

(上接B42页)

资产管理电话:400-799-8826
客户服务热线:400-1209182
传真:021-2601861
北京分公司:400-820-2099
公司网站:www.oncfund.com
(104) 国融证券
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006B
办公地址:北京市西城区宣武门大街28号富都大厦1层
法定代表人:杨毅
联系人:李强
电话:010-83363099
传真:010-83363010
客户服务热线:400-166-1188
公司网站:www.8j.com.cn
(102) 融讯天下
注册地址:深圳市福田区九洲商务中心3号楼37号303室
办公地址:北京市朝阳区大屯甲19号中C座102层
法定代表人:董强
联系人:徐长征、周超
电话:01088177043/010-58179953
传真:01088177800
客户服务热线:4008188866
公司网站:www.dongshengw.com
(103) 聚源基金
注册地址:杭州市余杭区仓前街道一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼
法定代表人:陈伟强
联系人:韩笑
联系电话:0571-81171794
客户服务热线:4000-766-123
传真:0571-26097113
网站:www.fund123.cn
(104) 天天基金
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190号2号楼2层
法定代表人:其实
联系人:潘文友
联系电话:400-5459996
客户服务热线:400-1818-188
传真:021-34538308
网站:www.1234567.com
(105) 同信证券
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:浙江省杭州市西湖区翠苑四区写字楼2楼212室
法定代表人:周炳强
联系人:李强
联系电话:0571-88911818
客户服务热线:4008-773-772
传真:0571-88909222
网站:www.5ifund.com
(106) 万融证券
注册地址:北京市朝阳区望京中街27号中电大厦A座1201
办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座1201
法定代表人:王强
联系人:李强
电话:010-59399232
传真:010-59399274
客户服务热线:400-881-6655
公司网站:www.hwp.com/fund.com
(107) 鑫鼎信
注册地址:厦门思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
办公地址:厦门思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人:陈清波
联系人:李强
电话:0592-3227216
传真:0592-3227216
客户服务热线:0592-3227216
公司网站:www.sdb.com.cn
基金销售网站:www.fund.com.cn
(108) 一路证券
注册地址:北京西城区阜成门大街甲1号富华大厦B座2702
办公地址:北京西城区阜成门大街甲1号富华大厦B座2702
法定代表人:华强
联系人:李强
电话:010-68112099
客户服务热线:400-001-1564
公司网站:www.yifund.com
(109) 玖富基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园二区1号楼10层1001号
办公地址:北京市朝阳区望京东园二区1号楼10层1001号
法定代表人:王强
联系人:李强
电话:010-59812088
客户服务热线:400-895-811
公司网站:www.yifund.com
(110) 国信证券
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:北京市西城区金融大街19号富都大厦109
法定代表人:何伟
联系人:李强
电话:010-52825717
客户服务热线:400-600-2000
公司网站:www.guosen.com.cn
(111) 国信证券
注册地址:北京市朝阳区安华里1-15号楼顺源大厦10层
办公地址:北京市朝阳区安华里1-15号楼顺源大厦10层
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:010-62008888
客户服务热线:400-888-6664
公司网站:www.oncfund.com
(112) 中融证券
注册地址:北京市朝阳区建国路18号光大中心1110号
办公地址:北京市朝阳区建国路18号光大中心1110号
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:010-58807665
传真:010-58807864
客户服务热线:010-63087699
公司网站:www.cmfund.com.cn
(113) 中信建投证券
注册地址: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:李强
联系人:李强
电话:010-60769637
客户服务热线:400-887-786
公司网站:www.c618.com.cn
(114) 中融证券
注册地址:北京市朝阳区二环路中融时代广场(二期)11层1101-1106、11层
办公地址:北京市朝阳区二环路中融时代广场(二期)11层1101-1106、11层
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:0755-2393131
传真:0755-8321421

资产管理电话:400-799-8826
客户服务热线:400-1209182
传真:021-2601861
北京分公司:400-820-2099
公司网站:www.oncfund.com
(115) 众成基金
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006B
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006B
法定代表人:李强
联系人:李强
电话:0755-83227660
传真:0755-83227651
客户服务热线:400-799-8826
公司网站:www.oncfund.com www.guosen.com
(二)基金投资顾问
名称:方正证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址:广州市海珠区新涌东路3号广州广行大厦40-43楼
法定代表人:李强
电话:4008188888
传真:020-38792929
联系人:李强
(三)律师事务所和会计师事务所
律师事务所:北京德恒律师事务所
地址:北京市西城区金融大街19号富都大厦12层
负责人:王强
电话:010-52628888
传真:010-52628799
经办律师:徐强、李强
联系人:李强
(四)会计师事务所和独立注册会计师
本基金的法定验资机构为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。
会计师事务所:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
主要办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场E座15层101-12室
执行事务合伙人:Ng Albert Kong Pong 梁洪平
电话:(010)58188298
经办注册会计师:吕华、魏强
联系人:李强
本基金的审计师及其他指定事项的审计机构为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。
会计师事务所: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号展业大厦11楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展业大厦11楼
首席合伙人:李强
电话:(021)33238800
传真:(021)33238800
经办注册会计师:沈志杰
联系人:李强
四、基金的投资
本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的交易(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市)的股票(包括境内、央、行、地、方、股、票、公、司、债、券、次、级、债、中、期、票、据、短、期、融、资、券、资、产、支、持、证、券、等)、债、券、回、购、存、款、权、证、指、数、期、权、及、法、律、法、规、允、许、的、其、他、金、融、工、具。
本基金的投资策略包括:1)宏观策略:根据对宏观经济、行业和市场环境的变化,适时调整资产配置及行业配置;2)行业策略:根据对宏观经济、行业和市场环境的变化,适时调整资产配置及行业配置;3)个股策略:根据对宏观经济、行业和市场环境的变化,适时调整资产配置及行业配置。
本基金的投资组合比例:
股票资产占基金资产净值的比例不低于90%,其中投资于国内依法发行、上市的交易(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市)的股票(包括境内、央、行、地、方、股、票、公、司、债、券、次、级、债、中、期、票、据、短、期、融、资、券、资、产、支、持、证、券、等)、债、券、回、购、存、款、权、证、指、数、期、权、及、法、律、法、规、允、许、的、其、他、金、融、工、具。
本基金的投资组合比例:
股票资产占基金资产净值的比例不低于90%,其中投资于国内依法发行、上市的交易(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市)的股票(包括境内、央、行、地、方、股、票、公、司、债、券、次、级、债、中、期、票、据、短、期、融、资、券、资、产、支、持、证、券、等)、债、券、回、购、存、款、权、证、指、数、期、权、及、法、律、法、规、允、许、的、其、他、金、融、工、具。
本基金的投资组合比例:
股票资产占基金资产净值的比例不低于90%,其中投资于国内依法发行、上市的交易(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市)的股票(包括境内、央、行、地、方、股、票、公、司、债、券、次、级、债、中、期、票、据、短、期、融、资、券、资、产、支、持、证、券、等)、债、券、回、购、存、款、权、证、指、数、期、权、及、法、律、法、规、允、许、的、其、他、金、融、工、具。
本基金的投资组合比例:
股票资产占基金资产净值的比例不低于90%,其中投资于国内依法发行、上市的交易(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市)的股票(包括境内、央、行、地、方、股、票、公、司、债、券、次、级、债、中、期、票、据、短、期、融、资、券、资、产、支、持、证、券、等)、债、券、回、购、存、款、权、证、指、数、期、权、及、法、律、法、规、允、许、的、其、他、金、融、工、具。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)
本基金管理人承诺本基金投资组合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。
本基金投资组合报告由中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定编制,复核了本报告的内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本投资组合报告所载资料截至2015年9月30日止,数据截至2015年9月30日。
1. 报告期末本基金资产组合情况

序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	800,479,719.43	84.13
	其中:股票	800,479,719.43	84.13
2	固定收益投资	40,216,000.00	4.23
	其中:债券	40,216,000.00	4.23
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	90,549,064.66	9.52
	其中:银行存款	19,935,795.78	2.10
8	合计	981,238,579.87	100.00

2. 报告期末本基金投资的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	479,763,562.34	57.90
D	电力、热力、燃气生产和供应业	25,559,864.12	3.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,520,288.50	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	260,365,306.47	31.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	32,070,498.00	3.87
L	租赁和商务服务业	-	-
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	卫生、医药和医疗器械业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	综合	-	-
S	合计	800,479,719.43	96.60

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过90%,属于被动跟踪。
3. 报告期末按行业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	300199	赣锋锂业	2,812,716	90,935,168.28	10.97
2	300253	宜信软件	950,000	49,400,000.00	5.96
3	600871	伊泰集团	463,201	49,030,249.25	5.92
4	002260	伊立浦	1,165,600	47,428,264.00	5.73
5	000901	航天科技	689,600	45,341,200.00	5.47
6	002296	祥升科技	1,941,280	41,048,672.60	4.95
7	300083	冠昊医疗	433,662	35,705,795.38	4.29
8	002232	普华永道	716,440	30,561,794.60	3.69
9	002285	荣联行	1,400,000	30,016,000.00	3.62
10	600446	金证股份	211,336	26,091,542.56	3.13

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
4. 报告期末按行业公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

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

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
10. 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

11. 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

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
12. 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

13. 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

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
14. 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

15. 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

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
16. 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

17. 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

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
18. 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

19. 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

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
20. 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

21. 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

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-
2	华安证券	-	-
3	华安证券	40,216,000.00	4.85
4	中融证券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中融证券	-	-
7	中融证券	-	-
8	中融证券	-	-
9	中融证券	-	-
10	中融证券	-	-

注:本报告期末本基金投资组合资产占基金资产净值超过10%,属于被动跟踪。
22. 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国债02	400,000	40,216,000.00	4.85

23. 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

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中融证券	-	-