

信息披露

信息披露

（上接A1版）

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

法定代表人：李岩
电话：0791-86778681
传真：0791-86770178
联系人：戴蔚
网址：www.wjw.com.cn
客户服务电话：400-886-6667

(94) 华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区福田路178号华泰大厦5、6层
办公地址：深圳市福田区福田路178号华泰大厦5、6层
法定代表人：薛荣年
电话：0756-82707855
传真：0756-32735761
联系人：杨芳
网址：www.htsc.com.cn
客户服务电话：400-188-3888

(95) 德邦证券股份有限公司
住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢楼C
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：姚文平
电话：021-68761616-8522
传真：021-68767032
联系人：叶卉
网址：www.tdb.com.cn
客户服务电话：400-888-8128

(96) 国信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区福源路101号南半幢楼C
办公地址：深圳市福田区福源路23号陕西大厦16-17楼
法定代表人：李剑虹
电话：0755-81281111
传真：029-87424426
联系人：刘莹
网址：www.guosen.com.cn
客户服务电话：400-888-8128

(97) 国联证券股份有限公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：姚文平
电话：0591-87336223
传真：0591-87336310
联系人：张旻
网址：www.guosen.com.cn
客户服务电话：400-888-8128

(98) 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：甘肃省兰州市中南路308号
法定代表人：李奇安
电话：0931-4890100
联系人：李昕田
网址：www.hlzq.com.cn
客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

(99) 中国国际金融股份有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
法定代表人：金立群
电话：010-65051166
传真：010-65051066
联系人：罗春涛、张文明
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010-65051166

(100) 朝晖证券股份有限公司
住所：杭州市文晖路15号新华国际商务中心
办公地址：杭州市文晖路15号新华国际商务中心
法定代表人：沈健宁
电话：0571-87925129
传真：0571-87918329
联系人：夏吉鑫
网址：www.chs.com.cn
客户服务电话：0571-96336

(101) 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荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层
办公地址：深圳市福田区益田路4003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：沈晓明
电话：0755-82026399
传真：0755-82026398
联系人：刘璇
网址：www.china-inv.com.cn
客户服务电话：400-600-9008、95532

(102) 江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：李永梅
电话：0451-82883719
传真：0451-82827211
联系人：刘爽
网址：www.jhzq.com.cn
客户服务电话：400-666-2288

(103) 国金证券股份有限公司
住所：成都市青羊区东城根上街95号
办公地址：成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人：冉云
电话：028-86930070
传真：028-86930126
联系人：刘一农
网址：www.gjzq.com.cn
客户服务电话：95105111（四川地区）、400-660-0109（全国）

(104) 中原证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区金台路2号新国都A座6层-9层
办公地址：北京市朝阳区金台路2号新国都A座6层-9层
法定代表人：魏东建
电话：010-59084041
传真：010-65653791
联系人：李微
网址：www.cc168.com.cn
客户服务电话：400-889-5618

(105) 安信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人：王连志
电话：028-86199382
传真：028-86199382
联系人：郝艳
网址：www.bhzq.cn
客户服务电话：400-836-6366

(106) 太平洋证券股份有限公司
住所：云南省昆明市高新区399号远大大厦18层
办公地址：北京市朝阳区光华路10号华远世纪中心D座3单元
法定代表人：李长伟
电话：010-85231717、18500562525
传真：010-852321763
联系人：唐昌田
网址：www.tpyzq.com.cn
客户服务电话：400-665-0999

(107) 国都证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

(二) 律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52622988
传真：010-52682990
联系人：李娜
经办律师：李宏安、李娜
(四) 会计师事务所
名称：安华会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市朝阳区东长安街1号东方广场东经观大厦A座16层
联系人：吴昊平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐德
经办注册会计师：徐德、蔡晓斌

(一) 登记机构名称
名称：华泰证券股份有限公司
住所：深圳市福田区天空宫裙楼3层A区04
办公地址：深圳市福田区金融大厦33号通泰大厦B座12层
法定代表人：郝军
客户服务电话：400-818-1818-6666
联系人：010-63136700
传真：010-63136700

重要策略包括：1、宏观分析：影响利率走势的主要因素；期限结构影响利率走势的主要因素；2、政策分析：财政部发债对短期利率走势的影响因素；央行票据发行对短期利率走势的影响因素；3、资金分析：市场资金余额、现金管理、4、交易方式：短期基金品种和流动性选择；5、基金业绩比较基准

(五) 业绩比较基准
在有效进行风险管理的前提下，通过对权证投资的基本面研究，结合多种期权定价模型，在确定权证合理价值的基础上，以主动投资为主，结合多种投资策略，开展权证投资业务。
主要投资策略包括但不限于：1、在权证价格和趋势判断的基础上，利用权证定价模型进行趋势投资；2、利用权证的价值有限性，运用权证作为组合管理工具；3、运用权证组合技术，构建新的投资组合策略。

(六) 基金的投资目标
60%≥沪深300指数+20%×中证综合债指数+20%×一年期银行存款利率
考虑本基金的投资理念、风格和投资方向等因素，选取具有定期存款利率优势或具备其他比较优势的机构构建。跟踪比较基准的变更需履行相关程序后，经基金管理人公告，并在更新的招募说明书中列示。

(七) 基金的风险收益特征
本基金属混合基金，风险与收益高于货币基金与债券市场基金，低于股票基金。本基金追求资产配置动态平衡，收益和长期资产增值平衡，风险适中。

(八) 基金的投资组合报告
以下内容摘自本基金2015年第三季度报告全文。
5.1 报告期末基金资产组合情况
金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,361,916,329.27	61.20
2	固定收益投资	1,361,916,329.27	61.20
3	贵金属投资	700,526,303.20	31.63
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	700,526,303.20	31.63
6	应收申购款	—	—
7	其他资产	—	—
8	合计	2,223,629,369.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
金额单位：人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	—	—
B	医药	—	—
C	制造业	1,162,369,693.1	64.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
K	建筑业	—	—
P	批发和零售业	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	1,361,916,329.27	63.59
合计		1,361,916,329.27	63.59

5.3 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
金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300212	顺络电子	2,614,266	176,338,967.0	8.23
2	300203	聚光科技	2,609,894	111,309,633.6	5.19
3	002085	万福生科	1,566,266	96,977,093.2	4.48
4	300078	中国铁建	1,399,028	94,839,016.6	4.43
5	300418	昆仑万润	85,316,366.6	4.12	
6	002627	永宏通信	5,000,000	79,060,000.0	3.64
7	002751	福耀玻璃	699,938	71,230,406.4	3.33
8	300039	汉国资本	800,000	67,248,000.0	3.14
9	600066	中国钢研	2,000,067	69,381,793.6	2.82
10	002377	新赛股份	4,000,000	57,680,000.0	2.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	168,460,500.00	7.97
2	央行票据	—	—
3	金融债券	440,627,000.00	20.67
4	央行票据	378,897,000.00	17.96
4	企业债券	71,298,862.33	3.33
5	中期票据	29,152,000.00	0.94
6	中期票据	—	—
7	其他债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	700,526,303.20	32.71

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	010107	21国债07	1,500,000	168,460,500.00	7.97
2	150207	15国债07	1,200,000	121,968,000.00	5.80
3	130317	13国债17	800,000	60,144,000.00	2.74
4	0910100	10年国债附息02	690,000	64,790,000.00	3.02
5	140208	14国债附息	600,000	61,734,000.00	2.90

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.11.2 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。

5.11.3 期末其他各项资产构成
单位：人民币元

序号	项目	名称	金额
1	存出保证金		1,942,051.91
2	应收证券清算款		—
3	应收股利		—
4	应收利息		11,651,152.71
5	其他应收款		1,943,880.06
6	其他		—
7	待摊费用		—
8	其他		—
9	合计		15,327,737.70

5.11.4 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。

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	高送转股情况说明
1	300203	聚光科技	111,309,633.6	6.19	筹划重大事项
2	300418	昆仑万润	85,316,366.6	4.12	筹划非公开发行股票
3	300007	汉国资本	67,248,000.0	3.14	筹划重大事项

5.11.6 投资报告附注其他文字描述部分
由于四五五五的原因，分散交易和集中交易存在差异。

(一) 基金的投资目标
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。基金的投资组合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。
本基金业绩指标不包括持有基金份额净值增长率的各项费用，计入申购后实际收益水平低于所列数字。

(二) 基金的投资策略
本基金采取自上而下与自下而上相结合主动管理，遵循积极主动的投资理念，依据国家有关法律、法规和基金合同的约定，宏观经济环境、国家政策和市场环境等因素进行资产配置，并在此基础上，结合对行业、公司基本面、估值、流动性、成长性、长期性等，基金配置以宏观经济总体分析和市场中期分析为基础，根据宏观经济、通过资产配置和风险预期选择资产配置策略。同时，本基金将基于资产配置调整过程中政策、法规的动态变化，把握市场时机同时兼顾市场资金结构的变化进行仓位调整，调整资产配置，同时充分利用短期金融工具，作为资产配置的有效补充及收益补充。

(三) 股票投资策略
依据基本面驱动定价理念，对公司基本面进行深入研究，发掘公司基本面的投资价值。从公司的行业属性、核心竞争力、发展战略、财务状况、管理团队等方面入手，定量与定性相结合的方法，筛选出进行重点研究的股票。

(四) 债券投资策略
通过对公司经营战略、技术状况、扩张能力、产品结构、生命周期、销售渠道等因素以及市值规模、市场占有率、品牌(B/P、E/P、S/P等)、市场动量(Momentum)等指标的跟踪分析，筛选出具有投资价值而股票价格相对低估的个股，并在此基础上，结合对行业、公司基本面、估值、流动性、成长性、长期性等，基金配置以宏观经济总体分析和市场中期分析为基础，根据宏观经济、通过资产配置和风险预期选择资产配置策略。同时，本基金将基于资产配置调整过程中政策、法规的动态变化，把握市场时机同时兼顾市场资金结构的变化进行仓位调整，调整资产配置，同时充分利用短期金融工具，作为资产配置的有效补充及收益补充。

(五) 权证投资策略
权证作为一种高风险、高收益的衍生品，其投资价值取决于其所依附的标的股票的价格。权证投资策略包括：1、对权证进行基本面分析，筛选出具有投资价值而股票价格相对低估的个股，并在此基础上，结合对行业、公司基本面、估值、流动性、成长性、长期性等，基金配置以宏观经济总体分析和市场中期分析为基础，根据宏观经济、通过资产配置和风险预期选择资产配置策略。同时，本基金将基于资产配置调整过程中政策、法规的动态变化，把握市场时机同时兼顾市场资金结构的变化进行仓位调整，调整资产配置，同时充分利用短期金融工具，作为资产配置的有效补充及收益补充。

(六) 衍生品投资策略
本基金将根据对权证、股指期货等衍生品的深入研究，选择流动性好、交易活跃的权证进行投资。本基金参与股指期货交易，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、活跃度高、交易成本低的品种，力争获得超额收益。同时，本基金将基于资产配置调整过程中政策、法规的动态变化，把握市场时机同时兼顾市场资金结构的变化进行仓位调整，调整资产配置，同时充分利用短期金融工具，作为资产配置的有效补充及收益补充。

(七) 基金管理人可以依法对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
1、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
2、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
3、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
4、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
5、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
6、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
7、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
8、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
9、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
10、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
11、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
12、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
13、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
14、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
15、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
16、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
17、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
18、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
19、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
20、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
21、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
22、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
23、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
24、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
25、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
26、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
27、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
28、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
29、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
30、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：
31、对基金资产进行流动性管理，包括但不限于：