

（上接A37版）

网址:www.china-innvcn
70、山西证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心A座26—30层
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心A座26—30层
法定代表人:侯晓伟
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
联系人:张治国
客户服务电话:400-666-1618
网址:www.j618.com.cn
71、广州证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址:广东省广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:邱二波
电话:020-88836999
传真:020-88836654
联系人:林洁茹
客户服务电话:020-9613033
网址:www.gzs.com.cn
72、国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街169号
办公地址:无锡市县前东街169号6楼、7楼
法定代表人:雷建辉
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:袁丽萍
客户服务电话:400-888-5288,0510-82858816
网址:www.glsc.com.cn
73、浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6/7楼
法定代表人:吴承根
电话:0571-87902080
联系人:吴顺
客户服务电话:967777
网址:www.stocke.com.cn
74、江海证券有限公司
注册地址: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:0451-82338683
传真:0451-82287211
联系人:徐世旺
客户服务电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
75、爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号
法定代表人:郭林
客户服务电话:021-63340678
网址:www.ajzq.com
76、华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
法定代表人:陈林
电话:021-50122222
联系人:楼斯琦
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com
77、中国民生证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40层—43层
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40层—43层
法定代表人:赵大建
客户服务电话:400-889-5618
网址:www.cm618.com
78、财通证券股份有限公司
注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州市西湖区保叔路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈晓明
客户服务电话:0571-96336
网址:www.ctsec.com
79、信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:赵志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63961000
传真:010-63960978
客户服务电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
80、日信证券有限责任公司
注册地址: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
联系人:张利军、陈书彬
联系电话:010-88086830
网址:www.rxzq.com.cn
81、华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人:李耀文
联系人:李昕田
电话:0931-4890100
传真:0931-4890118
客户服务电话:0931-4890100,4890619,4890618
网址:www.hfzqgs.com
82、华福证券有限责任公司(原广发华福证券有限公司)
注册地址: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
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)
网址:www.hfzq.com.cn
83、华融证券股份有限公司
注册地址: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
法定代表人:祝敏忠
客户服务电话:58568118
网址:www.hrsec.com.cn
84、大通证券股份有限公司
注册地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大连期货大厦38、39层
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大连期货大厦38、39层
法定代表人:李红光
联系人:汪茜
电话:0411-39673301
传真:0411-39673219
客户服务电话:4008-169-169
网址:www.daton.com.cn
85、方正证券股份有限公司
注册地址:长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22—24层
办公地址:长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22—24层
法定代表人:雷涛
客户服务电话:96571
网址:www.foundersc.com
86、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:菅明军
客服电话:96377
联系人:程月艳 范春艳
联系电话:0371-63969882
联系传真:0371-65856599
网址:www.ccnew.com
87、国海证券股份有限公司
注册地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路46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:张雅维
联系人:武斌
联系电话:0755-83707413
传真:0755-83700205
客户服务电话:400888100(全国)、95563(广西)
网址:www.guozq.com.cn
88、西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:余维佳
客户服务电话:4008-096-096
网址:www.swsc.com.cn
89、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B座12—15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)B座12、15层
法定代表人:徐勇夫
基金销售联系人:洪娟川
电话:010-66565316
传真:010-66565246
客户服务电话:400-8888-993
网址:www.dxzq.net.cn
90、财达证券有限责任公司
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层
法定代表人:翟建强
客户服务电话:400-612-8888
网址:www.s10000.com
91、国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号成证大厦16楼
法定代表人:冉云
联系电话:028-86690021 86690026
传真:028-86695681
客户服务电话:4006-600109
网址:www.gzq.com.cn
92、华西证券股份有限公司
注册地址: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
客户服务电话:400-8888-818
网址:www.hx168.com.cn
93、中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层
办公地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
客户服务电话:96548
网址:www.zxwt.com.cn
94、红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7—11楼
法定代表人:倪雨晨
客户服务电话:0871-3577930
网址:www.hongta.com.cn
95、第一创业证券股份有限公司
注册地址: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: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

法定代表人:刘学民

客户服务电话:400-889-1888
网址:www.firstcapital.com.cn
96、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198号
办公地址: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
客户服务电话:96518(安徽)、4008096518(全国)
网址:www.hazq.com
97、国盛证券有限责任公司
注册地址: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
法定代表人:曾小君
客户服务电话:4008222111
网址:http://www.gsstock.com
98、大同证券经纪有限责任公司
注册地址: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12、13层
法定代表人:董祥
客户服务电话:4007-121-212
网址:www.dtsbc.com.cn
99、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人:马令海
客户服务电话:010-58325300
网址:8.jicm.com.cn
100、上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道55号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
电话:021-20691869
传真:021-20691861
联系人:单陈辉
客户服务电话:400-089-1289
网址:www.erichfund.com
101、北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路466号1号楼12层1208号
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208—1209室
法定代表人:罗细亚
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zcwcf.com
102、杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
103、深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
法定代表人:薛峰
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.com; www.jlmmw.com
104、上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4楼449室
办公地址:上海浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
105、和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaikehexun.com
106、浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
客户服务电话:0571-88920897 4008-773-772
网址:www.5ifund.com
107、深圳腾元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)单元
办公地址:深圳市福田区金田路2028号 皇岗商务中心406-407
法定代表人:卓磊磊
客户服务电话:4006 877 899
网址:www.tenyfund.com
108、北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街8号
办公地址:北京市华严北里2号院民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
客户服务电话:4008886661
网址:www.myfund.com
109、一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
法定代表人:吴晋芳
客户服务电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
110、北京景景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
客户服务电话:400-678-5095
联系人:魏静
电话:010-57418929
网址:www.niuji.net
111、北京展恒天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人:蒋煜
客户服务电话:400-818-8866
联系人:徐长征、林薇
电话:010-58170943,010-58170918
网址:www.shengshijiew.com
112、安信证券投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路89号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路89号SOHO现代城C座1809
法定代表人:沈伟伟
客户服务电话:400-6099-200
联系人:程刚
电话:010-52865713
网址:www.yixinfund.com
113、中经北证(北京)资产管理有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人:徐福里
客户服务电话:010-68998820
联系人:陈莹莹
电话:010-68998820-8306
网址:www.bzfunds.com
114、上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号外滩国际广场19楼
法定代表人:张磊
电话:021-33323999
传真:021-33323993
客户服务电话:400-820-2819
手机客户端:天天盈基金
网址:fund.bundtrade.com
115、上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:沈继伟
联系人:赵海彬
联系电话:021-50583533
传真:021-50585353
客户服务电话:
网址:www.leadbank.com.cn
116、浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦1幢10楼1001室
办公地址:杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦1幢10楼1001室
法定代表人:陈善
联系人:陈善
电话:0571-88337888
客户服务电话:400-068-0068
网址:www.jincheng-fund.com
117、上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
客服电话:4008219031
公司网址:www.lufunds.com
118、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:汪静波
客服电话:400-821-5399
公司网址: www.noah-fund.com
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基金,并及时公示。
(二)与资产过户登记人名称:诺安基金管理有限公司
注册地址:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层
法定代表人:秦海伟
电话:0755-83026688
传真:0755-83026677
(四)出具法律意见书的律师事务所和经办律师名称:国浩律师集团(北京)事务所
地址:北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
法定代表人:负责人:王卫东
电话:010-65800699
传真:010-65176800
联系人:黄伟民
联系电话:010-65890699
经办律师:黄伟民、刘伟宁
(五)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市延安路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人:卢瑞刚
联系电话:021-6141 8888
传真:021-6335 0003
联系人:余志亮
经办注册会计师:王明静、洪晓明
四、基金名称
诺安平衡证券投资基金
五、基金类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在承担市场同等风险的前提下,取得好于市场平均水平或收益水平,在控制风险的前提下,兼顾当前的稳定回报以及长期的资本增值。
七、基金的投资方向
本基金的投资范围界定为股票、债券以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的A股。债券投资的主要品种包括国债、

金融债、公司债、国债、短期票据和可转换债。现金资产主要投资于各类银行存款。基金债券和股票的比例根据基金管理人对该市场的判断灵活配置,目标配置比例为:股票65%、债券30%、现金5%。前款所称资产配置比例是指:股票40—75%、债券20—50%、现金5—10%。
本基金本报告期末投资组合的行业、以优质服务和估值偏低并且具有一定成长性的行业领先企业为主。
在本基金成立后六个月内,达到上述比例限制。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的,基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合,以符合上述规定。法律、法规另有规定时,从其规定。
八、基金的投资策略
本基金实施积极的投资策略。在类别资产配置层面,本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动,动态调整股票资产和债券资产的配置比例;在行业配置层面,本基金注重把握中国经济结构及消费结构变迁的趋势,关注各行业的周期性特征和景气度,实现行业优化配置;个股选择层面,本基金借助研究核心竞争力分析系统,在深入分析上市公司基本面的基础上,挖掘价值尚未完全反映公司成长潜力的股票;在债券投资方面,本基金实施利率预期策略,收益率曲线策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
1、股票投资策略
本基金采取自下而上与自上而下相结合的投资策略,贯彻基金管理人的“核心企业”投资理念,具体投资策略如下:
(1)类别资产权重的确定
基金管理人关注各资本市场间的资金流动对股票市场景气度的影响,并在对比股票市场的市盈率水平、股息率水平以及评估股票市场的政策风险后,决定基金的股票仓位比例。
(2)行业/风格权重的确定
基金管理人对于行业/风格权重的确定主要通过把握经济结构及消费结构变迁的趋势,并在行业周期性分析及行业景气度分析的基础上,形成对行业/风格的投资建议并确定其在投资组合中的权重。
行业/周期性及景气度分析主要包括:分析行业的库存、销售额、销售利润率以及上下游行业的库存、销售额、销售利润率,对行业所处的周期及景气度做出判断。
(3)诺安核心竞争力分析系统辅助下的个股选择
经济发展的历史证明,经济增长的动力80%往往来自于20%的领先行业和核心企业,同时证券市场上涨过程中80%的动力也往往来自于20%的核心股票,与此相适应的是,80%的研究支持应该聚焦在最值得研究的20%的核心企业上。基金管理人将投资研究程序及投资研究系统应有足够的自适应能力,将投资研究力量自动调整到20%的核心股票上。
基金管理人根据这一“核心企业”的投资理念,开发出“诺安核心竞争力分析系统”,该系统的目的在于筛选出行业中的强势企业。
a.关键因素选股模型(Key Factor Model)
关键因素选股模型的投资理念在于:各个行业具有不同的特性,不同的行业中,获得成功的企业需要不同的核心竞争力,也表现出不同的指标特征。基金管理人将这些指标称为基金管理人选股的关键因素。关键因素选股模型是根据不同的行业特性,选择不同的关键因素进行股票筛选的方法。关键因素选股是诺安核心竞争力分析系统中对全部股票进行的第一层筛选,将约40%—45%的股票。这一模型是个多因素模型。
b.核心竞争力分析(Core Competence Analysis)
对于根据关键因素选股模型筛选出来的公司,诺安核心竞争力分析系统将辅助基金管理人将研究人员进入第二轮的筛选,选择出真正具有核心竞争力的企业。这一轮筛选中主要关注如下几个方面:
关键因素表现优异的公司是否利润方面同样表现优异;利润方面表现优异的含义指的是公司利润表现持续领先行业内所有上市公司的平均水平高,这里基金管理人观察的是ROE、毛利率水平、净利率水平、经营性利润增长率等常用的利润分析指标。
商业模式持续性分析:这是诺安核心竞争力分析中中最关键的一层分析,也是主观性最强的一层分析,需要研究员理解上市公司取得成功的商业模式,并判断该商业模式在该公司继续扩张的时候是否容易复制,或者根据现有的趋势及行业信息判断该商业模式还能否适用。
公司治理结构分析:在基金管理人的上市公司治理结构分析系统中,良好的公司治理结构包括:管理层稳定、信息透明、控股股东没有侵害中小股东利益的不良记录、关联交易符合“三公”原则、内部控制符合监管逻辑等。
以上两层筛选构成诺安核心竞争力分析系统,通过这两层筛选的股票,形成基金管理人选的备选股票库。这一备选股票库在经过过滤、调研以及对比筛选后,将进入基金的投资组合。
c.股票估值模型
①估值指标
本基金基金管理人的估值模型—选股指标,但是对于某些行业,基金管理人也会选择有效的指标,例如,有线电视网络行业基金管理人会使用EV/EBITDA以及单位用户价值等指标。
PEG中的P/E根据当前的价格以及当年的预测利润计算,增长率G根据未来3年的预测年均增长率计算,PEG越低越好。
②行业分析
行业分析包括行业周期及景气分析,还包括行业竞争结构分析,这些分析的结果并不形成新的评估指标,而是会融入到对PEG的估计中。尽管如此,在诺安核心竞争力分析系统中,这还会根据行业的具体库存情况,应收账款变化以及产品价格波动判断对行业目前所处的周期阶段及景气度做出判断,并据此对行业估值产生影响。
对于垄断性行业,行业分析的目的是预测产品提价的能力及实施的可能性,分析结果同样会体现在PEG的估计结果中。
行业竞争结构分析主要根据波特(Porter)的行业竞争5要素分析行业的竞争结构是优良的还是恶劣的,并形成一个评估结果。行业竞争结构优良的企业,基金管理人会比较放心,使用较乐观的估值指标;对于行业竞争结构恶劣的企业,基金管理人会对估值指标打一定的折扣。
经过以上三层的筛选,预计可以筛选出10%的优质企业,形成本基金的核心股票库,研究员及基金经理在此基础上,进行深入调研,了解企业的实际情况与模型中做的估计是否相符,并经过基金经理的对比选择后,就可以进入基金的投资组合。
2、债券投资策略
本基金实施积极的债券投资策略。本基金管理人将实施利率预期策略、收益率曲线模拟、收益率溢价策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
3、投资决策基本程序
(1)投资决策委员会审定基金资产配置方案,并根据市场形势对资产配置方案进行调整;
(2)研究部在诺安核心竞争力分析系统的辅助及指引下,构建核心股票库,并对该库中的核心股票进行持续跟踪调研;研究部为投资管理部提供股票及债券的投资决策支持;
(3)基金经理在投资管理部总监领导下,借助研究部门研究报告的支持,拟订行业配置策略;个股选择策略以及债券投资策略;
(4)投资决策委员会对投资管理部的策略报告进行论证分析,并形成初步决议;
(5)根据投资决策委员会会议决议及授权,基金经理构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易室执行;
(6)中央交易室按有关交易规则执行,并将有关信息反馈投资管理部;
(7)合规与风险控制部定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案;
(8)风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资操作中的风险状况;监察稽核部重点监控基金投资组合的投资范围和流动性风险。
九、基金的业绩比较标准
本基金业绩投资部分的业绩评价基准将采用标普中国指数、债券投资部分的业绩评价基准将采用上证指数国债指数,整个基金的投资业绩比较基准为资产配置比例加权的复合指数:65%×标普中国A股综合指数+35%×上证指数指数。
十、基金的风险收益特征
诺安平衡证券投资基金是平衡型基金。平衡型基金属于混合基金,风险低于股票型基金,收益水平高于债券基金。
十一、基金的投资组合报告
本基金投资组合报告截止日期为2015年9月30日,本报告中列示的数据未经审计。
(一)报告期末按资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,355,162,904.28	73.00
	其中:股票	1,355,162,904.28	73.00
2	固定收益投资	406,010,000.00	21.87
	其中:债券	406,010,000.00	21.87
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	78,734,495.57	4.24
7	其他资产	16,435,668.89	0.89
8	合计	1,866,342,968.73	100.00

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	748,312,235.92	41.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	18,712,603.80	1.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	299,489,277.04	16.67
J	金融业	10,307,604.06	0.57
K	房地产业	25,512,034.47	1.42
L	租赁和商务服务业	137,576,292.29	7.66
M	科学研究和技术服务业	15,988,095.48	0.89
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	99,284,761.22	5.53
S	综合	-	-
	合计	1,355,162,904.28	75.44

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	300224	正海磁材	3,000,000	75,300,000.00	4.19
2	300144	宋城演艺	3,206,385	72,400,173.30	4.03
3	002638	百川股份	1,699,814	68,332,522.80	3.80
4	300159	新研股份	4,549,800	67,382,530.00	3.75
5	002183	怡亚通	1,499,919	65,081,485.41	3.62
6	002439	明明星展	2,500,000	63,250,000.00	3.52
7	600446	金明股份	2,437,815	61,944,879.15	3.45
8	002292	奥飞动漫	2,000,000	58,520,000.00	3.26
9	000971	蓝思科技	2,305,461	56,308,093.39	3.08
10	600893	中航动力	1,300,000	53,118,000.00	2.96

(四) 报告期末按券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	395,977,000.00	22.04
	其中:政策性金融债	385,096,000.00	21.47
4	企业债券	10,033,000.00	0.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	406,010,000.00	22.60

(五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细					
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	140220	14国开20	1,200,000	123,192,000.00	6.86
2	150201	15国开10	500,000	50,615,000.00	2.82
3	110306	11进出06	500,000	50,345,000.00	2.80
4	110221	11国开21	500,000	50,050,000.00	2.79
5	100312	10进出12	400,000	40,124,000.00	2.23

(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			
--------------------------------------	--	--	--

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	140220	14国债20	1,200,000	123,192,000.00	6.86
2	150201	15国债01	500,000	50,615,000.00	2.82
3	131036	13进出06	500,000	50,345,000.00	2.80
4	110221	11国债21	500,000	50,050,000.00	2.79
5	100312	10国债12	400,000	40,124,000.00	2.23

(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

明
本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
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
本基金本报告期末未持有权证。
1、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.1.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投资股指期货。
2.本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。
(十一)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。
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投资国债期货。
3.本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
(十二)基金投资组合报告附注
(一)基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情况,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
2.本基金本报告期末投资组合中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3.期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,758,302.96
2	应收证券清算款	4,741,828.56
3	应收股利	-
4	应收利息	7,744,382.06
5	应收申购款	19,072,680
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,435,668.89

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。
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	000071	盐湖控股	55,308,009.39	3.08	重大资产重组
2	002183	怡亚通	65,081,485.41	3.62	重大事项
3	600446	金明股份	61,944,879.15	3.45	重大资产重组

6.投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
十二、基金的投资人
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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金基金合同生效后,各阶段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益比较如下表所示:

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)
2004.5.21-2004.12.31	1.48%	0.54%	-19.17%	1.23%	20.65%	-0.79%
2005.1-2006.12.31	8.39%	0.81%	-10.08%	1.31%	18.47%	-0.50%
2006.1-2008.12.31	123.47%	1.20%	102.40%	1.33%	21.07%	-0.13%
2007.1-2008.12.31	96.30%	1.69%	92.60%	1.48%	-6.20%	0.21%
2008.1-2008.12.31	-42.75%	1.93%	-44.62%	1.97%	1.87%	-0.14%
2009.1-2009.12.31	51.04%	1.49%	62.46%	1.32%	-11.42%	0.17%
2010.1-2010.12.31	-3.41%	1.23%	-0.50%	1.02%	-2.91%	0.21%
2011.1-2011.12.31	-23.83%	0.96%	-17.82%	0.87%	-6.01%	0.08%
2012.1-2012.12.31	4.56%	0.98%	5.23%	0.86%	-0.67%	0.02%
2013.1-2013.12.31						