

**(上接B42版)**

120) 公司名称: 国联时代基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区金融大街9号5层504室  
法定代表人: 佟志广  
联系人: 佟志广  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

121) 公司名称: 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195号2楼E座  
法定代表人: 李自杰  
联系人: 李自杰  
联系电话: 021-54509988  
公司网址: www.1234567.com

122) 公司名称: 北京汇成基金销售有限公司  
注册地址: 北京市海淀区中关村大街100号10层1008号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-56250686  
公司网址: www.hcfc.com

123) 公司名称: 北京恒信基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区宣武门外大街1号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

124) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

125) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

126) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

127) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

128) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

129) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

130) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

131) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

132) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

133) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

134) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

135) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

136) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

137) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

注册地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809  
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809  
法定代表人: 佟志广  
联系人: 佟志广  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

138) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

139) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

140) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

141) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

142) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

143) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

144) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

145) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

146) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

147) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

148) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

149) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

150) 公司名称: 北京中民基金销售有限公司  
注册地址: 北京市西城区广安门内大街2号10层1002号  
法定代表人: 李伟  
联系人: 李伟  
联系电话: 010-59392923  
公司网址: www.guolian.com

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	000066	宇通客车	8,251,620	184,258,674.60	3.95
2	000729	燕京啤酒	19,395,099	154,966,841.01	3.32
3	000002	万科A	10,000,000	139,000,000.00	2.98
4	002132	广电运通	6,546,966	136,176,992.80	2.92
5	002299	圣农发展	6,580,483	132,800,730.45	2.85
6	600138	顺络电子	7,000,000	125,510,000.00	2.69
7	002572	索菲亚	5,890,168	124,123,595.20	2.68
8	000848	承德露露	5,256,907	115,599,384.93	2.48
9	600805	信达地产	9,699,660	109,605,480.00	2.35
10	600016	民生银行	9,827,283	106,920,947.84	2.29

4. 报告期末按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	1,138,521,000.00	24.40
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	1,138,521,000.00	24.40
6	中期票据	-	-
7	可转债	41,611,399.96	8.88
8	其他	-	-
9	合计	1,553,132,399.96	33.28

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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113901	中行转债	2,600,000	407,134,000.00	8.72
2	140443	14鲁快4	1,800,000	180,252,000.00	3.86
3	140022	14附债02	1,500,000	159,810,000.00	3.42
4	140223	14附债23	1,500,000	150,195,000.00	3.22
5	140014	14附债04	1,500,000	150,000,000.00	3.21

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

本基金报告期内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

本基金报告期内未持有贵金属。

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股指期货投资明细

本基金报告期内未持有股指期货。

9. 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

本基金报告期内未持有权证。

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金报告期内未持有股指期货。

(2) 本基金报告期内未进行股指期货交易。

(3) 本基金报告期内未持有股指期货。

11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金报告期内未持有国债期货。

(2) 本基金报告期内未进行国债期货交易。

(3) 本基金报告期内未持有国债期货。

12. 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没有被监管部门立案调查,或在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受到公开谴责和处罚。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券未出现被监管部门立案调查的债券投资。

(3) 报告期内本基金未持有资产支持证券。

13. 投资组合报告附注

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,056,585.83
2	应收证券清算款	6,945,605.15
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	33,110,395.70
6	其他应收款	620,302.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,732,889.17

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113901	中行转债	407,134,000.00	8.72

(5) 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

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	002132	广电运通	136,176,992.80	2.92	重大事项

本基金管理人报告期内,采用买入、卖出、赎回等交易策略进行基金投资,但不保证最低收益,也不保证基金资产净值,基金业绩并不表示未来表现,投资者有风险,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。基金业绩数据截至2014年12月31日。

1. 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金管理人报告期内,采用买入、卖出、赎回等交易策略进行基金投资,但不保证最低收益,也不保证基金资产净值,基金业绩并不表示未来表现,投资者有风险,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。基金业绩数据截至2014年12月31日。

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	21,670,730.45	4.54
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,603,693,694.19	34.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	35,804,761.30	0.77
F	批发和零售业	278,366,334.79	5.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	148,498,163.20	3.18
J	金融业	229,982,171.34	4.93
K	房地产业	198,791,087.20	4.26
L	租赁和商务服务业	23,929,338.76	0.51
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	教育、文体和休闲业	-	-
P	医药制造业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	109,605,480.00	2.35
	合计	2,840,239,758.23	60.86

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	000066	宇通客车	8,251,620	184,258,674.60	3.95
2	000729	燕京啤酒	19,395,099	154,966,841.01	3.32
3	000002	万科A	10,000,000	139,000,000.00	2.98
4	002132	广电运通	6,546,966	136,176,992.80	2.92
5	002299	圣农发展	6,580,483	132,800,730.45	2.85
6	600138	顺络电子	7,000,000	125,510,000.00	2.69
7	002572	索菲亚	5,890,168	124,123,595.20	2.68
8	000848	承德露露	5,256,907	115,599,384.93	2.48
9	600805	信达地产	9,699,660	109,605,480.00	2.35
10	600016	民生银行	9,827,283	106,920,947.84	2.29

4. 报告期末按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	1,138,521,000.00	24.40
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	1,138,521,000.00	24.40
6	中期票据	-	-
7	可转债	41,611,399.96	8.88
8	其他	-	-
9	合计	1,553,132,399.96	33.28

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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113901	中行转债	2,600,000	407,134,000.00	8.72
2	140443	14鲁快4	1,800,000	180,252,000.00	3.86
3	140022	14附债02	1,500,000	159,810,000.00	3.42
4	140223	14附债23	1,500,000	150,195,000.00	3.22
5	140014	14附债04	1,500,000	150,000,000.00	3.21

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

本基金报告期内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

本基金报告期内未持有贵金属。

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股指期货投资明细

本基金报告期内未持有股指期货。

9. 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

本基金报告期内未持有权证。

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金报告期内未持有股指期货。

(2) 本基金报告期内未进行股指期货交易。

(3) 本基金报告期内未持有股指期货。

11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金报告期内未持有国债期货。

(2) 本基金报告期内未进行国债期货交易。

(3) 本基金报告期内未持有国债期货。

12. 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没有被监管部门立案调查,或在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受到公开谴责和处罚。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券未出现被监管部门立案调查的债券投资。

(3) 报告期内本基金未持有资产支持证券。

13. 投资组合报告附注

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,056,585.83
2	应收证券清算款	6,945,605.15
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	33,110,395.70
6	其他应收款	620,302.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,732,889.17

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113901	中行转债	407,134,000.00	8.72

(5) 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

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	002132	广电运通	136,176,992.80	2.92	重大事项

本基金管理人报告期内,采用买入、卖出、赎回等交易策略进行基金投资,但不保证最低收益,也不保证基金资产净值,基金业绩并不表示未来表现,投资者有风险,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。基金业绩数据截至2014年12月31日。

1. 本报告期基金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(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
2014.2.26-2014.12.31	-0.51%	0.64%	-4.73%	0.87%	4.22%	-0.23%
2013.1-2013.12.31	16.93%	0.97%	-0.82%	0.80%	17.75%	0.13%
2012.1-2012.12.31	124.39%	1.07%	80.53%	0.92%	43.84%	0.15%
2011.1-2011.12.31	126.97%	1.80%	104.75%	1.54%	22.22%	0.26%
2010.1-2010.12.31	-51.68%	2.16%	-38.81%	1.94%	-12.87%	0.22%
2009.1-2009.12.31	68.90%	1.80%	62.08%	1.32%	6.82%	0.48%
2008.1-2008.12.31	6.58%	1.36%	-6.24%	1.01%	12.82%	0.35%
2011.1-2011.12.31	-21.21%	0.90%	-15.13%	0.85%	-6.08%	0.05%
2012.1-2012.12.31	5.70%	0.97%	5.86%	0.81%	-0.16%	-0.02%
2013.1-2013.12.31	12.63%	1.02%	-3.20%	0.89%	15.83%	0.13%
2014.1-2014.12.31	0.09%	0.85%	33.93%	0.77%	-33.84%	0.08%
自基金合同生效至今	383.84%	1.34%	171.93%	1.14%	211.91%	0.20%

2. 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金净值增长率与业绩比较基准收益率对比走势图

截至2014年12月31日