

九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要

基金管理人:九泰基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
重要提示
本基金的募集申请经中国证监会2014年10月29日证监许可【2014】11135号文注册。本基金的基金合同于2015年7月23日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人因在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,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。

本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。本基金可投资于中小企业私募债券,中小企业私募债券是指中小企业债券在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券,其发行人是非上市公司中小微企业,发行方式为面向特定对象的私募发行。因此,中小企业私募债券较传统企业债券的信用风险和流动性风险更大,从而增加了本基金整体的债券投资风险。

基金的过往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并不构成新基金业绩表现的保证。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年1月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据未经审计)。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人的基本情况

名称:九泰基金管理有限公司
住所:北京市丰台区丽泽路18号院1号楼801-16室
办公地址:北京市西城区广仁伯街2号金泽大厦西区6层
设立日期:2014年7月3日
法定代表人:卢伟忠
组织形式:有限责任公司
注册资本:2亿元人民币
存续期限:2014年7月3日至长期
联系人:肖嘉虎
联系电话:010-52601666
股权结构:昆吾九鼎投资管理有限公司,同创九鼎投资管理集团股份有限公司,拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司、九州证券有限公司出资分别占注册资本的26%、25%、25%和24%的股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员

吴强先生,管理学硕士,董事长。曾任万联证券投资部业务经理,宏源证券资本市场部副总经理,安信证券投资部业务副总裁,国信证券投资部总经理助理。现任昆吾九鼎投资管理有限公司董事、副总经理,九州证券有限公司董事长,九州证券有限公司董事长。

卢伟忠先生,金融学硕士,董事、法定代表人,总经理。曾任金融规划研究员,安信证券股指期货IB业务专员,安信期货办公室主任,安信期货IB业务部总经理,安信证券资产管理部总监,安信乾盛资产管理部副总经理。现任九泰基金管理有限公司董事、法定代表人,总经理。

吴刚先生,管理学硕士,董事。曾任广发证券投资银行部项目经理,中国证监会机构监管部副处长、处长。现任北京同创九鼎投资管理股份有限公司董事长。

陈晓红女士,工学博士,独立董事。曾任中南工业大学管理工程系副院长,日本东京东工业大学高级访问学者,中南大学商学院名誉院长兼教授(学术)委员会主任、校长助理。现任中南大学商学院教授,中国管理学会副理事长。

徐艳女士,经济学博士,独立董事。曾任长春税务学院金融系国际金融教研室主任,海国证券工业开发股份有限公司投资部经理,现任海南大学MBA教育中心主任职务,学院学位委员会委员、院学术委员会委员等职务。

2.监事会成员

古志鹏先生,大学本科,监事。曾任毕马威会计师事务所经理助理,中国科学院中国科学传播研究所业务主管,昆吾九鼎投资管理有限公司吉林业务部负责人、东北业务大区总经理。现任北京同创九鼎投资管理有限公司董事会秘书。

刘开运先生,金融学硕士,监事。曾任毕马威会计师事务所审计助理,昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。现任九泰基金管理有限公司基金经理。

3.公司高级管理人员

卢伟忠先生,简历如上。

王玉女士,涉外经济本科,副总经理。曾任陕西群力子弟学校教师,北京恩拓克斯商贸有限公司经理助理,太平洋人寿保险北京分公司营销业务部经理,海证投资有限公司总经理,分公司党委委员、副总经理,国风共创管理咨询有限公司总经理。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

王彦斌先生,经济学硕士,董事会秘书。曾任中国建设银行邯郸市分行科员,平安证券有限责任公司科员,银华基金管理有限公司业务主管,信达澳银基金管理有限公司基金运营中心副总经理、监察稽核总监,九泰基金管理有限公司总经理助理。现任九泰基金管理有限公司董事会秘书。

南海波先生,经济学硕士,督察长。曾任南宁铁路局助理工程师,广西新桂社股份有限公司投资部负责人,中国证监会广西监管局主任科员、副处长,中国证监会广西监管局局长助理,九泰基金管理有限公司管委会委员。现任九泰基金管理有限公司督察长。

吴祖尧先生,工学硕士,总经理助理。曾任中国信达信托投资公司证券研究部副经理,中国银河证券研究中心研究主管、董事总经理,中国银河证券投行内核小组成员,中国银河证券投资顾问部董事总经理,中国银河证券投资决策委员会委员。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。

严军先生,工商管理硕士,总经理助理。曾任天津证券深圳营业部电脑部总经理,渤海证券电子商务部总经理兼中心总经理,博时基金管理有限公司运维主管,信达澳银基金管理有限公司运营总监。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。

郑立昌先生,工商管理硕士,总经理助理。曾任立信会计师事务所北京总部高级审计经理,昆吾九鼎投资管理有限公司风险控制部负责人。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。

4.基金经理

王明晰女士,理学硕士,基金经理。7年证券从业经历,历任诺安基金管理有限公司债券交易员,诺安基金管理有限公司基金经理助理,诺安货币市场基金A/B基金经理(2013年7月至2015年1月)。现任九泰基金管理有限公司基金经理。

5.公募基金投资决策委员会成员

本公司公募基金投资决策委员会成员包括:吴祖尧先生(委员会主席)、王玉女士、郑立昌先生、张勇先生。

吴祖尧先生,同上。

王玉女士,同上。

郑立昌先生,同上。
张勇:中国国籍,男,中南财经政法大学硕士,南京审计学院学士,具有基金从业资格,15年证券从业经历,9年基金经理任职经验,3次获得金牛奖。曾任诺明基金现管理部总监,负责公司所有现金管理产品的设计和运作,并领导部门其余投资管理类产品。2015-5-18加入九泰基金管理有限公司任绝对收益部总经理。

6、公司董事长吴强先生与公司董事吴刚先生系兄弟关系。除此以外,上述人员之间无近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1.基本情况
名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人:刘士余
成立日期:2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本:32,479,411.7万元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-66060069
传真:010-68121816
联系人:林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营,可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电

子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值,共同成长。

中国农业银行是中国首批开展银行业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获颁无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金理财”TOP100颁奖典礼中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工140余人,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况
截止至2015年12月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共321只。

第三部分 基金服务机构

一、基金份额发售机构

1.直销机构

(1)九泰基金管理有限公司北京直销中心
办公地址:北京市西城区华远北街2号通港大厦812-818室
电话:010-83369933
传真:010-52601225
邮箱:service@jtamc.com
网站:www.jtamc.com
联系人:潘任会

(2)九泰基金管理有限公司电子交易平台
1)http://trade.jtamc.com
2)代销机构

(1)华泰证券股份有限公司
住所:南京市中山东路90号
法定代表人:吴万善
客户服务电话:95597
网站:www.htsc.com

(2)东莞证券股份有限公司
住所:广东省东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人:张运勇
联系人:李荣
联系电话:0769-22116572
传真:0769-22115712

(3)九州证券股份有限公司
住所:青海省西宁市城西区西大街11号
法定代表人:曲国辉
客户服务电话:400-654321-8
网站:www.tyzq.com.cn

(4)联讯证券股份有限公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
电话:0752-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

(6)大同证券股份有限公司
住所:大同市城区迎宾路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
电话:0352-2119700
网站:www.lxqz.com

联系人:彭莹
(6)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网站:www.cindasc.com

本基金将重点关注在中国经济结构优化、产业结构升级或技术创新过程中成长性确定且估值合理的上市公司以及价值被严重低估的传统行业的上市公司的投资机会。同时,本基金还关注上市公司事件驱动带来的投资机会(如资产重组、并购、再融资、重大技术革新、重大产品创新、重大经营模式创新等)。

在股票投资方面,本基金采用定量分析方法和定性分析方法相结合的策略进行股票投资。并結合基金管理人自身的股票研究平台,多层面地分析备选股票所对应的上市公司业务环节的竞争优势和劣势,分析上市公司治理和公司管理方面的优势和劣势,分析上市公司所处行业波动将五大结构、行业历史及行业变革力量。

在定量分析的基础上,本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系,并结合基金管理人的股票研究平台,多层面地分析备选股票所对应的上市公司业务环节的竞争优势和劣势,分析上市公司治理和公司管理方面的优势和劣势,分析上市公司所处行业波动将五大结构、行业历史及行业变革力量。

经过严格的定量分析和定性分析,最终确定投资组合组合,并适时进行投资组合调整。

3.债券投资策略
本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上,构建债券投资组合。本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略等多种策略进行债券投资。

4.资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析,把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

5、中小企业私募债券投资策略
中小企业私募债券票面利率较高,信用风险较大,流动性较差。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征,选择风险与收益相匹配的品种进行投资。

6.权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

未来,根据市场情况,基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

第九部分 基金的投资业绩基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%

如果今后法律法规发生变化,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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人将本着维护基金份额持有人利益的原则,在与基金托管人协商一致,可以变更业绩比较基准,在履行适当程序后报中国证监会备案,并在中国证监会指定媒介及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

第十一部分 基金的风险收益特征
本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。

第十二部分 基金销售机构
九泰基金管理有限公司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法律责任。

基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告中的净值信息、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12月31日,本报告中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 | 38,986,723.50 | 15.0 |
| 2 | 其中:股票 | 38,986,723.50 | 15.0 |
| 3 | 固定收益投资 | 2,678,001.80 | 0.10 |
| 4 | 其中:债券 | 2,678,001.80 | 0.10 |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 贵金属投资 | - | - |
| 7 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 8 | 买入返售金融资产 | 1,670,043,915.60 | 64.11 |
| 9 | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 10 | 银行存款和结算备付金合计 | 400,562,186.93 | 15.37 |
| 11 | 其他资产 | 493,066,034.39 | 18.92 |
| 12 | 合计 | 2,005,686,982.12 | 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 | 228,000.00 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 269,322.22 | 0.01 |
| C | 制造业 | 14,827,762.77 | 0.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 221,544.00 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 2,118,971.96 | 0.08 |
| F | 批发和零售业 | 1,363,156.32 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 46,548.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息技术、软件和信息技术服务业 | 1,715,840.26 | 0.07 |
| J | 金融业 | 15,478,538.88 | 0.59 |
| K | 房地产业 | 363,887.00 | 0.01 |
| L | 租赁和商务服务业 | 261,500.00 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 254,574.70 | 0.01 |
| 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 | 1,817,067.40 | 0.07 |
| S | 综合 | - | - |
| 合计 | | 38,986,723.50 | 15.0 |

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

| | | | | (元) | (%) |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 1 | 600016 | 民生银行 | 585,321 | 5,642,494.44 | 0.22 |
| 2 | 601328 | 交通银行 | 460,162 | 2,963,443.28 | 0.11 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 563,200 | 2,579,466.00 | 0.10 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 79,600 | 1,779,060.00 | 0.07 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 91,148 | 1,639,752.52 | 0.06 |
| 6 | 601988 | 招商银行 | 287,500 | 1,152,875.00 | 0.04 |
| 7 | 603608 | 思摩尔控 | 14,605 | 1,138,852.00 | 0.04 |
| 8 | 603999 | 读者传媒 | 16,713 | 982,724.04 | 0.04 |
| 9 | 603866 | 桃李面包 | 23,133 | 893,165.13 | 0.03 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 30,800 | 894,224.00 | 0.03 |

4 报告期末持仓债券中品种分布的债券投资组合