（上接B66版）

22) 金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025666
传真:0755-83025625
联系人 马贤清
客户服务热线:400-8888-228
网址:www.jyzq.cn
23) 东莞证券股份有限公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼
法定代表人:张运勇
联系人:张巧玲
联系电话:0769-22119426
公司网址:www.dgzq.com.cn
24) 东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:杨树财
联系电话:0431-85096517
传真:0431-85096795
联系人:安岩岩
网址:www.nesc.cn
25) 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336 号
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336 号
法定代表人:郁忠民
联系电话:021-53519888
传真:021-63608300
联系人:张瑾
客服热线:4008-918-918
公司网站:www.962518.com
26) 东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
联系电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
联系人:梁旭
客服热线:95531、400-8888-588
公司网站:www.longone.com.cn
27) 中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人:沈强
联系人:王霄霈
联系电话:0571-86078823
传真:0571-85783771
客户服务电话:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn
28) 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系电话:021-22169081
传真:021-68817271
联系人:刘晨
客户服务电话:95525
公司网站:www.ebscn.com
29) 平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系电话:0755-22627802
传真:0755-82400862
联系人:郑舒丽
客服电话:95511—8
网站:www.pingan.com
30) 中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
联系电话:0791-86768681
客服电话:400-8866-567
公司网址:www.avicsec.com
31) 华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人:李工
电话:0551-65161821
传真:0551-65161672
联系人:甘霖
公司网址:www.hazq.com
32) 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国风凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn
33) 渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:王春峰
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
网址:www.bhzq.com
34) 财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段 8 0 号顺天国际财富中心 2 6 层
办公地址:长沙市芙蓉中路二段 8 0 号顺天国际财富中心 2 6 层
法定代表人:周晖
联系电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
联系人:郭磊
客户服务热线:0731-84403343
网址:www.cfzq.com
35) 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栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋04、18-21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
联系电话:0755-82023442
客户服务热线:400 600 8008、95532
网址:www.china-invs.cn
36) 万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
联系人:罗创斌
联系电话:020-37865070
客户服务电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn
37) 第一创业股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
联系人:0755-23838750
客服电话:400 888 1888
网址:www.firstcapital.com.cn
38)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:邱三发
联系人 ;林浩茹?
联系电话:020-88836999
传真号码:020-88836654
客服热线:021-961303
网址:www.gzs.com.cn
39) 浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
电话:021-64718888
传真:021-64713795
联系人:李凌芳
客户服务热线:0571-967777
网址:www.stocke.com.cn
40) 华林证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:薛荣年
联系人:王叶平
联系电话:0755-82707705
客服电话:400-880-2888
公司网站:www.chinalions.com
41) 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:北京市西城区阜市口大街1号长安兴融中心西座11层
法定代表人:孔佑杰
联系人:苏江
电话:010- 88086830-652
网址:www.rxzq.com.cn
42) 方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙市芙蓉中路二段200号华侨国际大厦22-24层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦11层
法定代表人:雷杰
联系人:郭军瑞
联系电话:010-57398063
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com
43) 江海证券有限公司
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张背北
联系电话:0451-82336863
客服热线:4006662288
网址:www.jhzq.com.cn
44) 华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼
法定代表人:杨炯洋
联系人:张曼
联系电话:010-68716150
传真:028-86150615
客户服务咨询电话 ;400-8888-818
网址:www.hx168.com.cn
45) 红塔证券股份有限公司
注册地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:倪雨林
联系人:刘晓明
电话:0871- 3577942
客户服务电话:0871-3577930
网址:www.hongtazq.com
46) 银泰证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼
办公地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼
法定代表人:高颂
联系人:林文宇
联系电话:0755-83703759
咨询电话:0755-83710885
公司网址:www.ytzq.net
47) 华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址: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:陈林
联系人:刘闻川
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com
48) 爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:张建华
电话:(021)32229888
传真:(021)68728703
联系人:戴莉丽
客户服务电话:(021)63340678
网址:www.aizq.com
49) 国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表:冉云
联系人:刘婧渝
电话:028-86690057
传真:028-86690126
服务热线:4006-600109
公司网站:www.gjzq.com.cn
50) 信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼信达金融中心
办公地址:北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63080985
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
51) 华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市东岗路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
联系人:李昕田
客户服务电话:0931-4890619、4890618、4890100
网址:www.hlzqgs.com
52) 民生证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表:余政
联系人:赵明
电话:010-85127622
服务热线:400-619-8888
公司网站:www.mszq.com
53) 华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
邮政编码:350003
联系人:张腾
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)。
公司网址:www.hfzq.com.cn
54) 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:徐勇力
联系人:汤漫川
电话:010-66555316
服务热线:4008888993
公司网站:www.dxzq.net
55) 五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
法定代表人:高竹
联系电话:0755-82545555
传真:0755-82545500
联系人:赖君伟
网址:www.wkzq.com.cn
56) 财达证券有限责任公司
注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
法定代表人:翟建强
联系人:陈丽君
咨询电话:4006128888
公司网址 www.s10000.com
57) 新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝军
联系人:马俊杰
电话:010-83561329
传真:010-83561094
邮编:100086
客户服务电话:4006989898
公司网址:www.xsdzq.cn
58) 东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
联系人:吴宇
电话: 021-63325888
传真: 021-63326173
客户服务电话: 021-962506 或 4008888506
网址: www.dfzq.com.cn
59)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:崔成
电话:027-87610052
传真:027-87618863
客户服务电话:4008005000
网址:http://www.tfzq.com
60)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:陈敏
电话:021-64339000
传真:021-54668802
客户服务电话: 021-32109999;029-68918888;4001099918
网址:www.cfsc.com.cn
61)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址:西安市东新街232号陕西信托大厦6楼
法定代表人:刘建武
联系人:刘莹
电话:029-87406649
传真:029-87406710
客户服务电话:95582
网址:www.westsecu.com
(62)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:崔成
电话:027-87610052
传真:027-87618863
客户服务电话:4008005000
网址:http://www.tfzq.com
(63)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:丁学东
联系电话:028-84252471
客服电话:400-8878-566
网址:www.pyfund.cn
15)中期时代基金销售(北京)有限公司
住所: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:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
联系电话:010-59539888
客服电话:400-88888-160
网址:www.cifcofund.com
16) 万银财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址:北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:毛怀营
联系电话:010-59393923
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
17) 深圳腾元基金销售有限公司
住所: 深圳市福田区福华三路卓越世纪中心1号楼1806-1810
办公地址:深圳市福田区福华三路卓越世纪中心1号楼1806-1810
法定代表人: 卓紘矗
联系人:王鲲萍
联系电话:0755-33376853
客服电话:4006-877-899
网址:www.dowinfund.com
18)北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人:王昌庆
联系人:罗细安
联系电话:010-67000988
客服电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn
19) 北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
法定代表人:黄永伟
联系人:侯仁凤
联系电话:010-57756068
客服电话:400-786-8868
网址: www.chtfund.com
20)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:张晶
客服电话:440-8202-819
传真:021-33323830
联系人:黄敏儿
网址:https://www.bundwealth.com
基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

(三)注册登记机构
名称:鹏华基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
法定代表人:何如
联系人:吴群莉
联系电话:0755-82021106
传真:0755-82021165???

(四)律师事务所
名称:北京市竞天公诚律师事务所
住所:北京市朝阳区朝阳门外大街 20 号联合大厦15 层
负责人:张绪生
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街 20 号联合大厦15 层
联系电话:010- 65882200,0755-23982200
传真:010- 65882211,0755-23982211
联系人:黄亮
经办律师:孔雨泉、黄亮

(五)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:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:陈熹
经办注册会计师:单峰、陈熹

四、基金的名称

本基金名称:鹏华精选成长混合型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:混合型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金为混合型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,自下而上精选具有良好持续成长潜力的上市公司,力争基金资产的长期增值。

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股票、债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%,其中投资于具有良好持续成长潜力的上市公司发行的股票占股票资产的比例不低于80%;债券、货币市场工具及其他资产不高于基金资产的40%,其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金采用积极主动管理的投资方法,自下而上精选具备良好持续成长潜力的上市公司,在严格控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。

1. 资产配置策略

本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场技术指标、市场资金构成及流动性情况,运用定性和定量相结合的分析手段,对证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

2. 股票投资策略

(1)成长股票的定义

预期未来两年主营业务收入增长率或公司利润增长率高于市场平均水平的上市公司股票,或因公司基本面发生重大改变(如资产注入、更换股东、产品创新、改变主营业务方向等)而具有潜在主营业务收入或公司利润高增长趋势的上市公司股票。

本基金对股票的投资采用自下而上的个股精选策略,结合定性分析与定量分析构建投资组合,并进行定期和不定期调整。

(2)成长股票的筛选

对本基金初选的备选股票所属企业,借助于定量分析和定性分析相结合的方式,对成长性股票进行初步筛选。

1)定量分析

盈利能力是上市公司成长潜力的体现,上市公司能否将自身各种优势转化为不断释放的盈利能力是其具有持续成长性的主要标志。体现盈利能力的主要指标有上市公司主营业务收入增长率和上市公司利润增长率。本基金以预期未来两年上市公司主营业务收入增长率或上市公司利润增长率是否高于国内A股市场平均水平来衡量上市公司是否具备持续成长潜力。在定量分析中,本基金还将关注上市公司基本面发生重大变化对其未来盈利能力的影响。

2)定性分析

在定量分析的基础上,本基金采用定性分析的方法研究并考察上市公司盈利能力的质量和可靠性,以便从更长期的角度保证定量方法所选上市公司的盈利增长的持续性。

上市公司盈利增长的持续性取决于盈利增长背后的驱动因素,这些驱动因素往往是上市公司具备的相对竞争优势,具体包括技术优势、资源优势和商业模式优势等。

本基金通过对上市公司的技术优势、资源优势和商业模式优势的分析,判断推动上市公司主营业务收入或上市公司利润增长的原因和可望保持的时间,进而判断上市公司成长的持续性。

技术优势分析。主要通过对公司的自主创新产品率、主要产品更新周期、拥有专有技术和专利、对引进技术的消化、吸收和改进能力等指标进行考察和分析,进而判断公司的创新能力和技术水平。

资源优势分析。主要通过对公司的规模、政策扶持程度、成本、进入壁垒、国内外同行企业比较和垄断性等指标进行考察和分析,进而判断公司的资源优势是否支持其持续成长。

商业模式分析。公司商业模式理念决定了公司在其所属行业中发展的潜力和方向,我们分行业的对上市公司考核和分析其商业模式和经营理念。

(3)股票投资组合的构建

1) 基金管理小组确定拟买入股票名单;基金管理小组在备选股票库的基础上,通过对市场状况和时机的分析,再结合对个股主营业务收入或公司利润增长趋势的判断,从备选股票库中精选拟买入股票名单。

2) 基金管理小组在确定的个股权重范围内构建股票投资组合;基金管理小组在拟买入股票名单的基础上,结合对投资限制条件的考虑,对上市公司预期主营业务收入增长率和公司利润增长率的考虑以及对投资股票流通市值规模占比的考虑,确定个股权重,完成股票投资组合的构建。

3.债券投资策略

本基金将采取久期策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。

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,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等。

本基金将充分考虑资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类别的选择,谨慎投资,追求长期稳定收益。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

沪深300指数充分反映了A股市场的行业代表性,描述了沪深A股市场的总体走势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面,期限构成宽泛,比较适用于做基金债券资产的业绩基准。

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,本基金可以在与基金托管人协商一致并报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

本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7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。

本报告中所列财务数据截至2015年06月30日(未经审计)。

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	372,491,875.51	82.57
	其中:股票	372,491,875.51	82.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	78,039,809.37	17.30
7	其他资产	604,870.39	0.13
8	合计	451,136,555.27	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	244,921,365.44	62.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	21,127,107.93	5.37
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	信息传输、软件和信息技术服务业	18,641,000.00	4.74
J	金融业	63,179,595.48	16.07
K	房地产业	-	-
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	9,338,488.00	2.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,494,918.66	1.91
R	文化、体育和娱乐业	7,789,400.00	1.98
S	综合	-	-
	合计	372,491,875.51	94.72

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	002475	立讯精密	906,965	30,664,486.65	7.80
2	300145	南方泵业	600,000	26,370,000.00	6.71
3	601318	中国平安	284,142	23,282,595.48	5.92
4	002572	索菲亚	527,533	20,378,599.79	5.18
5	300259	新天科技	1,200,052	18,120,785.20	4.61
6	002450	康得新	500,000	15,300,000.00	3.89
7	002271	东方雨虹	579,082	14,882,407.40	3.78
8	002616	长青集团	500,044	14,851,306.80	3.78
9	600201	金宇集团	194,381	13,824,376.72	3.52
10	000786	北新建材	715,936	13,695,855.68	3.48

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
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
注:本基金本报告期末未持有债券。
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
注:本基金本报告期末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
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
(2) 本基金投资股指期货的投资政策
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1)本期国债期货投资政策
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和拟益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
(3)本期国债期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
11. 投资组合报告附注

(1)根据中国证监会[2014]103号文,本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称"中国平安")的控股子公司平安证券有限责任公司(简称"平安证券")于2014年12月08日收到《中国证监会行政处罚决定书》,称平安证券在深圳海联讯科技股份有限公司(简称"海联讯")首次公开发行股票并在创业板上市项目中作为海联讯的保荐机构和主承销商,因未勤勉尽责,未能发现海联讯在会计期末虚构收回应收账款,同时在相关会计期间虚增营业收入的事实,致使其所出具的保荐书中关于海联讯应收账款项目的财务数据和财务指标的陈述、海联讯最近三年财务会计文件无虚假记载的陈述、海联讯符合发行上市条件的结论意见存在虚假记载,中国证监会决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2,867万元,并处以440万元罚款。

对该股票的投资决策程序的说明:该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

2014年6月23日,本基金投资的前十名证券之一的新天科技之发行人新天科技股份有限公司(以下简称"公司"或"新天科技")收到了中国证监会河南监管局《关于新天科技股份有限公司公司治理情况的综合评价及整改要求》(豫证监发[2014]164号,以下简称"整改意见")。要求公司在收到通知十五日内,提出具体的改进措施,并书面报送中国证监会河南监管局。

2014年7月1日,公司发布公告,说明"在收到中国证监会河南监管局的整改意见后,公司董事会高度重视,认真对照《上市公司章程指引》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《上市公司股东大会规则》、《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》(证监公司字[2007]56号)、《上市公司治理准则》等相关法律法规及《公司章程》等内部规章制度,对中国证监会河南监管局现场检查我公司中发现的问题进行了认真、深入的分析,积极查找问题的根源,结合公司实际情况制订了整改方案,并采取有效的措施进行整改。"

根据公告,公司整改方案如下:

一、部分制度需进一步完善

1.公司制度中董事会、股东大会对个别事项的审议权限存在矛盾。公司董事会议事规则第六条规定交易金额占总资产比例达到50%的,由股东大会审议;公司章程和股东大会议事规则中规定一年内购买、出售资产达到总资产的30%的,必须提交股东大会审议。

整改措施:公司根据《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《上市公司章程指引》及《公司章程》等有关规定,对公司《董事会议事规则》进行了修订,使公司《董事会议事规则》与《公司章程》的审批权限相一致。 相关内容已经公司第二届董事会第九次会议审议通过,目前尚需提交股东大会审议通过后生效。

2.公司制订的《公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》中,未对持股超过5%以上股东违规买卖股票行为做出限定,不符合《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》(证监公司字[2007]56号)的相关规定。

整改措施:公司按照《公司法》、《证券法》、《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等法律、法规及规范性文件的要求,对《公司董事、监事和高级管理人员持有和买卖本公司股票管理制度》进行了修订。相关内容已经公司第二届董事会第九次会议审议通过,自董事会审议通过之日起生效。

二、股东大会运作不规范

1.存在个别股东委托其他股东出席股东大会,缺少授权委托书的情形,不符合《上市公司章程指引》第六十条的规定。

整改措施:公司已组织相关人员再次学习了《上市公司章程指引》、《上市公司股东大会规则》、《公司章程》及《公司股东大会议事规则》,今后,公司将进一步规范股东大会的召开,确保工作底稿保存的规范性、完整性。

2.个别股东大会未按要求选举两名股东代表计票和监票,不符合《上市公司章程指引》第八十七条的规定。

整改措施:公司已组织相关人员再次学习了《上市公司章程指引》、《上市公司股东大会规则》、《公司章程》及《公司股东大会议事规则》,今后,公司将进一步规范股东大会计票、监票工作,确保各项文件均按要求签字、盖章。

三、募集资金使用审批不完整

公司募集资金使用的审批程序未严格按照公司募集资金管理制度的规定执行,存在个别支付项目审批不完整的情形。

整改措施:公司募集资金支出中的个别凭证缺少董事长或总经理的签批,主要是经办人员在董事长或总经理出差期间电话请示后,未做书面记录所致。公司已组织相关人员重新学习了《公司募集资金管理和使用办法》,后期,公司将进一步规范募集资金使用审批流程,确保募集资金使用审批的完整性。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,从公告中知悉,公司将认真落实各项整改措施,加强各岗位人员的学习和培训,进一步完善公司法人治理结构,促进公司的健康、稳定发展。本次整改对于上市公司经营并不构成重大实质性影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券之一的内蒙古金宇集团股份有限公司(简称"金宇集团"或"公司")于2014年6月19日至6月27日,内蒙古证监局对公司进行了现场检查,并于2014年9月16日向公司下发了《关于内蒙古金宇集团股份有限公司的监管关注函》(内证监上市字[2014]36号)。现场检查发现金宇集团存在如下问题:1、公司部分制度需要进一步修订完善,包括公司《董事会工作条例》和《总裁工作细则》关于总裁授权的规定不一致、公司《信息披露管理制度》需要补充完善、公司高级管理人员报酬制度需要重新修订、公司《章程》及《股东大会规则》需要补充完善等;2、公司董事会薪酬与考核委员会没有严格按照《上市公司治理准则》第五十六条规定充分发挥作用。

根据金宇集团发布的公告,公司部署了相应整改措施,包括1、将尽快对《董事会工作条例》与《公司总裁工作细则》两项制度进行修订完善,统一资金运用权限的决策标准;2、对《信息披露管理制度》进行查缺补漏;3、计划将高级管理人员薪酬制度纳入到公司薪酬和考核制度方案当中,并根据不同岗位采取固浮比年薪制,运用KPI考核指标,加强和完善高级管理人员的考核机制,形成一套科学合理的高管薪酬考核制度;4、对《公司章程》和《股东大会规则》当中相关内容进行补充修订,提交董事会、股东大会进行审议;5、组织董事会薪酬与考核委员会成员认真学习《上市公司治理准则》及《金宇集团薪酬与考核委员会议规则》,总结过去工作中的不足,恪守勤勉尽责的义务,与咨询公司密切配合,积极参与公司薪酬与考核制度改革和方案制定;上述工作正在进行中,预计于2015年4月30日前完成。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,金宇集团作为国内生物疫苗市场苗的龙头企业,具备较好的投资价值。从监管措施公告中知悉,相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对金宇集团的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。公司在证监局的监督下,已经提出了相应的整改措施。 该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期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没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	196,431.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,881.51
5	应收申购款	395,557.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	604,870.39

(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	000786	北新建材	13,695,855.68	3.48	重大事项

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩(未经审计)

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财产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示(本报告中所列财务数据未经审计);

	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
2009年9月9日(基金合同生效日)至2009年12月31日	3.40%	1.07%	10.38%	1.42%	-6.98%	-0.35%
2010年1月1日至2010年12月31日	-3.87%	1.34%	-9.26%	1.27%	5.39%	0.07%
2011年1月1日至2011年12月31日	-27.67%	1.06%	-19.44%	1.04%	-8.23%	0.02%
2012年1月1日至2012年12月31日	9.32%	1.03%	7.09%	1.02%	2.23%	0.01%
2013年1月1日至2013年12月31日	17.05%	1.20%	-5.90%	1.12%	22.95%	0.08%
2014年1月1日至2014年12月31日	17.72%	1.10%	42.57%	0.97%	-24.85%	0.13%
2015年1月1日至2015年6月30日	69.34%	2.26%	22.09%	1.81%	47.25%	0.45%
自基金合同生效日至2015年6月30日	83.40%	1.28%	41.54%	1.19%	41.86%	0.09%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较;