

德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016年第1号)

德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可【2015】3882号文注册募集。自2015年6月29日至2015年6月16日通过销售机构公开发售。本基金为契约开放式基金。本基金的基金合同于2015年6月19日正式生效。

重要提示

德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经2015年5月12日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]882号文准予募集注册。本基金的基金合同于2015年6月19日正式生效。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资者有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,并自行承担基金投资中出现的各类风险,包括但不限于政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理人实施过程中产生的基金管理人风险,基金投资过程中产生的操作风险,因收支违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特定风险,等等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为货币型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金的投资业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本招募说明书中涉及与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年12月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:德邦基金管理有限公司
住所:上海市虹口区吴淞路218号宝钢国际大厦35层
办公地址:上海市虹口区吴淞路218号宝钢国际大厦35层
法定代表人:姚文平
成立时间:2012年3月27日
组织形式:有限责任公司
注册资本:人民币2亿元
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:中国证监会证监许可[2012]249号
经营范围:基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

存续期间:持续经营
联系人:刘利
联系电话:021-26010999

公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
德邦证券股份有限公司	70%
德邦上海资产管理有限公司	20%
德邦证券股份有限公司	10%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

姚文平先生,董事长,硕士,国籍中国。复星财富管理集团执行总裁,德邦证券股份有限公司董事长。中国证券业协会互联网金融专业委员会副主任委员,上海新金融研究院创始理事。曾先后于南京大学、华泰证券、东海证券工作,对于证券经纪、投资银行、固定收益、资产管理等业务具有丰富的管理经验,同时在财富管理、资产证券化、对冲基金的基金等方面颇有创新。

林燕女士,董事,博士,国籍加拿大。德邦证券股份有限公司常务副总裁,加拿大通用注册会计师,中国证券业协会行业自律监察专业委员会委员。曾先后任大鹏证券有限责任公司助理财务总监,加拿大Assante Advisory Services财务总监,荷兰合作银行香港分行资深副总经理,美国Investors Bank & Trust Company多伦多分公司经理。

董振东先生,董事,硕士,国籍中国。现任西子联合控股有限公司战略投资部长。曾任中国银行江苏省分行担任计划部国际、新利软件集团股份有限公司担任投资部副总监,浙江国创创业投资有限公司高级经理,杭州锅炉集团股份有限公司证券事务代表。

骆敏女士,董事,学士,国籍中国,审计师,高级会计师。现任浙江省国际经贸集团有限公司纪委委员、部门经理。

易强先生,董事,硕士,国籍中国。现任德邦基金管理有限公司总经理,历任招商基金管理有限公司业务发展部副总监,比利时联合资产管理有限公司中国区业务发展总监,比利时联合资产管理有限公司上海代表处首席代表,美元元元基金管理有限公司总经理。

吕红兵先生,独立董事,硕士,国籍中国。高级律师,国浩律师事务所首席执行合伙人,中华全国律师协会党组成员、副会长,金融证券业务委员会主任,第七届上海市律师协会会长,中国证监会第六届股票发行审核委员会专职委员、中国证监会重组委咨询委员、上海证券交易所上市公司委员会委员。上海国际贸易仲裁委员会、上海仲裁委员会及仲裁员、复旦大学、中国人民大学、华东政法大学、上海外贸大学等高校兼职或客座教授。

刘少波先生,独立董事,博士,国籍中国。现任暨南大学社会科学研究所处长、金融研究所所长、广东经济学会副会长、广东股份经济与证券市场研究会副会长兼秘书长、广东房地产业协会常务理事、广东证券业协会顾问、广东科技风险投资公司特聘专家、广东省政府WTO事务咨询理事会理事。

2、监事会成员

胡宝发先生,监事会主席,学士,国籍中国。现任德邦证券股份有限公司财务管理部副经理,曾任任职于国联证券漕宝路营业部、国联证券邯郸路营业部。

陈亮先生,监事,国籍中国。现任浙江省国际贸易集团有限公司金融产业部专员。曾任浙江省国际贸易集团有限公司金融资产管理(金融与产业)部助理专员,信利资本集团投资部投资经理。

王刚先生,职工监事,硕士,国籍中国。现任德邦基金管理有限公司监察稽核部总经理,曾任天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理、职工董事、子公司监事。

梁家斌先生,职工监事,学士,国籍中国。现任德邦基金管理有限公司信息技术部副总监,曾任职于恒川软件系统有限公司。

3、高级管理人员

姚文平先生,董事长,硕士。(简历请参见上述董事会成员介绍)

易强先生,总经理,硕士。(简历请参见上述董事会成员介绍)

汪晖先生,副总经理,投资研究部总经理,硕士。曾任华泰证券股份有限公司研究员、投资经理、高级投资经理,华宝信托公司信托基金经理,华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、基金投资经理、基金经理,投资总监,具有15年以上的证券投资基金管理经验。

李定荣先生,督察长,硕士。曾任长城证券研究员,华安证券研究所副所长,华富基金管理有限公司监察稽核部总监,金元比联基金管理有限公司监察稽核部总监。2013年加入德邦基金管理有限公司,曾任监察稽核部总监。

4、基金经理

许文波先生,硕士,毕业于吉林大学工商管理硕士,从业14年。曾任东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部部门经理、高级投资经理、投资主办助理、定向资产管理计划投资主办人、集合资产管理计划投资主办人;东北证券股份有限公司研究所策略研究员;新华证券有限责任公司证券投资分析师,2015年7月加入德邦基金,现任公司研究部副总监。目前担任德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金、德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

本基金经理基本情况:

何晟先生,2016年6月19日至2015年9月11日管理本基金。

5、投资决策委员会成员

汪晖先生,副总经理,投资研究部总经理。(简历请参见上述高级管理人员介绍)

雷鸣先生,首席策略师。学士,毕业于上海财经大学EMBA专业,从业19年。历任上海瑞盈投资管理有限公司副总裁兼首席宏观分析师、德邦证券首席策略师、上海国联投资管理有限公司研究部经理、华龙证券分析师、上海证联投资服务有限公司分析师、上海新兰德投资管理有限公司分析师。

黎莹女士,基金经理。硕士,毕业于复旦大学生理学专业,从业15年。曾任群益证券医药行业研究员,2014年4月起在德邦基金管理有限公司任投资研究部研究员。自2015年4月起任本公司投资研究部基金经理助理,目前担任德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

陈利女士,基金经理,硕士,毕业于上海财经大学数量经济专业,从业4年。自2011年11月硕士毕业后即加入德邦基金投资研究团队,自2015年5月起任公司投资研究部基金经理助理。目前担任德邦德信中证中高分收益债指数分级证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦纯债18个月定期开放债型基金证券投资基金的基金经理。

许文波先生,硕士,毕业于吉林大学工商管理硕士,从业14年。曾任东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部部门经理、高级投资经理、投资主办助理、定向资产管理计划投资主办人、集合资产管理计划投资主办人;东北证券股份有限公司研究所策略研究员;新华证券有限责任公司证券投资分析师,2015年7月加入德邦基金,现任公司研究部副总监。目前担任德邦新动力灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金、德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

韩庭博,硕士,毕业于英国雷丁大学金融工程专业。从业8年,曾任首都银行资金总部交易员、东方汇理银行资金总部交易员、中国建设银行天津分行资金部交易员。2015年9月加入德邦基金,现任公司固定收益部研究员兼基金经理助理。

张翔先生,硕士,7年以上证券、基金从业经历。历任汇富策略投资顾问有限公司助理副经理,派杰亚洲证券有限公司研究员及产品经理助理,华富基金管理有限公司机构投资理财经理、机构理财部高级经理,德邦基金管理有限公司机构专户部经理。目前担任德邦鑫星灵活配置混合型证券投资基金、德邦增利货币市场基金的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:洪渊

(二)主要人员情况

截至2015年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工205人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管业务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企事业单位提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资产、企业年金基金、QDII资产、ODII资产、股权投资基金、证券投资基金集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金专户特定客户资产管理、ODII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年9月,中国工商银行共托管证券投资基金496只。自2003年以来,本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的40项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构
(1)德邦基金管理有限公司上海直销中心
住所:上海市虹口区吴淞路218号宝钢国际大厦35层
办公地址:上海市虹口区吴淞路218号宝钢国际大厦35层
法定代表人:姚文平
联系人:王伟
公司总机:021-26010999
直销电话:021-26010928
直销传真:021-26010960
客服热线:400-821-7788
网址:www.dbfund.com.cn

2、销售机构

(1)德邦证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:朱磊
电话:021-68761616
传真:021-68767032
客服电话:400-8888-128
公司网站:www.tebon.com.cn
(2)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨红红
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38676666
客服热线:400-8888-666/95521
网址:www.gtja.com
(3)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:陶海
客服电话:400-181-8188
联系人:许云婷
电话:021-54509988
传真:021-54509981
网址: www.1234567.com.cn
(4)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区广虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
联系人:张格
电话:021-38509735
传真:021-38509777
网址:www.noah-fund.com
(5)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕪川路6475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:沈静波
客服电话:400-821-5399
联系人:张格
电话:021-38509735
传真:021-38509777
网址:www.noah-fund.com
(6)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕪川路6475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:沈静波
客服电话:400-821-5399
联系人:张格
电话:021-38509735
传真:021-38509777
网址:www.noah-fund.com
(7)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66号1号楼12层1208号
办公地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
法定代表人:罗细安
客服电话:400-001-8811
联系人:李皓

电话:010-67000988
传真:010-67000988-6000
网址:www.zvcv.com.cn
(8)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
法定代表人:林卓
客服电话:400-6411-999
联系人:孙先帅
电话:0411-88891212
传真:0411-84396536
网址:www.taichengcaifu.com
(9)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09单元
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:400-821-9031
联系人:陈思乐
电话:021-20662010
网址:www.lufunds.com
(10)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
客服电话:400-046-6788
电话:021-52822063
传真:021-52975270
网址:www.66zichen.com
(11)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2幢220室
办公地址:浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:唐诗洋
电话:021-20691926
传真:021-58787698
客服电话:400-820-2899
公司网址:www.erichfund.com
(12)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
办公地址:上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18楼
法定代表人:王莉
联系人:刘爽
联系电话:021-20835888
传真号码:021-20835879
客服热线:400-920-0022
公司网址:www.licaike.com
(13)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四栋10层1006
法定代表人:杨懿
客服电话:400-166-1188
联系人:文雯
联系电话:010-83363101
网址:http://8.bji.com.cn/
(14)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区南1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人:陆敏
联系电话:021-20613999
网址:www.ehowbuy.com
(15)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1号903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
客服电话:400-8773-772
联系人:董一峰
电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
公司网址:www.5ifund.com
(16)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:冯修敏
客服电话:400-820-2819
电话:86-021-33323999
传真:86-021-33323921
网址:https://tty.chinapnr.com/
(17)浙江金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:陈峰
客户电话:400-068-0058
电话:0571-88337788
公司网站: www.jincheng-fund.com
(18)其他销售机构的具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

(二)登记机构

名称:德邦基金管理有限公司
住所:上海市虹口区吴淞路218号宝钢国际大厦35层
办公地址:上海市虹口区吴淞路218号宝钢国际大厦35层
法定代表人:姚文平
联系电话:021-26010999
联系人:吴培金
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号19楼
办公地址:上海市银城中路68号19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所
法定代表人:葛明
住所:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
邮政编码:100738
公司电话:010-58153000
公司传真:010-58188298
签字会计师:陈露、陶育化
业务联系人:陶育化
四、基金的名称
德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金
五、基金的类型
本基金类型:契约型开放式、混合型基金
六、基金的投资目标
在严格控制风险的前提下,本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,在精选个股、个债的基础上,追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、交易级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为0-95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、现金、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的5%;每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易所保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政

府债券不低于基金资产净值的5%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

1.资产配置策略
本基金根据对宏观经济周期、国家财政和货币政策以及资产市场环境、证券市场走势的分析,通过战略资产配置决策对权益类资产、固定收益类资产进行动态配置。本基金同时还基于经济结构调整过程中的动态变化,通过策略性资产配置把握市场时机,来追求基金资产的长期稳健增值。

2.股票投资策略

(1)行业配置策略
在行业配置层面,本基金将运用“自上而下”的行业配置方法,通过对国内外宏观经济走势、经济结构转变的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究,对不同行业进行横向、纵向比较,并在此基础上判断行业的可持续发展能力,从而确定本基金的行业布局。

(2)个股投资策略

本基金将在确定行业配置之后在备选行业中,“自下而上”地精选出具有持续成长性、竞争优势、估值水平合理的优质个股。

(1)基本面定性分析:本基金将重点考察分析包括公司投资价值、核心竞争力、公司治理结构、市场开发能力、商业模式优势、资源优势等方面的综合竞争实力,挖掘具有较大成长潜力的公司。

(2)价值定量分析:本基金通过对上市公司成长能力、收益质量、财务品质、估值水平进行价值量化评估,选择价值被低估、未来具有相对成长空间的上市公司股票,形成优化的股票池。

3.固定收益投资策略

本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。

4.股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

5.权证投资策略

本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中以权证的市值占基金资产净值的比例作为主要依据,以主动式的科学投资管理为手段,综合考虑股票公允价值、标的股票价格,结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证合理价值,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求基金资产稳定的当期收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。

本基金选择该业绩比较基准的原因如下:

沪深300指数成份股选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A 股市场总体发展趋势,适合作为本基金股票投资的比较基准。债券组合的业绩基准则采用了中证综合债券指数,中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数,该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,具有较强的市场代表性。

如果相关法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经基金管理人与基金托管人协商,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

十一、基金投资组合报告

本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定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止2015 年09月30日,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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	58,556,879.35	4.39
	其中:股票	58,556,879.35	4.39
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	1,220,552,036.20	91.59
	其中:债券	1,220,552,036.20	91.59
	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	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	25,056,328.32	1.94
8	其他资产	27,600,899.67	2.07
9	合计	1,332,576,135.55	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	15,172,254.35	1.45
B	采矿业	--	--
C	制造业	32,391,125.00	3.09
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	2,161,500.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,832,000.00	0.84
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	--	--
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	--	--
S	综合	--	--
	合计	58,556,879.35	5.59

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	600255	鑫科材料	6,946,500	29,522,625.00	2.82
2	600540	新赛股份	1,683,035	15,172,254.35	1.45
3	002410	广联达	640,000	8,832,000.00	0.84
4	000626	如意集团	50,000	2,161,500.00	0.21
5	600566	慧球科技	200,000	2,161,500.00	0.21
6	000039	中集集团	50,000	885,500.00	0.08

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	142,230,000.00	13.58
	其中:政策性金融债	142,230,000.00	13.58
4	企业债券	967,896,036.20	91.40
5	企业短期融资券	120,336,000.00	11.49
6	中期票据	--	--
7	可转债	--	--
8	其他	--	--
9	合计	1,220,552,036.20	116.46

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