

信息披露

Disclosure

(上接B059版)

(67) 南京证券股份有限公司
住所: 江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址: 江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人: 步国旬
客户服务电话: 400—828—5888
传真: 025—83364032
联系人: 石健
网址: www.njqz.com.cn
(68) 上海证券有限责任公司
住所: 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: 龚德雄
电话: 021—51539888
传真: 021—65217206
联系人: 张瑾
网址: www.962518.com
客户服务电话: 400—891—8918
(69) 新时代证券股份有限公司
住所: 北京市海淀区三环北路99号院1号楼15层1501
办公地址: 北京市海淀区三环北路99号院1号楼15层1501
法定代表人: 刘汝军
电话: 010—8361149
传真: 010—8361094
联系人: 孙恒
网址: www.xsdtzq.com
客户服务电话: 400—698—9898
(70) 大同证券经纪有限责任公司
住所: 大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址: 山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座P12、F13
法定代表人: 董祥
电话: 0351—4130322
传真: 0351—4192803
联系人: 薛津
网址: www.dtsbc.com.cn
客户服务电话: 400—712—1212
(71) 国联证券股份有限公司
住所: 无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
办公地址: 无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
法定代表人: 姚志勇
电话: 0510—82831662
传真: 0510—82830162
联系人: 徐欢
网址: www.glscc.com.cn
客户服务电话: 95570
(72) 浙商证券股份有限公司
住所: 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6—7
办公地址: 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6—7
法定代表人: 吴圣承
电话: 0571—87901053
传真: 0571—87901913
联系人: 谢相辉
网址: www.stocke.com.cn
客户服务电话: 0571—957777
(73) 平安证券股份有限公司
住所: 深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16—20层
办公地址: 深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16—20层
法定代表人: 谢永林
电话: 0755—22621866
传真: 0755—82400862
联系人: 吴昊
网址: www.pingan.com
客户服务电话: 95511—8
(74) 华安证券股份有限公司
住所: 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号财智中心B1
法定代表人: 李工
电话: 0551—65161666
传真: 0551—65161600
联系人: 甘霖
网址: www.haazq.com
客户服务电话: 0551—96518, 400—809—6518
(75) 国海证券股份有限公司
住所: 广西桂林市辅星路13号
办公地址: 广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人: 何春梅
电话: 0755—87700350
传真: 0755—83704850
联系人: 李宇宁
网址: www.guizq.com.cn
客户服务电话: 95563
(76) 财信证券有限责任公司
住所: 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、27、28楼
法定代表人: 蔡一兵
客户服务电话: 0731—4403319
传真: 0731—4403349
联系人: 郭磊
网址: www.cfzq.com
(77) 东莞证券股份有限公司
住所: 东莞市莞城区可园南路1号金源中心
办公地址: 东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人: 张运勇
电话: 0769—22115712, 0769—22119348
传真: 0769—22119423
联系人: 李荣、孙旭
网址: www.dgzq.com.cn
客户服务电话: 0769—961130
(78) 中原证券股份有限公司
住所: 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: 菅明军
电话: 0371—69098882
传真: 0371—65658589
联系人: 程艳艳、范春艳
网址: www.ccnew.com
客户服务电话: 95377
(79) 国都证券股份有限公司
住所: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
办公地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人: 常松
电话: 010—84183389
传真: 010—84183311—3389
联系人: 黄静
网址: www.guodu.com
客户服务电话: 400—818—8118
(80) 东海证券股份有限公司
住所: 江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址: 上海市浦东新区东方路1929号东海证券大厦
法定代表人: 李科敏
电话: 021—20333333
传真: 021—50498825
联系人: 王彦
网址: www.longone.com.cn
客户服务电话: 95531, 400—888—8588
(81) 中银国际证券有限责任公司
住所: 上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址: 上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人: 钱卫
电话: 021—50372474
传真: 021—50372474
联系人: 王炜哲
网址: www.bocichina.com.cn
客户服务电话: 400—620—8888
(82) 国盛证券有限责任公司
住所: 南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址: 江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦4层A
法定代表人: 曾小晋
电话: 0791—86283080
传真: 0791—86281305
联系人: 俞渝
网址: www.gsstock.com
客户服务电话: 0791—6285337
(83) 华西证券股份有限公司
住所: 四川省成都市陕西街239号
办公地址: 四川省成都市陕西街239号
法定代表人: 杨炯洋
电话: 010—52723273
传真: 028—86150040
联系人: 李慧灵
网址: www.hx168.com.cn
客户服务电话: 400—888—8818
(84) 中泰证券股份有限公司
住所: 山东省济南市市中区经七路86号
办公地址: 山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人: 李玮
电话: 0531—68889155
传真: 0531—68889185
联系人: 吴昊
网址: www.zts.com.cn
客户服务电话: 95538
(85) 世纪证券有限责任公司
住所: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦40—42楼
办公地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦40—42楼
法定代表人: 卢长才
电话: 0755—83195645
联系人: 刘军辉
网址: www.csco.com.cn
(86) 第一创业证券股份有限公司
住所: 广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人: 刘学民
电话: 0755—25317164
传真: 0755—23838750
联系人: 毛诗莉

网址: www.firstcapital.com.cn
客户服务电话: 400—888—1888
(87) 金元证券股份有限公司
住所: 海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址: 深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人: 陆涛
电话: 0755—83025022
传真: 0755—83025625
联系人: 马贤清
网址: www.jyzq.cn
客户服务电话: 400—888—8228
(88) 中航证券有限公司
住所: 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
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: 王宜四
电话: 0791—86768681
传真: 0791—86770178
联系人: 戴蕾
网址: www.avicsec.com
客户服务电话: 400—886—6567
(89) 华林证券有限责任公司
住所: 深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6层
办公地址: 深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6层
法定代表人: 薛荣平
电话: 0755—82707855
传真: 0755—23613751
联系人: 杨玲
网址: www.chinalions.com
客户服务电话: 400—188—3888
(90) 德邦证券有限责任公司
住所: 上海市普陀区曹杨路510号南半幢9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: 姚文平
电话: 021—68761616—8522
传真: 021—68767032
联系人: 叶雷
网址: www.tebon.com.cn
客户服务电话: 400—888—8128
(91) 西部证券股份有限公司
住所: 陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16—17楼
办公地址: 陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16—17楼
法定代表人: 刘建武
电话: 029—87471719
传真: 029—87424426
联系人: 刘莹
网址: www.westsecu.com
客户服务电话: 95582
(92) 华福证券有限责任公司
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: 黄金琳
电话: 0591—87383623
传真: 0591—87383610
联系人: 张翼
网址: www.hfzq.com.cn
客户服务电话: 0591—96326
(93) 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: 甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人: 李晓安
电话: 0931—4890100
联系人: 李娜
网址: www.hlzqgs.com
客户服务电话: 0931—4890619, 4890618, 4890100
(94) 中国国际金融股份有限公司
住所: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层
办公地址: 北京市建国门外大街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—65058065
联系人: 罗春蓉、武明
网址: www.cicc.com.cn
客户服务电话: 010—65051166
(95) 财通证券股份有限公司
住所: 杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址: 杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人: 沈建宁
电话: 0571—87925129
传真: 0571—87818329
联系人: 夏吉春
网址: www.ctsec.com
客户服务电话: 0571—96336
(96) 华鑫证券有限责任公司
住所: 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: 上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人: 俞萍
电话: 021—54967203
传真: 021—54967293
联系人: 王道
网址: www.cfsc.com.cn
客户服务电话: 021—32109929, 029—68918888, 400—109—9918
(97) 瑞银证券有限责任公司
住所: 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: 程京
电话: 010—58328112
传真: 010—58328748
联系人: 牟冲
网址: www.wbscuccities.com
客户服务电话: 400—887—8827
(98) 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处荣超商务中心A栋第18层21层及第04层01.02.03.06.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址: 深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人: 龙增来
电话: 0755—82023442
传真: 0755—82026539
联系人: 刘毅
网址: www.china-invs.cn
客户服务电话: 400—600—8008, 95532
(99) 中山证券有限责任公司
住所: 深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层
办公地址: 深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层
法定代表人: 黄永录
电话: 0755—82570586
传真: 0755—82960582
联系人: 罗艺琳
网址: www.zszq.com
客户服务电话: 400—102—2011
(100) 西藏同信证券有限责任公司
住所: 拉萨市北京中路101号
办公地址: 上海市永和路118弄东方企业园24号
法定代表人: 袁毅君
电话: 021—36533016
传真: 021—36533017
联系人: 王伟光
网址: www.xzsec.com
客户服务电话: 400—881—1177
(101) 日信证券有限责任公司
住所: 呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址: 呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人: 孔佑杰
电话: 010—88086830—730, 010—88086830—737
传真: 010—66412537
联系人: 陈书彬、张曙光
网址: www.rxzq.com.cn
客户服务电话: 010—88068830
(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66号
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
法定代表人: 孙名扬
电话: 0451—85063719
传真: 0451—82287211
联系人: 刘爽
网址: www.jhzq.com.cn
客户服务电话: 400—686—2288
(103) 国信证券股份有限公司
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: 冉云飞
电话: 028—86690074
传真: 028—86690126
联系人: 刘一军
网址: www.guizq.com.cn
客户服务电话: 95105111(四川地区)、400—660—0109(全国)
(104) 中国民族证券有限责任公司
住所: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层—9层
办公地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层—9层
法定代表人: 赵磊
电话: 010—59355941
传真: 010—66553791
联系人: 李薇
网址: www.zm618.com.cn
客户服务电话: 400—939—5618
(105) 华宝证券有限责任公司
住所: 上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址: 上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人: 陈彬
电话: 021—50122128
传真: 021—50122398
联系人: 徐方亮
网址: www.hbbsstock.com
客户服务电话: 400—820—9898
(106) 长城国瑞证券有限公司

住所: 福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
办公地址: 福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
法定代表人: 王勇
电话: 0592—5161642, 15880287470
传真: 0592—5161140
联系人: 卢文金
网址: www.xmzq.cn
客户服务电话: 0592—5163588
(107) 爱建证券有限责任公司
住所: 上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人: 钱华
电话: 021—32229888
传真: 021—62878783
联系人: 王薇
网址: www.wajz.com
客户服务电话: 400—196—2502
(108) 华融证券股份有限公司
住所: 北京市西城区月坛北街26号
办公地址: 北京市西城区金融大街8号A座3层、5层
法定代表人: 祝献忠
电话: 010—58568235
传真: 010—58568062
联系人: 黄恒
网址: www.hrsec.com.cn
客户服务电话: 010—58568118
(109) 天风证券股份有限公司
住所: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人: 余磊
电话: 027—87618882
传真: 027—87618863
联系人: 翟璟
网址: www.tfzq.com
客户服务电话: 028—86711410, 027—87618882
(110) 宏信证券有限责任公司
住所: 四川省成都市锦江区人民南路二段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: 吴玉明
电话: 028—86199278
传真: 028—86199382
联系人: 郝俊杰
网址: www.hxzq.cn
客户服务电话: 400—836—6366
(111) 太平洋证券股份有限公司
住所: 云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址: 北京市西城区北展北街9号华远企业公司D座3单元
法定代表人: 李长伟
电话: 010—83321771, 18500506235
传真: 010—83321763
联系人: 唐国田
网址: www.tpyzq.com
客户服务电话: 400—665—0999
3. 场内代销机构
指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位, 具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。
基金管理人可依据有关法律法规规定, 根据情况变化增加或者减少代销机构, 并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。
(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
联系人: 陈丽娟
联系电话: 010—50938870
传真: 010—50938907
(三) 律师事务所
名称: 北京市天元律师事务所
住所: 北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址: 北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人: 朱小华
联系电话: 010—57763888
传真: 010—57763771
联系人: 杨科
经办律师: 吴冠雄、杨科
(四) 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: 上海市浦电路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人: 李丹
联系电话: 021—23238888
传真: 021—23238800
联系人: 许康祺、洪磊
经办注册会计师: 许康祺、洪磊
四、基金的基本情况
(一) 基金的投资目标
本基金名称: 华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)。
(二) 基金的投资类型
本基金类型: 契约型上市开放式基金。
(三) 基金的投资目标
本基金的投资目标: 追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
(四) 基金的投资范围
本基金的投资范围: 限于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品(如股指期货)推出后, 本基金还可依据法律法规的规定运用金融衍生产品进行投资风险管理。
其中, 本基金股票投资占基金资产的比例范围为20%—95%, 债券投资占基金资产的比例范围为0—80%, 资产支持证券投资占基金资产净值比例范围为0—20%, 权证投资占基金资产净值比例范围为0—3%, 现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
此外, 如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的, 基金管理人可在履行适当程序后, 将其纳入本基金的投资范围; 如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的, 基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定, 不需经基金份额持有人大会审议。
(五) 基金资产配置策略
本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析, 主动判断市场时机, 履行积极的投资配置, 合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例, 以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
(六) 股票投资策略
(一) 股票投资策略
本基金总体上采取“核心—卫星策略”, 即将基金股票资产分成两部分, 其中核心部分在投资组合中占较大比重(不低于股票资产的80%), 投资较为稳定, 对整个投资组合的长期风险控制起主导性作用; 卫星部分在投资组合中占比较小, 投资更加主动、积极和灵活, 以追求超额收益为目标。
本基金的核心组合主要采取买入持有策略, 投资于大盘蓝筹股, 以分享中国经济成长; 卫星组合则采取多种策略, 积极投资于新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等, 追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。
由于核心组合与卫星组合之间相关性较低, 还能够有效地分散基金整体组合的风险, 从而实现在有效控制风险的前提下追求基金资产的稳健、持续增值。
(二) 核心组合投资策略
本基金的核心组合主要采取买入持有策略, 投资于大盘蓝筹股。大盘蓝筹股是指市值规模较大(总市值不低于15亿元), 且具有以下特征的股票:
(1) 公司在行业中处于领先地位, 具备核心竞争优势, 比如专利技术等、资源独占、销售网络独特, 独特的市场形象、较高的品牌知名度等。
(2) 公司经营管理团队稳定、治理结构良好。
(3) 公司财务指标健康、收入增长和盈利水平较高。
(4) 市场估值相对于公司资产价值和增长能力而言处于合理区间。
中国股市处于持续、快速成长的阶段, 由于大盘蓝筹股在行业中处于领先地位, 具备较高的市场占有率和市場影响力, 因而能够获得更多的资源和支持, 充分分享经济增长的成果, 并将其转化为企业自身的业绩增长动力。而且, 在我国证券市场上, 随着机构投资者所占比重越来越大, 对市場的影响力也越来越大, 由于大盘蓝筹股在流动性和风险方面具有比较优势, 将成为机构投资者组合之组合, 从而获得资金面支持。因此, 我们认为, 投资于大盘蓝筹股将在较低风险下实现基金资产的稳健增值。
(三) 卫星组合投资策略
本基金卫星组合将采取多种积极策略, 追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。目前, 本基金主要采取新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等机会, 通过积极操作, 为整个组合扩大增值空间。
(1) 新股申购: 基金将利用规模优势和定价优势, 积极参与新股申购、定向增发等, 把握一级市场与二级市场的差价机会, 获取低风险收益。
(2) 中小盘股: 与大盘股相比, 中小型企业成长性更高, 收益潜力更大, 但个股风险也较高。基金将通过深入研究、精选个股, 把握中小盘股的成长机会, 以实现超越市场平均水平的超额收益。
(3) 资产重组策略: 随着股权分置改革的完成, 越来越多的大股东愿意通过整体上市、收购兼并、资产重组等形式, 把优质资产注入上市公司, 以提升公司业绩, 并实现市值的更大增长。重组概念将成为未来一段时间内驱动公司业绩增长的重要因素, 基金将积极把握其中机会, 获取超额收益。
(4) 衍生品板块: 随着股指期货等衍生工具的推出和发展, 基金将有可能采用套利策略对冲风险, 或通过杠杆杆杆作用放大收益。基金将以定量分析模型为基础, 在严格控制风险的前提下把握衍生品市场机会, 追求实现较高收益。
未来, 基金管理人还将根据证券市场的发展, 积极寻求其他投资机会, 对卫星组合投资策略将进行丰富和调整。
(七) 债券投资策略
本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标, 同时根据需要进行积极操作, 以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略:
(1) 久期调整策略
在久期调整的基础上, 根据对收益率曲线形状变化的预测, 采用子弹型策略、哑铃策略或梯形策略, 在长期、中期和短期债券间进行配置, 以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。
(2) 债券类属配置策略
根据国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券等不同债券板块之间的相对投资价值分析, 增持价值被相对低估的债券板块, 减持价值被相

对高估的债券板块, 借以取得较高收益。其中, 随着债券市场的发展, 基金将加强对企业债、可转债、资产支持证券等新品种的投资, 主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和信用管理, 获取超额收益。

九、基金的业绩比较基准
本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数, 债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基金整体业绩比较基准构成为: 基准收益率=沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
未来, 如基金变更投资比例范围, 或市场出现代表性更强、投资者认同度更高的指数, 或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布, 基金管理人可在履行适当程序后, 变更本基金的基准指数或权重构成。

十、基金的风险收益特征
本基金是混合基金, 风险高于货币市场基金和债券基金, 低于股票基金, 属于较高风险、较高收益的品种。
十一、基金投资组合报告
以下内容摘自本基金2015年第3季度报告:
“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	3,426,599,147.68	71.77
	其中: 股票	3,426,599,147.68	71.77
2	固定收益投资	192,116,369.80	4.02
	其中: 债券	192,116,369.80	4.02
	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	1,149,356,065.23	24.07
7	其他各项资产	6,294,699.71	0.13
8	合计	4,774,366,282.42	100.00

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	207,841,156.98	4.42
B	采矿业	12,638,220.78	0.27
C	制造业	1,379,928,541.34	29.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,956,825.24	2.08
E	建筑业	25,187,686.60	0.54
F	批发和零售业	90,120,272.31	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	267,018,474.63	5.68
H	住宿和餐饮业	17,017.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,908,256.63	1.70
J	金融业	636,864,029.93	13.77
K	房地产业	43,939,820.35	0.93
L	租赁和商务服务业	159,531,269.88	3.39
M	科学研究和技术服务业	1,015,000.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	210,065,176.09	4.47
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	3,104,110.20	0.07
R	文化、体育和娱乐业	12,467,287.82	0.27
S	综合	—	—
合计		3,426,599,147.68	72.87

序号	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	19,799,940	351,844,933.80	7.48
2	600612 老凤祥	7,221,527	334,501,130.64	7.11
3	600887 伊泰煤炭	13,813,656	212,454,029.28	4.52
4	600000 浦发银行	8,635,589	143,609,945.07	3.05
5	300070 思摩尔	3,149,769	137,613,407.61	2.93
6	601166 兴业银行	9,429,700	137,256,432.00	2.92
7	600598 北大荒	8,050,098	115,277,430.36	2.45
8	601888 中国国旅	1,859,990	97,240,277.00	2.07
9	600004 白云机场	6,939,579	83,205,562.21	1.77
10	600398 海澜之家	5,673,600	79,894,288.00	1.70

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	138,953,000.00	2.95
2	央行票据	—	—
3	金融债券	11,022,100.00	0.23
	其中: 政策性金融债	11,022,100.00	0.23
4	企业债券	42,141,269.80	0.90
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	192,116,369.80	4.09

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	020083	15国债09	1,000,000	98,860,000.00	2.10
2	019501	15国债01	300,000	30,087,000.00	0.64
3	110402	11国债02	100,000	10,013,000.00	0.21
4	019822	08国债22	100,000	10,006,000.00	0.21
5	122641	PR武钢债	80,000	6,142,400.00	0.13

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持仓。
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持仓。
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持仓。
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持仓。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货持仓。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 2015年6月23日北大荒收到中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚及市场禁入事先告知书》, 2014年10月28日北大荒受到上海证交所通报批评。本基金投资该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。
5.11.2 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	名称	金额
1	存出保证金	2,301,398.77
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,632,801.20
5	应收申购款	860,493.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,294,699.71

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	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	300070	碧水源	137,613,407.61	293	筹划重大资产重组 事项