

# 德盛精选股票证券投资基金招募说明书(更新)摘要

## 基金管理人:国联安基金管理有限公司 基金托管人:华夏银行股份有限公司

【重要提示】  
本基金经 2005 年 11 月 17 日中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】188 号文核准募集。本基金的基金合同于 2005 年 12 月 28 日正式生效。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书。  
基金的过往业绩并不预示其未来表现。  
本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本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(更新)所载内容截止日为 2008 年 12 月 31 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2008 年 12 月 31 日(财务数据未经审计)。

**一、基金合同生效日期:2005 年 12 月 28 日**  
**二、基金管理人**  
(一)基金管理人概况  
名称:国联安基金管理有限公司  
(住所/办公地址):上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 46 楼  
设立日期:2003 年 4 月 3 日  
法定代表人:符学东  
联系电话:021-50478080  
联系人:董晓榕  
注册资本:人民币 1 亿元  
目前股权结构:

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

(二)主要人员情况  
1. 董事会成员  
0 符学东先生,董事长,经济学硕士,高级经济师,中共党员。历任国家体制改革委员会分配司副处长、国泰君安总公司总裁助理、国泰君安证券股份有限公司副总裁。现担任国联安基金管理有限公司董事长。

0 Bruce Kho 钊耀发 先生,副董事长,注册会计师。历任德盛安联资产管理(香港)有限公司亚太区行政总裁,现担任德盛安联资产管理公司(AGI)亚太区区长。

0 沈江先生,董事,德国基尔大学企业管理硕士,历任德累斯登银行德国法兰克福总部机构投资银行部投资顾问,机构资产管理资深投资顾问,机构资产管理驻远东区代表,德累斯登银行德国法兰克福总部业务发展部资深经理,台湾德盛证券投资信托股份有限公司执行董事兼总经理,国联安基金管理有限公司总经理。

0 庞启斌先生,董事,经济学博士,历任君安证券营业部经理,君安证券资产管理公司研究部总经理,君安证券香港总公司研究策略部副经理,君安证券经纪管理部副经理,君安证券债券部总经理,君安证券副总裁。现同时担任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

0 李迅雷先生,董事,硕士。曾任职于上海财经大学研究所,君安证券研究所。现任国泰君安证券股份有限公司总裁助理,研究所所长和销售交易部总经理,中国证券分析师委员会副主任委员。

0 Andrew Douglas Eu 徐义焜 先生,董事,工商管理硕士。历任怡富证券投资咨询有限公司高级研究分析员,投资经理,董事(地区业务),JP 资产管理有限公司董事,行政总裁。现任德盛安联资产管理(亚太)区行政总裁,董事,德盛安联资产管理(香港)有限公司董事,德盛安联资产管理公司董事,德盛安联资产管理(日本)公司董事,德盛安联资产管理(卢森堡)公司董事,香港证券及期货事务监察委员会咨询委员会委员。

0 卢冠祥先生,独立董事,本科学历,高级经济师。历任上海市物资局局长,上海市经济委员会副主任,上海市计划委员会副主任,申能集团有限公司党委书记、董事长。

0 王丽女士,独立董事,法学博士。曾在山东师范大学、中国政法大学任教,1988 年转到司法部工作,历任副处长、处长,1993 年受司法部指派筹建中国律师事务所中心,任常务副主任、主任,后中心更名为德恒律师事务所,任主任。现任德恒律师事务所主任,首席全球合伙人,德恒律师事务所院长,教授,清华大学、北京大学研究生导师,中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。

0 Bernd-Uwe Stucken 先生,独立董事,法学博士,他是一位拥有超过 15 年商业经验的执业律师,有 8 年在中国从业经验。现同时担任 Haumann Hemmelrath & Partner's and Haumann Hemmelrath Management Consultants 上海代表处的执行合伙人。Sto AG and Seebor 公司的董事。

0 Thilo Kottner 先生,独立董事,经济管理博士,德国注册会计师,历任德国 NEXIA 国际集团审计经理,Carl Zeiss Semicorponent Manufacturing Technologies SMT AG 会计主管,以色列 Microtec Technologies Inc.董事,现经德恒纽伦堡罗德德会计师事务所(有限责任)合伙团队委派至罗德德会计师事务所(有限)合伙团队担任上海代表处担任首席代表。

3. 监事会成员  
0 蒋忆明先生,监事会主席,会计师,博士。历任深圳宇康太阳能有限公司财务部经理,君安证券分公司经营财务部副经理,资金计划部副经理,总经理,君安证券公司财务总监、国泰君安证券股份有限公司深圳分公司副经理,国泰君安证券股份有限公司总会计师。现任国泰君安证券(香港)有限公司财务总监。

0 Xie Chun Hung 林(蔡俊雄),特许金融分析师(CFA),澳洲执业会计师,财务学博士。历任 Tishco Marine & Fire Insurance(新加坡)会计主任,Sun Alliance Insurance(新加坡)会计师,Swiss Reinsurance(新加坡及香港)会计总监,安联保险亚太区财务总监。现任安联资产管理(亚太)区财务总监。

0 唐蔚女士,职工监事,硕士。曾任职于君安证券有限责任公司法律室,国泰君安证券股份有限公司法律事务总部,现担任本公司总经理助理兼监察稽核部总监兼董事会秘书。

3. 公司高级管理人员  
0 卢小松先生,总经理,经济学博士。历任深圳证券交易所综合研究所副所长,南方基金管理有限公司首席经济学家,副总经理。

0 谢荣兴先生,董事长,高级会计师,上海市政协委员,民主党派。历任上海万国证券公司黄浦营业部总经理,上海万国证券公司副总经理,董事和交易总监,君安证券有限责任公司副总裁、董事,国泰君安证券股份有限公司总经济师,国泰君安投资管理股份有限公司副董事长兼总裁。

4. 本基金基金经理简介  
李洪波,北京大学经济学硕士。曾任申银万国证券公司证券分析员,投资经理,华夏证券公司营业部总经理,大通证券公司营业部总经理,资产管理总部副总经理,2004 年 10 月加盟国联安基金管理有限公司,从事投资组合管理工作。2005 年 12 月起任德盛精选股票证券投资基金基金经理,2007 年 1 月起兼任德盛优势股票证券投资基金基金经理。

5. 投资决策委员会成员  
投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益业务负责人、研究部负责人及高级基金经理 1-2 人(根据情况)组成。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。  
**三、基金托管人**  
(一)基金托管人基本情况  
名称:华夏银行股份有限公司  
注册地址:北京市东城区建国门内大街 22 号  
办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号  
法定代表人:董炳峰  
组织形式:股份有限公司  
成立日期:1992 年 10 月 14 日  
批准设立机关及批准设立文号:中国人民银行 银复【1992】391 号  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字【2005】25 号  
注册资本:42 亿元人民币  
存续期间:持续经营  
联系人:郑鹏  
电话:010-85238418  
传真:010-85238680  
客户服务中心电话:95577  
(二)主要人员情况  
华夏银行托管部成立于 2004 年 7 月,内设市场综合室、交易管理室和稽核室 3 个职能部门,并设上海、深圳分行设立 2 个托管分部。基金托管部共有员工 26 人,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况  
华夏银行于 2005 年 2 月 23 日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准,获得证券投资基金托管资格,是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管业务管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来,华夏银行基金托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神,始终遵循“安全保管基金资产,提供优质托管服务”的原则,坚持以客户为中心的服务理念,依托严格的内控管理,先进的技术手段,优秀的业务团队,丰富的业务经验,严格履行法律和托管协议所规定的各项义务,为“广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩”。截至 2008 年 12 月末,已托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金、万家货币市场基金、诺安优化收益债券型基金、益民红利成长混合型基金、东吴行业轮动股票基金及其它受托资产产品,托管各类资产规模 272.23 亿元。

**四、相关服务机构**  
(一)基金份额发售机构  
1. 直销机构  
名称:国联安基金管理有限公司  
住所:上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 46 楼  
法定代表人:符学东  
电话:021-50478080  
传真:021-50479059  
网址:www.gjia-allianz.com  
联系人:李斐  
2. 代销机构  
名称:华夏银行股份有限公司  
住所:北京市东城区建国门内大街 22 号  
法定代表人:董炳峰  
电话:010-85238423  
传真:010 85238680  
联系人:陈宇  
客户服务中心电话:95577  
网址:www.hxb.com.cn  
3. 代销机构  
名称:中国工商银行股份有限公司  
住所:北京市西城区复兴门内大街 55 号  
办公地址:同上  
法定代表人:姜建清  
电话:010-66107090  
联系人:田耕  
名称:国泰君安证券股份有限公司  
办公地址:上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层  
法定代表人:祝幼一  
电话:021-38671616  
联系人:冯敏斌  
5. 代销机构  
名称:海通证券股份有限公司  
办公地址:上海市淮海中路 98 号  
法定代表人:王开国  
电话:021-53594566  
联系人:金芸  
6. 代销机构

名称:申银万国证券股份有限公司  
办公地址:上海市常熟路 239 号 2 楼  
法定代表人:谢平  
电话:021-54033888  
联系人:郑晓杰  
7. 代销机构  
名称:广发证券股份有限公司  
办公地址:广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 36 楼  
法定代表人:王浩  
电话:020-87555888-875  
联系人:肖梅梅  
8. 代销机构  
名称:中国银河证券有限责任公司  
办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座  
法定代表人:李尚庆  
电话:010-66568587  
联系人:李洋  
9. 代销机构  
名称:兴业证券股份有限公司  
办公地址:福建省福州市湖东路 99 号标力大厦  
法定代表人:兰荣  
电话:02168419974  
联系人:杨盛芳  
10. 代销机构  
名称:交通银行股份有限公司  
办公地址:上海市银城中路 188 号  
法定代表人:胡怀邦  
电话:021-58781234  
联系人:曹刚  
11. 代销机构  
名称:招商证券股份有限公司  
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层  
法定代表人:曾凡林  
电话:0755-82943666  
联系人:黄健  
12. 代销机构  
名称:招商银行股份有限公司  
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦  
法定代表人:秦晓  
电话:0755-82942000  
联系人:李丽  
13. 代销机构  
名称:联合证券有限责任公司  
办公地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10.24.25 层  
法定代表人:马福明  
电话:0755-82492000  
联系人:刘莹  
14. 代销机构  
名称:中信银行股份有限公司  
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座  
法定代表人:孔丹  
客服电话:95558  
电话:010 65547242  
传真:010 65541281  
联系人:李海  
15. 代销机构  
名称:中国建设银行股份有限公司  
注册地址:北京市西城区市口大街 1 号院 1 号楼  
法定代表人:郭树清  
客服电话:95533  
电话:010 67596003  
联系人:何奕  
16. 代销机构  
名称:上海浦东发展银行股份有限公司  
住所:上海市浦东新区银城中路 500 号  
办公地址:上海中山东一路 12 号  
法定代表人:吉晓辉  
客服中心电话:95528  
电话:021 61618888  
联系人:虞谷云  
17. 代销机构  
名称:国信证券股份有限公司  
住所:深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦  
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层  
法定代表人:何如  
客户服务热线:800-811-8868  
电话:0755 82130033  
联系人:齐晓燕  
18. 代销机构  
名称:上海远东证券有限公司  
办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 5 楼  
法定代表人:田德军  
联系人:高滋生  
电话:021-58788888  
19. 代销机构  
名称:宏源证券股份有限公司  
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路 2 号  
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层  
法定代表人:高冠江  
联系人:师敬泽  
电话:010-62677799  
20. 代销机构  
名称:安信证券股份有限公司  
住所:深圳市福田区金田路 2222 号安信大厦 34 层、28 层 A02 单元  
办公地址:深圳市深南大道 2028 号中国凤凰大厦 1 号楼 7、8、9 层  
法定代表人:牛冠兴  
联系人:潘冬灵  
电话:010-66581661  
21. 代销机构  
名称:东方证券股份有限公司  
住所:上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 楼  
办公地址:上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 楼  
法定代表人:王益民  
联系人:吴宇  
联系方式:6325888-3108  
22. 代销机构  
名称:宁波银行股份有限公司  
住所:宁波市江东区中山东路 294 号  
办公地址:宁波市江东区中山东路 294 号  
法定代表人:陆华裕  
联系人:钱雨佳  
电话:02163586189  
23. 代销机构  
名称:安信证券有限责任公司  
住所:上海证券有限责任公司  
办公地址:上海西藏中路 336 号  
法定代表人:蒋元良  
联系人:冯仪  
电话:021-62793153  
24. 代销机构  
名称:中国建设银行投资证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区福华三路国际商会中心 48-50 层  
法定代表人:杨小川  
联系电话:0755-82026521  
联系人:刘权  
25. 代销机构  
名称:山西证券有限责任公司  
办公地址:太原市府西街 69 号山西国贸中心  
法定代表人:吴晋安  
电话:0351-8686708  
联系人:张治国  
26. 代销机构  
名称:中信建投证券有限责任公司  
住所:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼  
办公地址:北京市东城区朝阳门内大街 188 号  
法定代表人:张佑君  
电话:010-65183888  
联系人:权童  
(二)注册登记机构  
名称:国联安基金管理有限公司  
住所:上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 46 楼  
法定代表人:符学东  
电话:021-50478080  
传真:021-50470826  
网址:www.gjia-allianz.com  
联系人:仲晓峰  
(三)出具法律意见书的律师事务所  
机构名称:上海源泰律师事务所  
注册地址:上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室  
办公地址:上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室  
负责人:廖海  
电话:021-51150298  
传真:021-51150398  
联系人:廖海

经办律师:廖海、吕红  
(四)审计基金财产的会计师事务所  
名称:毕马威华振会计师事务所  
住所(办公地址):上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼  
负责人:蔡廷基  
联系电话:021-53594666  
传真:021-62881889  
联系人:黎晓文  
经办注册会计师:王卫国、陈彦君  
**五、基金的名称**  
本基金名称:德盛精选股票证券投资基金  
**六、基金的类型**  
本基金类型:契约开放式(股票型)  
**七、基金的投资目标**  
通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司来获得长期稳定的收益。  
**八、基金的投资方向**  
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、债券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。  
本基金在股票投资方面的主要投资对象是具有创造价值能力的公司,主要体现在以下三个方面:经营获利能力、资本成本和增长能力。  
本基金在股票投资方面的主要投资对象是具有创造价值能力的公司,主要体现在以下三个方面:经营获利能力、资本成本和增长能力。  
在正常的市场情况下,本基金的资产配置的基本范围为:股票资产占基金资产的 60%-95%;债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%,其中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%。当法律法规发生变化时,上述投资比例将按照届时合法有效的法律法规予以修改,在报中国证监会备案后由基金管理人依法进行公告。  
**九、基金的投资策略及投资程序**  
本基金是股票型基金,在股票投资上主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时,适度把握宏观经济经济运行进行资产配置。具体来说,本基金通过以下步骤进行股票选择:  
首先,通过 ROIC Return On Invested Capital 指标来衡量公司的获利能力,通过 WACC (Weighted Average Cost of Capital) 指标来衡量公司的资本成本;其次,将公司的获利能力和资本成本指标相结合,选择创造出价值能力的公司;最后,根据公司的成长能力和估值指标,选择股票,构建股票组合。  
投资管理流程分为投资研究、投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资评估与监督、风险控制六个环节。  
1. 投资研究  
为保障基金份额持有人的利益,本基金管理人在本投资研究过程中,将定期召开投资决策委员会会议和投资研究联席会议,为投资决策提供准确的依据。  
投资决策委员会对目前宏观经济、金融形势、货币政策、利率水准等总体经济数据及风险预算模型测算的资产配置方案进行分析 and 讨论,对基金经理提交的报告进行讨论和表决,决定各基金在一段时期内的资产配置方案。  
基金经理定期召开的投资研究联席会议主要讨论可投资股票、确定股票库等,为基金投资提供投资对象。固定收益研究组和基金定期研究债券和可转债投资组合的构建与管理。  
2. 投资决策  
0 基金投资策略报告的形成  
风险预算组由数量预测部和风险管理部定期制定,并不定期进行调整。数量策略部和风险管理部通过分析股票部和债券部资产的波动特征,利用风险预算模型和原理测算两类资产的配置比例,为投资决策委员会和基金经理的资产配置决策提供依据。  
基金经理定期结合风险预算、国内外经济形势、市场走势及投资研究会议的讨论结果拟订《投资策略报告》,阐述自身的投资逻辑,并明确下一阶段股票、固定收益类证券、现金和融资的投资比例。  
0 可投资证券备选库的建立和维护  
每季度研究组和基金经理针对不同产业的特征,依据各公司的财务状况、盈利能力及未来成长性,提出可投资证券名单,讨论后确定可投资证券备选库,并上报投资决策。若证券备选库中公司的基本面有重大变化,研究员应及时提出最新的研究报告,并通知投资总监,在取得投资组合管理部同意后作相应调整。  
0 核心证券库的建立和维护  
研究员根据基金经理对可投资证券备选库名单中的公司进行深入的研究和调研,并出具研究报告,经投资研究联席会议讨论后列入“核心”证券库中。  
0 固定收益证券和可转债组合的建立和维护  
债券研究组和基金经理不定期对交易所、银行间等市场交易的固定收益证券和可转债等其它金融工具进行研究,根据对利率期限结构及其它市场因素的判断,确定固定收益证券和可转债的投资对象和范围,并根据证券的市场走势和估值水平构建投资组合。  
基金经理制定或调整投资组合时,原则上须选择核心证券库中的证券。研究员或基金经理对于核心证券库中的证券须持续跟踪其基本面及股价变化,并适时提出修正报告,以利基金经理进行投资决策。  
3. 投资执行  
基金经理在投资分析的基础上进行投资组合管理,并对其投资组合负责。  
基金所有交易行为都通过基金交易部统一执行,一切交易在交易资讯保密的前提下,依照程序公开进行。  
对于违反《基金法》基金合同、投资决策委员会决议和公司投资管理制度的交易指令,交易部经理应立即执行该等指令,并及时通知相关基金经理,并向投资总监、监察稽核部汇报。  
4. 投资跟踪与总结  
基金经理定期与投资总监,对已发生的投资行为进行分析和总结,为未来的投资行为提供正确的方向。  
基金经理定期向投资决策委员会提交所管理基金的《投资总结报告》,对其投资组合的表现进行分析,并对投资过程中的不足提出改进意见。  
如果发现基金可投资证券备选库和核心证券库中的证券的基本面情况有变化的,基金经理可以召开临时投资研究联席会议,讨论是否要修改备选证券库和核心证券库。  
基金经理在投资执行过程中,认为有必要修改资产配置方案或重大投资项目方案的,应首先起草《投资策略报告》或《重大投资项目建议书》,经投资总监审阅后报投资决策委员会讨论决定。  
5. 投资评估与监督  
基金事务部交易清算员通过交易数据的核对,对当日交易操作进行复核,如发现有违反《证券法》、《基金法》、基金合同、相关基金管理制度的交易操作,须立即向投资总监汇报,并同时通报监察稽核部、风险管理部,由相关基金经理、基金交易部、基金交易部负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。  
6. 风险控制  
基金投资管理过程中的风险控制包括两个层次,一个层次是基金投资管理组织体系内部的风险管理,另一个层次是独立的风险管理机构(包括风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部)对投资管理过程的风险监控。  
投资总监负责基金投资管理全流程的风险控制工作,一方面在投资管理过程中切实贯彻风险控制的原则;另一方面根据独立风险管理机构(包括风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部)的风险评估意见,及时制定相应的改进和应对措施,并责成相关部门和人员切实落实执行。  
**十、基金的业绩比较基准**  
本基金的业绩基准为沪深 300 指数×85%+上证国信指数×15%  
如果今后市场有其他代表性更强的业绩比较基准推出,本基金可以在经过适当的程序后变更业绩比较基准。  
本基金为股票型基金,在考虑了该基金投资组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的选股方式和历史情况后,我们选用了沪深 300 指数作为其基金投资组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的上证国信指数。  
本基金股票资产占基金资产的 60%-95%。在正常的市场情况下,基金的平均仓位将可达到 85%,因此,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。  
**十一、基金的风险收益特征**  
中高风险、较高的预期收益。  
**十二、基金的投资组合报告**  
本基金管理人的董事会及董事保证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。  
其基金托管人——华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定,于 2009 年 1 月 15 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 2008 年 12 月 31 日,本报告财务数据未经审计师审计。  
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	948,645,131.17	68.18
	其中:股票	948,645,131.17	68.18
2	固定收益投资	98,760,000.00	7.10
	其中:债券	98,760,000.00	7.10
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	280,745,372.11	20.18
6	其他资产	63,318,612.39	4.55
7	合计	1,391,469,115.67	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	0.00	0.00
B	采掘业	59,828,286.38	4.32
C	制造业	576,300,202.13	41.59
CD	食品、饮料	0.00	0.00
CI	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	12,585,350.00	0.91
C3	造纸、印刷	13,913,120.00	1.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	84,860,625.15	6.13
C5	电子	4,198,617.57	0.30
O6	金属、非金属	69,184,574.57	4.99
C7	机械、设备、仪表	315,922,161.92	22.80
C8	医药、生物制品	72,030,751.39	5.20
C99	其他制造业	3,605,000.00	0.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	35,699,131.30	2.58
E	建筑业	9,210,796.78	0.66
F	交通运输、仓储业	25,524,072.03	1.84
G	信息技术业	49,516,316.22	3.50
H	批发和零售贸易	0.00	0.00
I	金融、保险业	91,267,283.60	6.59
J	房地产业	66,877,046.90	4.83
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化业	45,183,816.89	3.26
M	综合类	0.00	0.00
	合计	948,645,131.17	68.47

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	601766	中国南车	13,800,000	59,478,000.00	4.29
2	000024	招商地产	3,828,551	50,230,589.12	3.63
3	002202	金风科技	1,794,908	45,321,427.00	3.27
4	600875	东方电气	1,486,346	44,307,974.26	3.20
5	601166	兴业银行	2,813,400	41,075,640.00	2.96
6	000898	鞍钢股份	5,347,687	37,166,424.65	2.68
7	601009	南京银行	4,390,511	36,834,709.29	2.66
8	600161	天坛生物	2,481,052	36,024,875.04	2.60
9	000650	仁和药业	4,312,081	36,005,876.35	2.60
10	002267	顺天燃气	2,999,927	35,699,131.30	2.58

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	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-	-
2	央行票据	-	78,580,000.00	5.67
3	金融债券	-	-	-
	其中:政策性金融债	-	-	-
4	企业债券	-	20,180,000.00	1.46
5	企业短期融资券	-	-	-
6	可转债	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	98,760,000.00	7.13

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	0801106	08 央行 106	500,000	49,055,000.00	3.54
2	080855	08 南钢 55	200,000	20,180,000.00	1.46
3	0801112	08 央行 112	200,000	19,678,000.00	1.42
4	0801114	08 央行 114	100,000	9,847,000.00	0.71
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权证投资明细  
本基金本报告期末未有权证。  
8. 投资组合报告附注  
1 本基金本报告期的前十名证券中,无报告期内发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。  
2 本基金本报告期的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。  
3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	3,271,693.66
2	应收证券清算款	59,063,863.70
3	应收股利	-
4	应收利息	943,879.11
5	应收申购款	39,175.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,318,612.39

4 本基金持有处于转股期的债券明细:  
本基金本报告期末未有可转债。  
5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末未有流通受限股票。  
6 开放式基金份额变动:

阶段	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	超额收益率
同期业绩比较基准收益率	115.07%	128.21%	-58.82%
超额收益率	97.47%	4.86%	0.72%
净值增长率标准差	1.53%	2.03%	2.18%
同期业绩比较基准收益率标准差	1.19%	1.95%	2.58%
收益率标准差之差	0.34%	0.08%	0.16%