

(上接B052版)

39	华林证券有限责任公司	注册地址:北京市丰台区西四环南路65号7号楼401室 办公地址:深圳市福田区田田路179号华林大厦401室 法定代表人:宋志江 联系人:李强 联系电话:0755-82707857 客服电话:400-188-3888 公司网站:www.hualinsec.com	69	财富证券有限责任公司	注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼 办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼 法定代表人:蔡一兵 联系人:李强 联系电话:0755-82707857 客服电话:400-188-3888 公司网站:www.hualinsec.com
40	南京证券股份有限公司	注册地址:江苏省南京市大钟亭8号 法定代表人:卞国河 联系人:陈秀华 联系电话:025-8364032 公司网站:www.njzq.com	70	恒泰证券股份有限公司	注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东岸大厦14层 办公地址:北京市朝阳区东三环北路22号泛利大厦10层 法定代表人:庞介民 联系人:李强 联系电话:0471-3563168 公司网站:www.cnhth.com
41	华安证券股份有限公司	注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路181号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路181号恒信大厦B1座 法定代表人:李工 联系人:甘霖 联系电话:0551-65161821 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.haazq.com	71	华龙证券股份有限公司	注册地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼 办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0931-4890208 客服电话:4008-89-8888 公司网站:www.hlzq.com
42	红塔证券股份有限公司	注册地址:云南省昆明市北京路156号附1号红塔大厦9楼 办公地址:云南省昆明市北京路156号附1号红塔大厦9楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0871-63577946 公司网站:www.hongtasec.com	72	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 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号15楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-68779300 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.hxsec.com
43	国泰君安证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道19号光大银行大厦18楼 办公地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道19号光大银行大厦18楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:4008-096-188 公司网站:www.gtja.com	73	日信证券有限责任公司	注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东岸大厦14层 办公地址:北京市朝阳区东三环北路22号泛利大厦10层 法定代表人:庞介民 联系人:李强 联系电话:0471-3563168 公司网站:www.cnhth.com
44	浙商证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心702室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心702室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-68779300 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.zhzq.com	74	英大证券有限责任公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心702室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心702室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-68779300 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.ydsec.com
45	华宝证券有限责任公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心702室 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心702室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-68779300 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.hbsec.com	75	中天证券有限责任公司	注册地址:山西省太原市迎泽大街99号山西国际信托大厦10层 办公地址:山西省太原市迎泽大街99号山西国际信托大厦10层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:400-666-1618, 06673 公司网站:www.ztsec.com
46	山西证券股份有限公司	注册地址:山西省太原市迎泽大街99号山西国际信托大厦10层 办公地址:山西省太原市迎泽大街99号山西国际信托大厦10层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:400-666-1618, 06673 公司网站:www.ztsec.com	76	五矿证券有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 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:李强 联系人:李强 联系电话:0755-22383750 公司网站:www.wysec.com
47	第一创业证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 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:李强 联系人:李强 联系电话:0755-22383750 公司网站:www.fysec.com	77	大通证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 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:李强 联系人:李强 联系电话:0755-22383750 公司网站:www.fysec.com
48	华福证券有限责任公司	注册地址:福建省福州市五四路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、8层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0591-87338000 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.hfzq.com	78	天相投资顾问有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦701室 办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦701室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-66045618 公司网站:www.txsec.com
49	中山证券有限责任公司	注册地址:广东省深圳市福田区竹子林四路紫竹七道19号光大银行大厦18楼 办公地址:广东省深圳市福田区竹子林四路紫竹七道19号光大银行大厦18楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:4008-096-188 公司网站:www.zszq.com	79	联讯证券股份有限公司	注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1699号绿地国际金融中心3号楼 办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1699号绿地国际金融中心3号楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0791-86768881 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.lxsec.com
50	国海证券股份有限公司	注册地址:广西桂林市临桂区四一路1号 办公地址:广西桂林市临桂区四一路1号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0773-5709030 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.guohai.com	80	东兴证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦12、15层 办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦12、15层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-66655133 客服电话:4008-888800 公司网站:www.dxzq.com
51	中原证券股份有限公司	注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号 办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0371-66000342 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.ccnew.com	81	开源证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 办公地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:029-8862138 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.kysec.com
52	西南证券股份有限公司	注册地址:重庆市白象街10号 办公地址:重庆市白象街10号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:023-63789633 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.swsec.com	82	中邮证券有限责任公司	注册地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 办公地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:029-8862138 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.cnpsec.com
53	财达证券股份有限公司	注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0311-66000342 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.czd.com	83	中国民族证券有限责任公司	注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦701室 办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦701室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-66045618 公司网站:www.mzsec.com
54	德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼 办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-68779300 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.tebon.com	84	太平洋证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦701室 办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦701室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-66045618 公司网站:www.tpyzq.com
55	中航证券有限公司	注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1699号绿地国际金融中心3号楼 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1699号绿地国际金融中心3号楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0791-86768881 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.avicsec.com	85	宏信证券有限责任公司	注册地址:四川省成都市武侯区人民南路二段18号川信大厦10楼 办公地址:四川省成都市武侯区人民南路二段18号川信大厦10楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:028-86199278 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.hxsec.com
56	国元证券股份有限公司	注册地址:安徽省合肥市寿春路179号 办公地址:安徽省合肥市寿春路179号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0551-2634400 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.gyzq.com	86	诚浩证券有限责任公司	注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-22554400 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.chzsec.com
57	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市北京西路98号江信国际大厦10楼 办公地址:江西省南昌市北京西路98号江信国际大厦10楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0791-86768881 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.gssec.com	87	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:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-22554400 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.noah.com
58	中国国际金融有限公司	注册地址:北京市东城区建国门外大街22号 办公地址:北京市东城区建国门外大街22号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-65051166 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.cicc.com	88	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址: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:李强 联系人:李强 联系电话:0755-33226663 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.zlfund.com
59	大同证券经纪有限责任公司	注册地址:山西省大同市长治路111号山西世纪大厦12、13、14层 办公地址:山西省大同市长治路111号山西世纪大厦12、13、14层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0352-3130022 客服电话:4007-121212 公司网站:www.dtsbc.com	89	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 办公地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-35068881 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.howbuy.com
60	方正证券股份有限公司	注册地址:吉林省长春市净月大街156号 办公地址:吉林省长春市净月大街156号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0431-86000342 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.fundsec.com	90	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 办公地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-35068881 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.howbuy.com
61	方正证券股份有限公司	注册地址:吉林省长春市净月大街156号 办公地址:吉林省长春市净月大街156号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0431-86000342 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.fundsec.com	91	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 办公地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-35068881 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.howbuy.com
62	东海证券股份有限公司	注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼 办公地址:上海市浦东新区东方路1601号17楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0519-83860000 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.dhsec.com	92	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 办公地址:上海市虹口区四川北路1910号1501室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:021-35068881 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.howbuy.com
63	西部证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市东大街222号陕西信托大厦17-18层 办公地址:陕西省西安市东大街222号陕西信托大厦17-18层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:029-87406188 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.westsec.com	93	北京展恒基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号1101室 办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号1101室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-59006577 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.zhenh.com
64	新时代证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区德胜门内大街100号 办公地址:北京市西城区德胜门内大街100号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-83561146 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.xsdzq.com	94	浙江同顺基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市文二路100号1101室 办公地址:浙江省杭州市文二路100号1101室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0571-82296511 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.zjts.com
65	瑞银证券有限责任公司	注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:010-58232773 客服电话:400-887-8827 公司网站:www.ubssec.com	95	中邮证券有限责任公司	注册地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 办公地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:029-8862138 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.cnpsec.com
66	金元证券股份有限公司	注册地址:海口市世纪大道11号金元大厦11楼 办公地址:海口市世纪大道11号金元大厦11楼 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:0898-86666666 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.jysec.com	96	中邮证券有限责任公司	注册地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 办公地址:陕西省西安市唐都路9号陕西证券大厦11层 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:029-8862138 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.cnpsec.com
67	万联证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F1010室 办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F1010室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:020-38296511 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.wlzq.com	97	万联证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F1010室 办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F1010室 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:020-38296511 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.wlzq.com
68	国金证券股份有限公司	注册地址:成都市高新区天府二街166号 办公地址:成都市高新区天府二街166号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:028-86660000 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.gjzq.com	98	国金证券股份有限公司	注册地址:成都市高新区天府二街166号 办公地址:成都市高新区天府二街166号 法定代表人:李强 联系人:李强 联系电话:028-86660000 客服电话:4008-096-188 公司网站:www.gjzq.com

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	409,890,000.00	5.33
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	409,890,000.00	5.33
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,946,832.80	0.05
8	其他	-	-
9	合计	413,926,832.80	5.38

五) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	140212	14国开12	2,000,000	204,040,000.00	2.60
2	140223	14国开23	800,000	80,880,000.00	1.04
3	150202	15国开02	600,000	59,844,000.00	0.78
4	140218	14国开18	500,000	50,020,000.00	0.65
5	120219	12国开19	200,000	19,996,000.00	0.26

六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

十一) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2. 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之

外的股票。

3. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,872,771.93
2	应收证券清算款	82,010,716.57
3	应收利息	32,000.00
4	应收股利	12,567,137.24
5	应收申购款	7,719,447.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,189,072.77

4. 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5. 本基金本报告期末前十名股票中流通受限情况说明。

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	300069	东方财富	232,969,318.40	3.03	重大事项停牌
2	000025	长安汽车	207,197,791.74	2.69	重大事项停牌

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票不存在流通受限情况。

十二、基金的投资

基金管理人依照恪尽职守、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。基金的投资业绩并不代表其未来表

现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	净值增长率(1)	业绩比较基准增长率(2)	超额收益率(3)	(1)-(2)(4)	(2)-(4)(5)
2006.11.16-2006.12.31	21.13%	1.22%	25.77%	1.25%	-4.64%
2007.1.1-2007.12.31	149.22%	20.5%	117.93%	1.84%	31.29%
2008.1.1-2008.12.31	-49.47%	2.10%	-56.18%	2.44%	6.71%
2009.1.1-2009.12.31	59.48%	1.67%	73.61%	1.64%	-14.13%
2010.1.1-2010.12.31	2.38%	1.38%	-9.12%	1.26%	11.50%
2011.1.1-2011.12.31	-2.8%	1.07%	-19.47%	1.04%	-3.56%
2012.1.1-2012.12.31	74.6%	1.07%	70.79%	1.02%	0.42%
2013.1.1-2013.12.31	14.50%	1.20%	13.50%	1.11%	19.89%
2014.1.1-2014.12.31	127.73%	1.05%	116.67%	0.97%	-28.43%
2015.1.1-2015.3.31	27.54%	1.44%	26.40%	1.46%	-26.40%
自基金成立起至今	264.96%	1.56%	144.12%	1.51%	120.83%

十三、基金费用概览

一、与基金运作有关的费用

(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. 基金合同生效与基金相关的信息披露费;
4. 基金合同生效与基金相关的会计师事务所费;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金的证券交易费用;
7. 银行汇兑费用;
8. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金设立清算时发生费用,按实际支出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. 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,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2个工作日内从基金

财产中一次性支付给基金管理人。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

本基金的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×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,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2个工作日内从基金

财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第3-7项费用,根据有关法规及相应协议规定,按

费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目

1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金

财产的损失;

- 2. 基金管理人性和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3. 基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息

披露费用等费用;

- 4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 费用调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金托管费或基金托管费率,经

中国证监会核准后公告,此项调整不需要召开基金份额持有人大会。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规