917	电广传媒	3,212,902	77,430,938.20	3.45
9	600129	太极集团	3,600,924	76,411,607.28	3.40
10	002311	海大集团	3,557,109	68,225,350.62	3.04

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	国家债券	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	450,361,500.00	20.06
	其中：政策性金融债	450,361,500.00	20.06
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债	－	－
8	其他	－	－
9	合计	450,361,500.00	20.06

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	140311	14进出11	800,000	80,568,000.00	3.59
2	140207	14国开07	750,000	75,022,500.00	3.34
3	140443	14农发43	700,000	70,042,000.00	3.12
4	140305	14进出05	550,000	55,588,500.00	2.48
5	110417	11农发17	500,000	50,055,000.00	2.23

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

9.1 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持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

10.2 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持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	492,132.63
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	10,193,099.72
5	应收申购款	4,676,690.74
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	15,361,923.09

11.4 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。

11.5 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	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600129	太极集团	76,411,607.28	3.40	重要事项未公告

货币市场基金投资组合报告

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	固定收益投资	540,347,615.76	48.29
	其中：债券	540,347,615.76	48.29
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	249,537,024.30	22.30
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	284,705,641.69	25.44
4	其他资产	44,322,689.44	3.96
5	合计	1,118,912,971.19	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含货币基金定期存款280,000,000.00元。

2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.17	
	其中：买断式回购融资	－	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	24,999,867.50	2.30
	其中：买断式回购融资	－	－

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3. 基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	26
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	38
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	77.69	2.30
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天(含)－60天	6.44	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
3	60天(含)－90天	7.36	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天(含)－180天	7.37	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	180天(含)－397天(含)	－	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
合计		98.86	2.30

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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	120,021,412.58	11.04
	其中：政策性金融债	120,021,412.58	11.04
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	420,326,203.18	38.67
6	中期票据	－	－
7	其他	－	－
8	合计	540,347,615.76	49.71
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	－

5. 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041454022	14长电CP001	800,000	80,162,935.10	7.37
2	011473008	14鲁高速SCP008	500,000	50,097,891.22	4.61
3	011419006	14国电SCP006	500,000	50,021,450.79	4.60
4	041461022	14苏交通CP004	500,000	50,019,537.64	4.60
5	140429	14农发29	500,000	50,008,949.27	4.60
6	071546001	15国元证券CP001	500,000	49,995,581.81	4.60
7	140207	14国开07	400,000	40,005,838.89	3.68
8	140213	14国开13	300,000	30,006,624.42	2.76
9	041456047	14苏交通CP005	300,000	30,005,288.51	2.76
10	011473009	14鲁高速SCP009	300,000	30,001,234.10	2.76

6. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)－0.5%间的次数	－
报告期内偏离度的最高值	0.2001%
报告期内偏离度的最低值	0.0677%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1476%

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。

8. 投资组合报告附注

8.1本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为1.0000 元。

8.2

本报告期内，本基金未持有剩余期限小于397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券，也不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

8.3

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	15,478,322.92
4	应收申购款	28,844,366.52
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	44,322,689.44

动力平衡基金投资组合报告

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	2,930,764,599.54	74.42
	其中：股票	2,930,764,599.54	74.42
2	固定收益投资	765,183,000.00	19.43
	其中：债券	765,183,000.00	19.43
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	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	175,090,683.21	4.45
7	其他资产	67,277,562.24	1.71
8	合计	3,938,315,844.99	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、渔业	－	－
B	采矿业	－	－
C	制造业	926,050,091.59	24.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	204,932,891.85	5.43
F	批发和零售业	158,255,138.65	4.19
G	交通运输、仓储和邮政业	18,033,226.20	0.48
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	801,356,270.66	21.23
J	金融业	71,511,360.00	1.89
K	房地产业	571,230,972.20	15.13
L	租赁和商务服务业	132,841,282.87	3.52
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	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	46,553,365.52	1.23
S	综合	－	－
	合计	2,930,764,599.54	77.64

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	300020	银江股份	4,622,870	205,255,428.00	5.44
2	002285	世联行	5,241,592	203,268,937.76	5.38
3	000333	美的集团	4,625,617	152,414,080.15	4.04
4	300075	数字政通	2,202,978	137,267,559.18	3.64
5	000917	电广传媒	5,470,462	131,838,134.20	3.49
6	600340	华夏幸福	2,315,921	128,255,704.98	3.40
7	002555	顺荣三七	1,515,483	101,355,503.04	2.68
8	300115	长盈精密	3,319,641	97,863,016.68	2.59
9	002081	金 螳 螂	2,751,995	96,787,664.15	2.56
10	000090	天健集团	5,178,613	92,697,172.70	2.46

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	国家债券	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	765,183,000.00	20.27
	其中：政策性金融债	765,183,000.00	20.27
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债	－	－
8	其他	－	－
9	合计	765,183,000.00	20.27

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	140207	14国开07	2,900,000	290,087,000.00	7.68
2	140218	14国开18	1,350,000	135,054,000.00	3.58
3	140444	14农发44	700,000	70,084,000.00	1.86
4	140327	14进出27	600,000	60,012,000.00	1.59
5	140212	14国开12	500,000	50,010,000.00	1.32

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

9.1 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持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

10.2 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持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	716,164.37
2	应收证券清算款	37,844,017.50
3	应收股利	－
4	应收利息	27,802,360.16
5	应收申购款	915,020.21
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	67,277,562.24

11.4 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。

11.5 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	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002555	顺荣三七	101,355,503.04	2.68	拟披露重大事项

十四、基金的业绩

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。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系列基金的招募说明书和更新招募说明书。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，已经复核了下列财务指标、净值表现等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

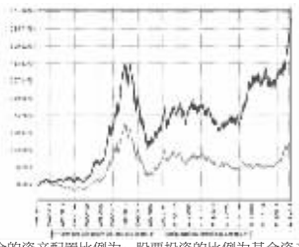
基金业绩数据截止2015年3月31日。

优选股票基金的净值表现

1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2003年10月24日-2003年12月31日	6.75%	0.62%	4.62%	0.97%	2.13%	-0.35%
2004年	7.63%	0.95%	-12.93%	1.07%	20.56%	-0.12%
2005年	3.32%	0.93%	-5.27%	1.12%	8.59%	-0.19%
2006年	130.58%	1.19%	92.74%	1.07%	37.84%	0.12%
2007年	96.12%	1.78%	79.80%	1.76%	16.32%	0.02%
2008年	-51.92%	2.19%	-54.74%	2.28%	2.82%	-0.09%
2009年	53.25%	1.49%	64.78%	1.53%	-11.53%	-0.04%
2010年	-1.09%	1.30%	-7.70%	1.15%	6.61%	0.15%
2011年	-19.82%	1.01%	-18.76%	0.96%	-1.06%	0.05%
2012年	14.29%	1.11%	3.07%	0.92%	11.22%	0.19%
2013年	39.69%	1.35%	-1.04%	0.94%	40.73%	0.41%
2014年	9.40%	1.17%	39.95%	0.84%	-30.55%	0.33%
2015年1月1日-2015年3月31日	34.74%	1.20%	16.89%	1.33%	17.85%	-0.13%
2003年10月24日-2015年3月31日	638.38%	1.36%	178.95%	1.31%	459.43%	0.05%

2、自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较



注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的70%至80