(上接B051版)

(93)东方证券股份有限公司

住所	上海市中山南路318号2号楼22-29层		
办公地址	上海市中山南路318号2号楼21-29层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	吴宇
电话	(021)63325888	传真	(021)63326173
网址	www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

(94)方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层		
法定代表人	雷杰	联系人	郭军瑞?
电话	(0731)85832503	传真	(0731)85832214
网址	www.foundersc.com	客服电话	95571

(95)长城证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
法定代表人	黄耀华	联系人	刘阳
电话	(0755)83516289	传真	(0755)83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755)33680000

(96)光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	薛峰	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021)22169999	传真	(021)22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788、10108998

(97)广州证券股份有限公司

住所、办公地址	广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼		
法定代表人	邱三发	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020)961303

(98)东北证券股份有限公司

住所、办公地址	长春市自由大路1138 号		
法定代表人	杨树财	联系人	潘锴
电话	(0431)85096709	传真	(0431)85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	4006000686、(0431)85096733

(99)南京证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省南京市大钟亭8号		
法定代表人	步国旬	联系人	潘月
电话	(025)83367888	传真	(025)83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

(100)上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市西藏中路336号		
法定代表人	郁忠民	联系人	张璇
电话	(021)53519888	传真	(021)53519888
网址	www.962518.com	客服电话	(021)962518、4008918918

(101)新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501		
法定代表人	刘汝军	联系人	孙恺
电话	(010)83561149	传真	(010)83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

(102)大同证券有限责任公司

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F12、F13		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351)4130322	传真	(0351)4130322
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

(103)国联证券股份有限公司

办公地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702		
注册地址	江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层		
法定代表人	雷建辉	联系人	沈刚
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	95570

(104)浙商证券有限责任公司

住所、办公地址	浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼		
法定代表人	吴承根	联系人	许嘉行
电话	(0571)87901912	传真	(0571)87901913
网址	www.stocke.com.cn	客服电话	(0571)967777

(105)平安证券有限责任公司

住所	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼		
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	(0755)82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511-8

(106)华安证券股份有限公司

办公地址	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号		
注册地址	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号		
法定代表人	李工	联系人	甘霖、钱欢
电话	055165161821	传真	055165161672
网址	www.hazq.com	客服电话	96518、4008096518

(107)国海证券股份有限公司

住所、办公地址	广西桂林市辅星路13号		
法定代表人	张雅锋	联系人	牛孟宇
电话	0755-83709350	传真	0755-83700205
网址	www.ghzq.com.cn	客服电话	95563(全国)

(108)财富证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南省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	周晖	联系人	郭磊
电话	(0731)84403319	传真	(0731)84403439
网址	www.cfzq.com	客服电话	(0731)84403360

(109)东莞证券股份有限公司

住所、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	联系人	苏卓仁
电话	(0769)22112062	传真	(0769)22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(0769)961130

(110)中原证券股份有限公司

住所、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	联系人	程月艳 范春艳
电话	0371--69099882	传真	0371--65585899
网址	www.ccnew.com	客服电话	0371-967218、4008139666

(111)国都证券股份有限公司

住所、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	常喆	联系人	黄静
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(112)东海证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	刘化军	联系人	王一彦
电话	(021)20333910	传真	(021)50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

(113)中银国际证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层		
办公地址	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层		
法定代表人	许刚	联系人	李丹
传真	(021)50372474		
网址	www.bocichina.com.cn	客服电话	4006208888

(114)恒泰证券股份有限公司

住所、办公地址	内蒙古呼和浩特市新城区新华大街111号		
法定代表人	庞介民	联系人	王旭华
电话	(010)66297386	传真	(0471)4961259
网址	www.cnht.com.cn	客服电话	(0471)4972343

(115)国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市北京西路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号江信国际金融大厦4楼		
法定代表人	曾小普	联系人	俞驰
电话	(0791)86285337	传真	(0791)86282293
网址	www.gsstock.com	客服电话	4008222111

(116)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	深圳市深南大道4001 号时代金融中心18楼深圳总部		
法定代表人	杨炯洋	联系人	金达勇
电话	(0755)83025723	传真	(0755)83025991
网址	www.hx168.com.cn	客服电话	4008-888-818

(117)宏源证券股份有限公司

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街19号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010)88085858	传真	(010)88085195
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(118)齐鲁证券有限公司

住所、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	联系人	吴阳
电话	(0531)68889155	传真	(0531)68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

(119)世纪证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳深南大道7088号招商银行大厦40-42层		
法定代表人	姜昧军	联系人	方文
电话	(0755)83199599	传真	(0755)83199545
网址	www.csco.com.cn	客服电话	(0755)83199511

(120)第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层		
法定代表人	刘学民	联系人	崔国良
电话	(0755)25832852	传真	(0755)82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

(121)金元证券股份有限公司

住所	海南省海口市南宝路36号证券大厦4层		
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	联系人	马贤清
电话	(0755)83025022	传真	(0755)83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

(122)中航证券有限公司

住所、办公地址	南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼		
法定代表人	杜航	联系人	戴蕾
电话	(0791)86768681	传真	(0791)86770178
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

(123)德邦证券有限责任公司

住所	上海市普陀区曹阳路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	联系人	罗芳
电话	(021)68761616	传真	(021)68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

(124)西部证券股份有限公司

住所、办公地址	陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼		
法定代表人	刘建武	联系人	刘莹
电话	(029)87416787	传真	(029)87417012
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

(125)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	联系人	张腾
电话	(0591)87383623	传真	(0591)87383610
网址	www.hfzq.com.cn	客服电话	(0591)96326

(126)华龙证券有限责任公司

住所	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	(0931)4890208	传真	(0931)4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	(0931)96668、4006898888

(127)中国国际金融有限公司

住所	北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层		
办公地址	北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层		
法定代表人	李剑阁	联系人	廉赵峰
电话	(010)65051166	传真	(010)85679535
网址	www.ciccs.com.cn	客服电话	(010)85679238;(010)85679169

(128)财通证券有限责任公司

住所、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	沈继宁	联系人	乔骏
电话	(0571)87925129	传真	0571-87818329
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571)96336、962336(上海地区)

(129)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		
法定代表人	罗浩	联系人	倪丹
电话	021-38784818?	传真	021-68775878
网址	www.shhxzq.com	客服电话	68777877

(130)华鑫证券有限责任公司

住所、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	洪家新?	联系人	孔泉
电话	(0755)82083788	传真	(0755)82083408
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	(021)32109999,(029)68918888

(131)瑞银证券有限责任公司

住所、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	程宜荪	联系人	牟冲
电话	(010)58328112	传真	(010)58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

(132)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、05、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	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

(133)中山证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	(0755)82570586	传真	(0755)82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011

(134)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	北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层		
法定代表人	孔佑杰	联系人	冯杰
电话	(010)83991743	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn	客服电话	4006609839

(135)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		
注册地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	孙名扬	联系人	刘爽
电话	0451-85863719	传真	0451-82287211
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

(136)国金证券股份有限公司

住所、办公地址	成都市东城根上街95号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	(028)86690126	传真	(028)86690126
网址	www.gjzq.com.cn	客服电话	4006600109

(137)中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层		
法定代表人	赵大建	联系人	李微
电话	(010)59355941	传真	(010)66553791
网址	www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

(138)华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021)68777222	传真	(021)68777822
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

(139)长城国瑞证券有限公司

住所、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	王勇	联系人	卢金文
电话	(0592)5161642	传真	(0592)5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	(0592)5163588

(140)爱建证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼		
法定代表人	宫龙云	联系人	陈敏
电话	(021)32229888	传真	021-68728782
网址	www.ajzq.com	客服电话	(021)63340678

(141)英大证券有限责任公司

住所	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
注册地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	吴骏	联系人	吴尔晖
电话	0755-83007159	传真	0755-83007034
网址	www.ydsc.com.cn	客服电话	4000-188-688

(142)华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街8号		
办公地址	北京市西城区金融大街8号中国华融A座3层、5层		
法定代表人	宋德清	联系人	黄恒
电话	010-58568235	传真	010-58568062
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	(010)58568118

(143)天风证券股份有限公司

办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼		
注册地址	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	联系人	崔成
电话	027-87610052	传真	027-87618863
网址	www.tfzq.com	客服电话	4008005000

(144)宏信证券有限责任公司

办公地址	四川成都市人民南路2段18号川信大厦10楼		
注册地址	四川成都市人民南路2段18号川信大厦11楼		
法定代表人	吴玉明	联系人	刘进海
电话	028-86199278	传真	028-86199382
网址	www.hxzq.cn	客服电话	4008366366

注：基金管理人于2005年1月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的基金申购业务的公告》，从即日起暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的本基金申购业务。对于此前通过闽发证券、汉唐证券认购、申购的本基金份额，基金份额持有人仍可在闽发证券、汉唐证券正常办理赎回或转托管业务。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

嘉实基金管理有限公司（同上）

（三）律师事务所和经办律师

名称	国浩律师集团（北京）事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层		
负责人	王卫东	联系人	黄伟民
电话	(010)65890661	传真	(010)65176801
经办律师	黄伟民		

（四）会计师事务所和经办注册会计师

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	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼		
法定代表人	李丹	联系人	洪磊
电话	(021)23238888	传真	(021)23238800
经办注册会计师	许康玮、洪磊		

四、基金的名称

嘉实成长收益证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金定位于成长收益混合型基金，在获取稳定的现金收益的基础上，积极谋求资本增值机会。

七、基金的投资方向

本基金的投资限于具有良好流动性的金融工具。主要包括国内依法发行上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围是：股票资产30%－75%；债券资产20%－65%；现金资产比例控制在5%左右。其中，基金对收益型资产类(包括收益型股票和债券)的投资不低于基金资产净值的40%，对国债的投资不低于基金资产净值的20%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1、大类资产配置

在全面评估证券市场现阶段系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上，制订基金资产在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。

2、收益型资产类的投资策略

根据目前金融市场状况，为实现收益目标，本基金主要投资于以下三类资产：一是按照规定，至少20%的国债投资；二是投资于具有相对较高收益率的企业债、金融债和公司可转债；三是投资收益型股票。本基金将在分析比较债券到期收益率和当前市场收益型股票的股息收益率的基础上，结合市场情况从而对收益型资产类中债券和收益型股票进行资产配置，并通过"精选收益型股票"的策略以及稳健的债券投资来获得良好的收益目标。

（1）"精选收益型股票"的投资策略

对于收益型股票，将以预期股息收益率超过同期一年期银行存款利率为核心，同时结合以下几方面进行选择：

A. 公司进入稳定发展阶段，预期主营业务收入及净利润保持稳定增长；

B. 公司现金流状况良好；

C. 公司有现金分红历史记录，同时具有继续进行现金分红的潜力；

D. 预期股息收益率处于市场平均水平之上。

根据以上标准，选择出重点目标公司，在周密的案头研究基础上，通过实地调研，最终精选一批具备投资价值的收益型股票，做中长期投资。

（2）债券投资策略

债券是实现基金资产安全和当期收益目标的重要金融工具，本基金在国债投资部分将根据对国债市场和利率走势的综合判断，在银行间市场和交易所市场之间积极寻找价格被低估的债券品种，追求稳定的债券票息收入或差价收益。对所有的国债资产，在充分估算基金资产流动性状况的基础上，积极参与债券回购交易，获取无风险收益。

3、成长型资产类的投资策略

本基金将主要通过实施"行业优选、积极轮换"的策略，实现"资本增值"目标。

本基金将加强对行业基本面的研判，跟踪各行业发展动态，对行业择优而投，即投资于那些基本面已出现积极变化、景气程度增加但股票市场却反应滞后的行业，并根据行业的基本面变化以及股票市场行业指数表现，实施积极的行业轮换，不断寻找新的行业投资机会。而实施以上策略的关键在于寻找一个合适的行业价值评估方法，本基金管理人结合自身研究和国外研究成果，建立了一套适合中国股票市场特点的行业价值评估体系，并在基金的投资实践中不断修正和完善该体系。总结起来，本基金管理人目前使用的行业价值评估体系可归结为"两个方法、一个系统"，即行业景气评价方法和行业指数对基本面因素的敏感度分析方法，以及数据库支持系统。策略实施的主要流程如下：

（1）进行准确有效的行业分类，为开展行业研究和行业资产类投资奠定基础。

（2）研究员采取自上而下的研究方法，以细分行业作为最终研究对象，从以下两方面对行业进行评级分析：一是以行业相对增长率为核心的行业景气趋势研究；另一方面是对股票市场是否合理反映行业基本面变化做出判断。本基金在以上研究的基础上，对行业进行优选并积极轮换，以尽享行业的周期性增长机会。

（3）在确定具体的行业投资比例后，本基金在业绩主导原则基础上对行业内个股进行投资价值判断。所谓业绩主导原则具体包括以下几方面要求：①业绩增长性要求，公司预期经营性收入、净利润等业绩指标增长能够保持在行业内中上水平；②业绩含金量要求，公司收入或利润的增长50%以上来源于主营业务收入或利润的增长；③业绩的行业相关性要求，公司经营状况与行业基本面状况具有较强相关性，公司能够从行业景气上升中直接受益。在此基础上，本基金重点采用相对价值评价方法，对股票投资价值进行判断。

（4）针对某些市场环境和行业特点，本基金会采用程序交易技术，对行业内个股采取指数化投资策略。

（二）投资管理程序

1、研究部通过内部独立研究，并借鉴其它研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下，基金经理小组和资产配置委员会综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断，按照基金的契约规定，提出下一阶段本基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例，并制订基金在其它重要股票资产类别上的具体配置计划。

3、投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定本基金的总体投资策略，审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会决议，参考本公司研究部和其它研究机构的研究报告，选择具体的投资目标，构建投资组合。

5、基金经理将投资指令下达给集中交易室，交易主管在复核投资指令合法合规的基础上，将指令分发给交易员执行。

6、风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告，监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。

7、基金经理小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。

8、在确保基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序作出调整。

九、基金的业绩比较基准

上证A股指数

十、基金的风险收益特征

本基金属于中等风险证券投资基金，长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的@值不超过0.75。在此前提下，本基金通过合理配置在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产之间的比例，努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证A股指数涨幅的65%，股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证A股指数跌幅的55%。

十一、基金的投资组合报告

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日（"报告期末"），本报告所列财务数据未经审计。

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	2,066,141,684.94	52.28
	其中:股票	2,066,141,684.94	52.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,314,757,000.00	33.26
	其中:债券	1,314,757,000.00	33.26
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	543,443,690.65	13.75
8	其他资产	28,067,194.16	0.71
	合计	3,952,409,569.75	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	1,367,434,964.70	34.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,835,864.50	0.76
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,877,229.18	1.32
G	交通运输、仓储和邮政业	52,115,900.76	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	364,185,549.10	9.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	124,059,030.70	3.15
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	76,633,146.00	1.95
S	综合	-	-
	合计	2,066,141,684.94	52.45

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	300296	利亚德	13,327,664	179,923,464.00	4.57
2	300302	同有科技	5,594,000	169,386,320.00	4.30
3	300353	东土科技	8,806,450	167,498,679.00	4.25
4	600887	伊利股份	9,266,517	142,519,031.46	3.62
5	300066	三川股份	11,077,908	125,069,581.32	3.18
6	002111	威海广泰	5,509,667	117,245,713.76	2.98
7	002439	启明星辰	4,281,900	108,332,070.00	2.75
8	002465	海格通信	7,520,200	96,032,954.00	2.44
9	002253	川大智胜	3,012,793	86,467,159.10	2.20
10	603588	高能环境	1,487,373	86,118,896.70	2.19

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	1,314,757,000.00	33.38
	其中:政策性金融债	1,314,757,000.00	33.38
4	企业债券	-	-
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	-	-
	合计	1,314,757,000.00	33.38

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	150206	15国开06	2,400,000	241,608,000.00	6.13
2	150215	15国开15	2,200,000	219,956,000.00	5.58
3	150307	15进出07	1,900,000	190,988,000.00	4.85
4	150403	15农发03	1,700,000	170,714,000.00	4.33
5	150202	15国开02	1,600,000	160,608,000.00	4.08

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11.投资组合报告附注

（1）

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

（2）

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	1,270,093.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,098,920.59
5	应收申购款	3,698,179.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	28,067,194.16

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

（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	300296	利亚德	179,923,464.00	4.57	重大事项停牌
2	300353	东土科技	167,498,679.00	4.25	重大事项停牌

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2002年11月5日至2002年12月31日	-3.37%	0.40%	-11.32%	1.22%	7.95%	-0.82%
2003年度	21.43%	0.76%	10.32%	1.14%	11.11%	-0.38%
2004年度	1.94%	1.01%	-15.04%	1.32%	16.98%	-0.31%
2005年度	2.29%	0.97%	-8.21%	1.37%	10.50%