（上接B62版）

办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：肖云
联系人：刘晓菊
联系电话：028-86690057
传真：028-86690126
客服电话：4006600109
网址：www.jyzq.cn
67.财富证券有限责任公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：张一兵
联系人：梁霞
客服电话：0731－84403333 400-88-35316（全国）
公司网站：www.ctzq.com
68.恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层
法定代表人：庞少民
联系人：魏巍
联系电话：0471-3953168
网址：www.cnht.com.cn
69.华龙证券股份有限公司
注册地址：兰州市城关区张掖路638号财富大厦
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼
法定代表人：李晓安
联系人：刘鹏程
电话：0931-4890208
传真：0931-4890628
客服电话：4006-89-8888、0931-96668
网址：www.hlzqgs.com
70.华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：俞洋
联系人：陈毓
电话：021-64339000
传真：0755-54633529
客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918
网址：www.cfsc.com.cn
71.日信证券有限责任公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层
法定代表人：石东杰
联系人：陈文郁
联系电话：010-83991716
公司网站：www.rxzq.com.cn
72.中天证券有限责任公司
注册地址：沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址：沈阳市和平区南五马路121号万丽城品座4楼中天证券经纪事业部
法定代表人：马功勋
联系人：王万华
联系电话：024-23280810
客服电话：4006180315
公司网站：www.stock.crm.com
73.大通证券股份有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座一大连期货大厦38、39层
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：李红光
联系人：谢立平
电话：0411-39991807
传真：0411-39673219
客服电话：4008-169-169
网址：www.dastn.com.cn
74.天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人：林义相
联系人：尹沙
电话：010-66045678
传真：010-66045518
公司网址：http://www.txsec.com
基金销售网址：www.jjm.com.cn
75.联讯证券股份有限公司
注册地址：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
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
法定代表人：徐刚
联系人：梁晓
客服电话：0752-2119391
传真：0752-2119369
客服电话：95564
网址：www.lxzq.com.cn
76.东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：魏庆华
联系人：汤瀚川
电话：010-66555316
传真：010-66555133
客服电话：4008888993
网址：www.dxzq.net
77.开源证券股份有限公司
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
联系人：付瑞
电话：029-81887063
传真：029-88447611
客服电话：400-860-8866
网址：http://www.kyzq.com
78.中银证券有限责任公司
注册地址：陕西省西安市唐延路5号陕西邮政信息大厦9~11层
办公地址：陕西省西安市唐延路5号陕西邮政信息大厦9~11层
法定代表人：黄海涛
联系人：马国强
电话：029-88602138
传真：029-88602135
客服电话：4008888005
网址：www.cnpsec.com
79.中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F
法定代表人：赵大建
联系人：李霄
电话：010-59355941
传真：010-56437030
客服电话：4008895618
网址：www.e5618.com
80.太平洋证券股份有限公司
注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元
法定代表人：李长伟
联系人：谢兰
电话：010-88321613
传真：010-88321763
客服电话：400-665-0999
网址：www.tpyzq.com
81.宏信证券有限责任公司
注册地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人：刘晓亚
联系人：邹晓杰
电话：028-86199278
传真：028-86199382
客服电话：4008366366
网址：www.hxzq.cn
82.诚信证券有限责任公司
注册地址：沈阳市沈河区热闹路49号
办公地址：沈阳市沈河区热闹路49号恒信大厦C座
法定代表人：高平
联系人：付刚
电话：024-22955400
传真：024-22955449
客服电话：024-22955438
网址：www.chtsck.com
83.诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360号3724室
办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12F
法定代表人：庄静波
联系人：徐诚
电话：021-38509639
传真：021-38509777
客服电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
84.深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区笋岗路305号投资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区笋岗路305号投资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客服电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
85.上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区川杨河路396号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鸿京多媒国际大厦903～906室；上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
电话：021-20613999
传真：021-68596916
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com
86.杭州数文基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：徐欣雅
电话：021-60897840
传真：0571-26697013
客服电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn/
87.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：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：单丙烨
电话：021-20691832
传真：021-20691861
客服电话：400-089-1289
网址：www.erichfund.com
88.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195号3号楼2层/7楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
电话：021-54509998
传真：021-64385308
客服电话：400-1818188
网址：www.1234567.com.cn
89.北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区空港工业区牛栏山镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：翟飞飞
电话：010-62020088
传真：010-62020355
客服电话：4008886661
网址：www.myfund.com
90.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一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人：凌顺平
联系人：吴杰
电话：0571-88911818-8653
传真：0571-86800423
客服电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com
91.中期资产管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区光华路16号中期大厦2层
法定代表人：朱利林
联系人：侯英建
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客服电话：010-65807669
网址：http://www.cifcofund.com
92.万银财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内
法定代表人：王梁
联系人：张莉
电话：010-53300532
传真：010-59393074
客服电话：400-081-6655
网址：www.wanyefund.com
93.和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：张紫薇
电话：0755-82021122
传真：0755-82029053
客服电话：4009200022
网址：licaike.hexun.com
94.宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街甲6号楼17层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：杨阳
电话：010-52855713
传真：010-85894285
客服电话：4006099200
网址：www.yixinfund.com
95.浦江金英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号金诚集团（锦昌大厦）13楼
法定代表人：陈海勇
联系人：施美男
电话：0571-88337734
传真：0571-88337666
客服电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com
96.泛华普益基金销售有限公司
注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人：于梅琳
联系人：邓鹏
电话：13981713068
传真：028-82000996-805
客服电话：400-8588588
网址：http://www.pyfund.cn
97.盈米财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法定代表人：赵学军
联系人：徐琪
电话：021-20289890
传真：021-20280110
客服电话：400-021-8850
网址：www.harvestwin.cn
98.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：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层
法定代表人：杨魁
联系人：张杰
电话：010-58325388*1588
传真：010-58325282
客服电话：400-166-1188
网址：https://8.jrj.com.cn
99.北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区荣达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号东成中心A座23层
法定代表人：梁凝
联系人：付鹏程
电话：010-56810780
传真：010-57756199
客服电话：400-786-8868-5
网址：www.chtfund.com
100.北京钱袋财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵宏伟
联系人：魏华
电话：010-57418829
传真：010-57569671
客服电话：400-678-5095
网址：www.niuji.net
101.深圳证券基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815房（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405
法定代表人：华建强
联系人：黄益龙
电话：0755-23601676
传真：0755-88603185
客服电话：4008955811
网址：www.ucfund.com
102.深圳前海汇联基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815
办公地址：深圳市南山区软件产业基地4栋B座二楼
法定代表人：万勇
联系人：曹海燕
电话：0755-86722853
传真：0755-86725180
客服电话：0755-86722851
网址：http://www.fhjinfund.com.cn
103.中国国际期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人：王兵
联系人：聂英
电话：010-59539864
传真：010-59539985
客服电话：95162、400-8888-160
网址：www.cifco.net
104.北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区丰盛胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁蓉
联系人：张旭
电话：010-66154828
传真：010-88067526
客服电话：400-6262-818
网址：www.5irich.com
105.海银基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场16楼
法定代表人：刘世谦
联系人：刘惠
电话：021- 80133827
传真：021-80133413
客服电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com
106.上海欧亚资产管理有限公司
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：上海市长宁区金钟路638弄2号B座6楼
法定代表人：燕斌
联系人：汤蕾
电话：021-51507071
传真：021-62990063
客服电话：4000-466-788
网址：http://www.66money.com
107.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号建威大厦1208
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人：罗柳安
联系人：史丽丽
电话：010-67000988-6028
传真：010-67000988-6000
客服电话：010-67000988
网址：www.zcvc.com.cn
108.上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区霜山路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
联系人：赵欣亮
电话：021-50583533
传真：021-50583633
客服电话：4006676266
网址：www.leadfund.com.cn
109.本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告
（二）登记机构
南方基金管理有限公司
住所及办公地址：深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层
法定代表人：吴万善
电话：（0755）82763849
传真：（0755）82763854
联系人：古和鹏
（四）出具法律意见书的律师事务所
广东华商律师事务所
注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室
负责人：李晓明
电话：0755827687860
传真：(0755)82687861
经办律师：杨芸、戴海冬
（五）审计基金财产的会计师事务所
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
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：杨剑信
联系人：陈雅
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办会计师：薛亚、戴海冬
四、基金的名称
南方恒元保本混合型证券投资基金
五、基金的类型
保本混合型证券投资基金
六、基金的投资目标
本基金在严格控制风险的前提下，为投资者提供保本金额的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。
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各类债券、股票以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对债券和股票的投资比例进行动态调整。其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。
本基金可投资于股指期货等金融衍生工具，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，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
本基金采用恒定比例投资组合保险方法（Constant-Proportion Portfolio Insurance，CPPI）来实现保本和增值的目标。恒定比例投资组合保险不仅能从投资组合资产配置的水平上消除投资到期时基金净值低于本金的可能性，而且能在一定程度上使保本基金分享股市整体性上涨的好处。
CPPI是国际通行的一种投资组合保险策略，它主要是通过数量分析，根据市场的波动未调整、基正风险资产的可放大倍数（风险乘数），以确保投资组合在一段时间以后的时点上不低于事先设定的某一目标价值，从而达到对投资组合保值增值的目的。无风险资产一般是指固定收益类资产，风险资产一般是指股票等权益类资产。在基金资产可放大倍数的管理上，基金管理人的金融工程小组在定量分析的基础上，根据CPPI数理机制，历史模拟和目前市场状况定期出具保本基金资产配置建议报告，为出放大倍数的合理上限研究建议，供基金管理人投资决策层会和基金经理作为基金资产配置的参考。
如在本基金存续期内市场出现短期投资期货等新的金融衍生产品且在开放式基金许可的投资范围之内，本基金管理人保留调整保本投资策略的权利。
本基金的投资策略分资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股指期货投资策略等。
1.资产配置策略
本基金资产配置策略分为两个层次：一层为对风险资产和无风险资产的配置，该层次以恒定比例组合保险策略为依据，即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过无风险资产部分所产生的收益；另一层为对风险资产部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略适行调整。
2.股票投资策略
本基金注重对投市趋势的研究，在股票投资限额之下，发挥时机选择能力，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。
本基金依照精健投资、风险第一的原则，以低风险性、在保本期限内具备中期上涨潜力为主要原则，构建股票组合，同时兼顾股票的流动性，首先按照风险性由低至高、中期上涨潜力由大至低和流动性由高到低对股票池内股票进行排名，家加三项排名得到综合排名，根据综合排名靠前的股票构建股票组合，进行组合投资。
本基金通过选择风险低的股票，保证组合的稳定性；通过选择具中期上涨潜力的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、组合投资和流动性管理，降低个股集中性风险和流动性风险。
3.债券投资策略
本基金的债券投资策略主要包括以下几方面：
（1）持有相当数量剩余期限与避险周期相近的国债、金融债，其中一部分严格遵循持有到期原则，首要考虑收益性，另一部分兼顾收益性和流动性。这部分投资可以保证债券组合收益的稳定性，尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。
（2）综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。这部分投资包括中长期的国债、金融债，信用等级为AAA以上的企业债，以及中长期逆回购等等。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期，选择长债为债券资产投资，把握市场上的无风险套利机会，利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性、控制风险等等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。
（3）利用宏观经济、政策、证券市场和交易市场的研究，进行趋势分析，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。
（4）利用某种可能推出的利率远期、利率期货、利率期权等金融衍生工具，有效地规避利率风险。
4.权证投资策略
本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并根极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。
本公司将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择、谨慎进行投资，追求权稳定的当期收益。
5.股指期货投资策略
如在本基金存续期内市场出现股指期货等新的金融衍生产品且在开放式基金许可的投资范围之内，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货，套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。
本基金在进行股指期货时，将通过对股市走势和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。
本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。
九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准：1年期银行定期存款税后收益率。
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基准的指数时，本基金可以在履行相应程序后，变更业绩比较基准并及时公告。
十、基金的风险收益特征
本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。
十一、基金的投资组合报告
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。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日（未经审计）。
（一）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	147,420,341.89	21.80
	其中：股票	147,420,341.89	21.80
2	固定收益投资	483,665,966.60	71.53
	其中：债券	483,665,966.60	71.53
	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：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	24,854,622.29	3.68
7	其他资产	20,191,658.68	2.99
8	合计	676,132,589.46	100.00

（二）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	6,400,892.00	0.98
C	制造业	89,791,728.33	13.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,357,303.00	1.43
E	建筑业	1,765,672.00	0.27
F	批发和零售业	2,900,965.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	732,476.20	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,901,727.36	0.44
J	金融业	22,873,654.00	3.50
K	房地产业	4,630,234.00	0.71
L	租赁和商务服务业	662,048.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	1,861,230.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	851,472.00	0.13
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	675,240.00	0.10
S	综合	2,015,700.00	0.31
	合计	147,420,341.89	22.54

（三）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	601166	兴业银行	474,200	8,706,312.00	1.33
2	600997	开滦股份	931,550	6,958,678.50	1.06
3	000750	国海证券	358,700	6,542,688.00	1.00
4	600887	伊利股份	163,500	5,043,975.00	0.77
5	000937	冀中能源	465,700	4,056,247.00	0.62
6	000858	五粮液	152,300	3,530,314.00	0.54
7	600600	青岛啤酒	73,300	3,118,182.00	0.48
8	600597	光明乳业	144,300	2,862,912.00	0.44
9	300430	诚益通	43,240	2,525,216.00	0.39
10	600383	金地集团	216,600	2,432,418.00	0.37

（四）报告期末投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	29,958,000.00	4.58
	其中：政策性金融债	29,958,000.00	4.58
4	企业债券	343,594,966.60	52.53
5	企业短期融资券	110,113,000.00	16.84
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	483,665,966.60	73.95

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	122051	10石化01	550,820	55,026,918.00	8.41
2	122068	11海螺01	499,680	50,437,699.20	7.71
3	122266	13中信03	460,020	46,296,412.80	7.08
4	122153	12京能01	448,900	44,890,000.00	6.86
5	122280	13海通01	359,320	36,815,927.20	5.63

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
（七）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
注：本基金本报告期末未持有贵金属。
（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。
（九）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注：本基金本报告期内未投资股指期货。
（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注：本基金本报告期内未投资国债期货。
（十一）投资组合报告附注
1.本基金本期投资的前十名证券中没有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公开谴责、处罚的证券。
2.本基金投资的前十名股票中，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（元）
1	存出保证金	331,660.39
2	应收证券清算款	9,982,647.82
3	应收股利	-
4	应收利息	9,877,350.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,191,658.68

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600597	光明乳业	2,862,912.00	0.44	重大事项停牌

十二、基金的投资
基金管理人在履行职责过程中，诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，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。

阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（2）	业绩比较基准收益率（3）	业绩比较基准收益率标准差（4）	（1）-（3）	（2）-（4）
2008.11.12～2008.12.31	1.80%	0.13%	0.52%	0.01%	1.28%	0.12%
2009.1.1～2009.12.31	13.47%	0.84%	3.31%	0.01%	10.16%	0.83%
2010.1.1～2010.12.31	12.28%	0.95%	3.31%	0.01%	8.97%	0.94%
2011.1.1～2011.12.31	-7.97%	0.79%	4.11%	0.01%	-12.08%	0.78%
2012.1.1～2012.12.31	2.80%	0.23%	4.60%	0.01%	-1.80%	0.22%
2013.1.1～2013.12.31	2.34%	0.23%	4.05%	0.01%	-1.71%	0.22%
2014.1.1～2014.12.31	6.18%	0.14%	2.91%	0.01%	3.27%	0.13%
2015.1.1～2015.3.31	9.51%	0.14%	3.73%	0.01%	5.78%	0.13%
自基金成立至今	47.01%	0.16%	38.78%	0.01%	8.23%	0.15%

十三、基金管理概况
（一）与基金运作有关的费用
1.基金管理的种类
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的证券交易费用；
（7）基金的银行汇划费用；
（8）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金在法律允许的前提下，按实际发生费用，按实际发生额从基金财产总值中扣除。
2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H=E×1.3%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
保本期内，保证费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。
（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H=E×2%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类”中第3～7项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
3.不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
（3）《基金合同》生效前的相关费用；
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
4.费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一家指定报刊和网站公告。
5.基金税收
本基金运行过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
（二）与基金销售有关的费用
1.开放基金申购费用采用前端收费模式，本基金申购费率最高不高于1.2%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额（M）	申购费率
M＜100万	1.2%
100万≤M＜500万	0.8%
500万≤M＜1000万	0.4%
M≥1000万	每笔1000元

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
2.开放期保本期内，本持有期期间赎回费率不高于2.0%，随申请份额持有时间增加而递减，其中1年为365天，1.5年为547天）。具体如下表所示：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N＜1.5年	2.0%
1.5年≤N＜3年	1.0%

当期保本期内，持有到期，赎回费率为零。
投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费不入基金财产的比例不得低于25%。
3.本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定报刊和网站公告。
4.基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。基金管理人及其他基金销售机构可以不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金销售费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和规程详见基金管理人或其他基金销售机构网站发布的相关公告或通知。
十四、对招募说明书更新部分的说明
本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2014年12月23日刊登的本基金原招募说明书（《博时灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：
1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
3、在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的内容，各新增代销机构均在指定媒体上公告列示；
4、在“八、基金的投资”中，更新了“（十）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为2015年3月31日；
5、在“九、基金的业绩”中，更新了“自基金合同生效开始基金份额净值增长率”的数据及列表内容，数据内容截止时间为2015年3月31日；
6、在“二十一、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新：
(1)2015年05月07日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时基金管理有限公司关于博时灵活配置混合型证券投资基金的基金经理变更的公告》；
(2)2015年04月21日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时基金管理有限公司关于博时灵活配置混合型证券投资基金调降管理费率并修改基金合同及托管协议的公告》；
(3)2015年04月20日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时灵活配置混合型证券投资基金2015年第1季度报告》；
(4)2015年04月14日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加河北银行有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告》；
(5)2015年04月02日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并参加其网上交易申购业务及定期定额申购业务费率优惠活动的公告》；
(6)2015年04月01日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《20150401关于博时旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告》；
(7)2015年03月30日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参加其网上交易和手机交易申购及定投费率优惠活动的公告》；
(8)2015年03月28日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时灵活配置混合型证券投资基金2014年年度报告（摘要）》；
(9)2015年03月27日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《20150327关于博时旗下部分开放式基金增加苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其网上银行、手机银行和柜面申购及定投