



信息披露 Disclosure

2015年5月28日 星期二
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B71

(上接B70版)

67 上海证券有限责任公司
客户服务电话:(021) 83586554
网址:www.sse.com.cn

68 东北证券股份有限公司
注册地:吉林省长春市自由大路1138号
办公地:吉林省长春市自由大路1138号东北证券大厦
法定代表人:杨国财
电话:(0431) 85396709
传真:(0431) 85396795
客户服务电话:400600686
网址:www.nesc.cn

69 上海证券有限责任公司
注册地:上海市黄浦区西藏中路336号
办公地:上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
电话:(021) 53519888
传真:(021) 53519888
客户服务电话:4008918181
网址:www.shzq.com

61) 新时代证券股份有限公司
注册地:北京市朝阳区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地:北京市朝阳区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层
法定代表人:刘汝军
电话:(010) 83561149
传真:(010) 83561094
客户服务电话:400-088-9898
网址:www.xsdq.com

62) 国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市金融一街8号
办公地:无锡市太湖新城金融一街8号 国联金融大厦7-9楼
法定代表人:袁颖勇
电话:(0510) 82831662
传真:(0510) 82830162
客户服务电话:(0510) 82881868
网址:www.glsc.com.cn

63) 浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市上塘路1号
办公地:浙江省杭州市上塘路1号黄龙世纪广场6楼67楼
法定代表人:吴承根
电话:(0571) 87901063
传真:(0571) 87901913
客户服务电话:96777
网址:www.stocke.com.cn

64) 平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路荣超大厦4036号16-20
办公地:深圳市福田区金田路荣超大厦4036号16-20
法定代表人:谢永林
电话:400886338
电话:(0755) 82480682
客户服务电话:95511-8
网址:stock.pingan.com

65) 华泰证券股份有限公司
注册地:合肥政务文化新区天鹅湖198号
办公地:合肥政务文化新区天鹅湖198号
法定代表人:李圣
电话:(0551) 5161660
传真:(0551) 5161600
客户服务电话:96518
网址:www.htsc.com.cn

66) 国都证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路5号
办公地:广州天河区珠江西路5号
法定代表人:何伟
电话:(0755) 55392062
传真:(0755) 55390033
客户服务电话:全国:400-8888-1001; (0755) 55393002
网址:www.gdsc.com.cn

67) 招商证券股份有限公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
办公地:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、28层
法定代表人:蔺宾
电话:(0731) 4403343
传真:(0731) 4403349
客户服务电话:4008855316
网址:www.zq.com.cn

68) 东莞证券有限责任公司
注册地:广东省东莞市莞城区可园南路1号
办公地:广东省东莞市莞城区可园南路1号金融中心30楼
法定代表人:张运勇
电话:(0769) 22319351
传真:(0769) 22319423
客户服务电话:(0769) 961130
网址:www.djqz.com.cn

69) 中原证券股份有限公司
注册地:郑州市郑东新区商务外环10号
办公地:河南省郑州市郑东新区商务外环10号
法定代表人:管欣
电话:(0371) 65586670
传真:(0371) 65586655
客户服务电话:(0371) 967218
网址:www.ccsc.com.cn

70) 国盛证券有限责任公司
注册地:北京市东城区永定门内大街5号国华投资大厦9层、10层
办公地:北京市东城区永定门内大街5号国华投资大厦9层、10层
法定代表人:常晓
电话:(010) 84183389
传真:(010) 64482900
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.gsstock.com

71) 华安证券股份有限公司
注册地:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼
办公地:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼
法定代表人:朱科敏
电话:(021) 50586600-8636
传真:(021) 50586600-9611
客户服务电话:400885888
网址:www.haonq.com.cn

72) 中国国际证券股份有限公司
地址:中国上海浦东新区世纪大道200号中银大厦39F
办公地:中国上海浦东新区世纪大道200号中银大厦39、40、41层
法定代表人:徐刚
电话:(021) 68604866
传真:(021) 58883554
客户服务电话:4008208888
网址:www.cibc.com.cn

73) 华泰证券股份有限公司
注册地:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:陈奇
电话:(0471) 4931398
传真:(0471) 4930707
客户服务电话:(0471) 4961259
网址:www.cnht.com.cn

74) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市北京路98号信国国际金融中心A座
办公地:广东省深圳市南山区海德三道8033号信国国际金融中心A座
法定代表人:何江
电话:(0755) 16768077
传真:(0755) 16768995
客服电话:4008220115
网址:www.guotsc.com

75) 宏源证券股份有限公司
注册地:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
法定代表人:冯鹤
联系电话:(010) 58885858
传真号码:(010) 58883888
客服电话:(0991) 400-830-0562
公司网站:www.hysec.com

76) 齐鲁证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
办公地:山东济南经七路86号
法定代表人:李玮
电话:(0531) 68879752
客户服务电话:95538
网址:www.zq.com.cn

77) 世纪证券有限责任公司
注册地:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
办公地:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人:袁颖军
电话:(0755) 83199545
传真:(0755) 83199545
客户服务电话:400 832 3000
公司网站:www.secc.com.cn

78) 第一创业证券股份有限公司
注册地:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地:广东深圳福田区皇岗国际创新园12号中银大厦25、26号
法定代表人:刘学民
电话:(0755) 25832383
传真:(0755) 25831718
客户服务电话:4008818888
网址:www.fcsc.com.cn

79) 中航证券有限公司
注册地:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融中心A座41层
办公地:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A座41层
法定代表人:王登波
电话:(0791) 6768763
传真:(0791) 67689414
客户服务电话:400866567
网址:www.avicsc.com

80) 德邦证券有限责任公司
注册地:上海市曹杨路510号南幢9楼
办公地:上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”2楼
法定代表人:姚文平
电话:(021) 68761616
传真:(021) 68767981
客户服务电话:400888128
网址:www.tebon.com.cn

81) 国都证券股份有限公司
注册地:西安东大街223号信达大厦16-17层
办公地:西安东大街223号信达大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:(029) 86746772
客户服务电话:95582
网址:www.westsec.com.cn

82) 华融证券股份有限公司
注册地:福州市鼓楼区温泉路五四路157号7-8层
办公地:福州市鼓楼区温泉路五四路157号7-8层
法定代表人:黄建雄
电话:(0591) 88738323
传真:(0591) 88738340
客户服务电话:(0591) 96326
网址:www.hfsc.com.cn

83) 华龙证券股份有限公司
注册地: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: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:李勇安
电话:(0931) 4809110
传真:(0931) 4809118
客户服务电话:(0931) 4809619
网址:www.hlzq.com

84) 中国银河证券股份有限公司
注册地:北京市西城区金融大街19号10层国贸大厦2层27层及28层
办公地:北京市西城区金融大街19号10层国贸大厦2层26、27层及28层
法定代表人:李丁东
电话:(010) 65951166
传真:(010) 65951566
客户服务电话:(010) 65951666
网址:www.chinacc.com.cn

85) 瑞银证券有限责任公司
注册地:北京西城区金融大街7号美国国际金融中心12层、15层
办公地:北京西城区金融大街7号美国国际金融中心12层、15层
法定代表人:程立涛
电话:(010) 59226789
传真:(010) 59226799
客户服务电话:400-887-8827

注册地:www.abscurities.com
(86) 中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
办公地:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
法定代表人:龙登杰
电话:(0755) 82032442
传真:(0755) 82056339
客户服务电话:4006-008-008
网站:http://www.citic.com

(87) 中山证券有限责任公司
注册地:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:凌宇辉
电话:(0755) 82945755
传真:(0755) 82945111
客户服务电话:4001022011
网址:www.zsc.com.cn

(88) 红塔证券股份有限公司
注册地:云南省昆明市北京路155号附1号
办公地:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦-11楼
法定代表人:史伟林
电话:(0871) 3579718
传真:(0871) 3579827
客户服务电话:(0871) 36579730
网址:www.hongtaq.com

(89) 日信证券有限责任公司
注册地:云南省昆明市东郊路318号
办公地:内家古祥和浩特市锡林南路18号
法定代表人:尹启杰
电话:(0471) 6292587
传真:(0471) 6292477
网址:www.rxcc.com.cn

(90) 江海证券有限公司
注册地:黑龙江哈尔滨香坊区永顺街56号
办公地:黑龙江哈尔滨香坊区永顺街56号
法定代表人:闫名扬
电话:(0451) 82338863
传真:(0451) 82827211
客户服务电话:40066-62288
网址:www.jhzq.com.cn

(91) 国金证券股份有限公司
注册地:成都市东城根上街95号
办公地:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:(028) 36660125
传真:(028) 36660126
客户服务电话:4006-600109
网址:www.gqz.com.cn

(92) 华宝证券有限责任公司
注册地:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人:陈琳
电话:(021) 36223778
传真:(021) 400820898
网址:www.cnhbstock.com

(93) 厦门证券有限公司
注册地:厦门市湖滨西路2号海虹大厦十七楼
办公地:厦门市湖滨西路2号海虹大厦十七楼
法定代表人:李毅强
电话:(0592) 5161642
传真:(0592) 5161140
客户服务电话:(0592) 5163388
网址:www.xmzq.com.cn

(94) 爱建证券有限责任公司
注册地:上海市世纪大道1600号32楼
办公地:上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人:钱华
电话:(021) 33222888
传真:(021) 62887071
客户服务电话:4001962952
网址:www.ajsc.com.cn

(95) 英大证券有限责任公司
注册地:深圳市福田区深南中路华能大厦二十三、三十一、三十二、三十三层
办公地:深圳市福田区深南中路华能大厦十一、二十一、二十九、三十一、三十二层
法定代表人:吴骏
电话:(0755) 83007041 / 83007166
传真:(0755) 83007034
客户服务电话:(0755) 26028993
网址:www.yksc.com.cn

(96) 华融证券股份有限公司
注册地:北京市西城区金融大街8号
办公地:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝艳松
电话:(010) 58568007
传真:(010) 58560962
客户服务电话:58688118
网址:www.hrsc.com.cn

(97) 财达证券股份有限公司
注册地:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
办公地:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
法定代表人:魏建刚
电话:(0311) 86028442
传真:(0311) 66002434
客户服务电话:4004128888
网址:www.cada.com.cn

(98) 天风证券股份有限公司
注册地:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地:武汉市武昌区中南路99号武汉保利A座37楼
法定代表人:余磊
电话:(027) 87618889
传真:(027) 87618863
客户服务电话:(028) 86712334
网址:www.tfzq.com

(99) 中天证券有限责任公司
注册地:沈阳市和平区光荣街23号甲
办公地:沈阳市和平区光荣街23号甲
法定代表人:马勇
电话:(024) 23260917
传真:(024) 23256666
客户服务电话:4006180315
网址:www.ztkren.com

(100) 大通证券股份有限公司
注册地:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座11-13层
办公地:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座11-13层
法定代表人:李德松
电话:(0411) 39673219
传真:(0411) 39673219
客户服务电话:4008-1008-169
网址:www.dntsc.com.cn

(101) 上海华信证券有限责任公司
注册地:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
办公地:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
法定代表人:杨智敏
电话:(021) 68784818
传真:(021) 68778278
客户服务电话:(021) 38748418
公司网站:http://www.shhxzq.com

(102) 上海邦创投资管理有限公司
注册地:上海市虹口区四川路688弄37号4楼409室
办公地:上海市虹口区四川路688弄37号4楼409室
法定代表人:董文斌
电话:(021) 28150000
传真:(021) 28150000

(103) 上海天富投资管理咨询有限公司
注册地:上海市虹口区四川路688弄37号4楼409室
办公地:上海市虹口区四川路688弄37号4楼409室
法定代表人:董文斌
电话:400-700-9665
传真:(021) 6859169167
网址:www.tbhwhy.com

(104) 上海天富投资管理咨询有限公司
注册地:上海市浦东新区世纪大道610号610室
办公地:上海市虹口区四川路688弄37号4楼409室
法定代表人:董文斌
电话:(021) 28150000
传真:(021) 28150000
客户服务电话:(021) 38748418
公司网站:http://www.shhxzq.com

(105) 上海天富投资管理咨询有限公司
注册地:上海市虹口区四川路688弄37号4楼409室
办公地:上海市虹口区四川路688弄37号4楼409室
法定代表人:董文斌
电话:(021) 28150000
传真:(021) 28150000
客户服务电话:(021) 38748418
公司网站:http://www.shhxzq.com

法定代表人:罗安敏
客服电话:400-001-8811
公司网站:http://www.zxcw.com.cn
(116) 太平洋证券股份有限公司
注册地:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
法定代表人:李长伟
客服电话:(0871) 46898130
公司网站:http://www.tpy.com.cn
(117) 瑞泰证券有限责任公司
注册地:杭州中二路15号嘉华国际商务中心
办公地:杭州中二路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈晓宇
客服电话:(0571) 963636
网址:www.rtcsc.com

(118) 中期资产管理有限公司
注册地:北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
办公地:北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
法定代表人:路彬
电话:(010) 59539718、59539728
传真:(010) 68807110
客服电话:95102400888160
网址:www.cifund.com

(二) 注册登记机构
名称:华安基金管理有限公司
住所:上海浦东新区世纪大道8号,上海国金二期三1、32层
法定代表人:李军华
电话:(021) 38869999
传真:(021) 33827962
联系人:赵良
客户服务中心电话:40088-50099
(三) 律师事务所和会计师事务所
律师事务所:通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:李娟
电话:(021) 31258666
传真:(021) 31258600
经办律师:秦悦民、王利民
(四) 会计师事务所和基金托管人
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地:上海浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
首席合伙人:杨劲松
联系人:朱建芳
电话:(021) 23228800
传真:(021) 23228800
联系人:魏娟
经办会计师:汪明、魏伟

四. 基金的名称
五. 基金的类型
六. 基金的投资目标
在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过增强信用产品的投资,以获取资产的长期增值。
七. 基金的投资方向
本基金为债券型基金,投资范围包括固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券、次级债、债券回购等,以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许本基金投资的其他金融工具。
本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%,其中,金融债、企业(公司)债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券除国债和央行票据以外的信用等级固定收益资产投资比例范围不低于基金资产净值60%;持有期限在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,本基金也可投资于中国证监会认定的优质上市公司股票;
本基金投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的20%。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
八. 基金的投资策略
本基金通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和判断,并利用公司研究开发的各种数量模型,分析和比较不同证券市场和不同金融工具的收益及风险特征,积极寻找各种不同的套利和增值增长机会,以确定固定收益资产在信用债固定收益品种(国债、央行票据等)、信用类固定收益品种、新股申购、二级市场股票之间的资产配置。
(一) 久期管理策略
通过对宏观经济变化和宏观经济政策进行分析,预测未来利率走势的变化,结合基金未来现金流,确定投资组合久期,长期、中期、短期利率债配置,久期,可以通过调整目标久期规避利率风险,预期未来利率下降,则延长目标久期获取债券价格上涨的超额收益。
(二) 资产配置策略
在目标久期确定的基础上,通过对市场收益率曲线形状变化的合理预期,调整组合期限结构(主要包括子弹式策略、波段策略和哑铃型),在短期、中期、长期债券间进行配置,从短、中、长期债券品种中选择价值相对低估的品种,进行配置,此外,子弹式策略是使投资组合中债券的到期期限集中于收益率曲线的一点,长期策略则将组合中债券的到期期限集中于期限两端,而波段策略则根据债券到期期限进行均匀分布。
(三) 相对价值策略
相对价值策略包括国债期货与金融债之间的信用利差、交易所与银行间市场利差等,如果预期利差将缩小,可以卖出收益较低国债期货或通过买入即将发生交割收益较低的债券,买入收益率较高的债券,反之亦然。
(四) 策略策略
通过对收益曲线和债券期限结构的分析,买入收益率曲线底部所处的期限债券,持有一段时间后,随着债券到期期限的缩短,到期收益率将迅速下降,基金可获得较高的资本利得收入。
(五) 固定收益策略
本基金通过对宏观经济运行周期的研究,综合分析公司债、企业债、短期融资券等发行人所处行业的发展和状况、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素,结合具体发行契约,对债券进行内部信用评级,将外部评级与内部信用评级相结合,确定不同等级的债券,进行债券的筛选,并剔除高风险债券。
(六) 可转换债券投资策略
可转换债券兼具债券、股票和期权的相关特性,结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益稳定的优势,并有利于从发行主体整体信用上分散利率风险和降低收益水平。本基金将重点从可转换债券的内在债券价值(如票面利率、利息补偿及赎回价格)、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础债券的质地和成长性、基础债券的流动性等方面进行研究,在公司自行开发的可转债定价分析系统的支持下,充分发掘投资价值,并积极寻找各种套利机会,以获取较高的投资收益。
(七) 新股申购策略
本基金关注新股发行、新股申购的各个环节,结合对发行主体的基本面分析,选择估值合理的品种进行投资,以期获得超额投资收益。
(八) 新股申购策略
参照目前国内其他基金品种的投资收益,我们认为参与新股投资将是低风险、高收益的投资品种之一,本基金作为跟踪收益类产品,将在充分依公司研究平台和股票估值体系,深入发掘新股内在价值的前提下,积极参与新股的申购。
(九) 二级市场投资策略
本基金可适度参与股票二级市场投资,增强基金资产收益。本基金股票投资部分将重点投资于具有持续分红特征的股票,该类股票一般是具有良好稳定的分红记录和意愿、持续稳定的盈利和分红能力的上市公司。
本基金采取“自上而下”的方法选择个股,通过过去两年业绩表现和分红现金流收益率(税后)均大于下的上市公司形成备选池,在此基础上,对输入备选池的股票,本基金将综合考虑上市公司所处行业的产业周期、企业发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本特征,同时结合用市盈率(P/E)、市净率(P/B)和折现现金流(DCF)等方法对上市公司的投资价值进行分析,并综合考虑中长期持续成长性高,且股票估值水平合理的上市公司来构建本基金的核心股票库。
(十) 权证投资策略
本基金在权证选择上,重点关注具有因持在股票期票混发或因参与可分离债券一级市场申购而产生的权证,本基金管理人将以定价分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可能持有的权证流动性、流动性及风险收益特征,避免投资风险,追求较高投资收益。
(十一) 其他衍生工具投资策略
本基金将根据市场利率和利率衍生产品的流动性,一旦有新的产品推出,将在符合相关法律法规的前提下,制订符合本基金投资目标的策略,同时结合衍生品工具的研究,在充分考量衍生品市场风险收益特征的前提下,谨慎进行投资。

九. 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%
中国债券综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券市场,其样本范围覆盖国债市场和交易所市场,样本包括国债、企业债、央行票据、金融债、短期融资券、企业债、公司债券等所有主要债券品种,具有广泛的代表性,能够反映我国市场总体走势,适合作为本基金债券投资部分的业绩比较基准。
中证红利指数是由中证指数有限公司编制,挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市中的现金股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的100只股票为样本,以反映沪深市场高股息率股票的整体状况和走势,适合作为本基金股票投资部分的业绩比较基准。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、能更为市场普遍接受的业绩比较基准出现,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指标,本基金可以与基金托管人协商,一致后将中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
十. 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,基金风险与预期收益要低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益品种。
十一. 基金投资组合报告
1. 重要提示
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保证责任。
本基金合同约定的基金投资组合比例,已于2015年4月16日复核了本报告中的投资组合比例、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、误导性陈述或重大遗漏。
2. 基金投资组合报告
2.1 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	26,296,180.00	14.96
	其中:股票	26,296,180.00	14.96
2	固定收益投资	136,144,993.64	77.47
	其中:债券	136,144,993.64	77.47
	资产支持证券	-	-
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:买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和备付金合计	10,307,569.07	5.87
7	其他资产	2,989,137.48	1.70
8	合计	175,737,880.19	100.00

2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,510,100.00	3.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,287,500.00	1.46
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	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	7,010,180.00	4.47
J	金融业	6,737,400.00	4.30
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,883,800.00	2.48
M	科学研究和技术服务业	867,200.00	0.55
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	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,296,180.00	16.79

2.3 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	002410	广联达	89,000	3,693,500.00	2.36
2	601166	兴业银行	150,000	2,754,000.00	1.76
3	002375	亚夏股份	75,000	2,287,500.00	1.46
4	002405	国创高新	55,000	2,244,000.00	1.43
5	300058	蓝色光标	60,000	2,187,000.00	1.40
6	002152	广电运通	50,000	1,988,500.00	1.25
7	000712	豫龙投资	40,000	1,583,200.00	1.01
8	601688	华泰证券	50,000	1,505,500.00	0.96
9	600388	龙净环保	38,000	1,464,900.00	0.94
10	600415	小商品城	50,000	1,287,000.00	0.82

2.4 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(%)
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。		
四、基金托管人	更新了基金托管人相关信息。		
五、相关服务机构	对相关服务机构进行了更新。		
九、基金的投资	更新了最近一期基金投资报告。		
十、基金的业绩	对基金净值按以业绩进行了更新。		
二十一、对基金投资的服务	1、7-6,新增W4服务,更新表格; 2、7-7,新增W4服务,更新表格; 3、更新对账单模板,增加及投资服务的内容,更新电子对账单的支持银行及支持币种,详见招募说明书。		
二十二、其他应披露事项	披露了[2014年10月13日至2015年4月13日期间]本基金的公告信息。		

2.5 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	110028	冠福转债	85,000	13,787,850.00	8.80
2	115901	清研转债	75,000	12,785,030.00	8.16
3	110029	鼎信转债	91,610	12,769,517.90	8.15
4	140223	14国债13	100,000	10,010,000.00	6.39
5	110023	民生转债	72,070	9,893,048.00	6.31

2.6 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持有资产支持证券。
2.7 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
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
2.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告没有股指期货持仓。
2.9.2 本基金股指期货持仓的投资收益
2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
2.10.1 本基金投资国债期货的投资政策
2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告没有投资国债期货。
2.10.3 本基金投资国债期货的投资价值
2.11 投资组合报告附注
2.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。
2.11.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,477.58
2	应收证券清算款	18,953.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,905,541.56
5	应收申购款	1,020,164.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,989,137.48

2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细