

(上接B35页)

办公地址: 兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法定代表人: 李俊安
联系人: 李昕安
联系电话: (0931) 4890208
客户服务热线: 400-689-8888、0931-96668
传真: (0931) 4890268
网址: www.hdq.com
074 华信证券
注册地址: 北京市西城区金融大街8号
办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦2层
法定代表人: 倪俊忠
联系人: 魏静
联系电话: 010-85554100
客户服务热线: 400-898-9999
传真: 010-8556153
网址: www.hncc.com.cn
075 华信证券
注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A1、B01(1)单元
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人: 俞萍
联系人: 俞萍
联系电话: 021-54967202
客户服务热线: 021-32109999(029-68918888;4001199918)
传真: 021-54967293
网址: www.cfc.com.cn
076 华信证券
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址: 上海市,杨浦区
电话: 021-38784818
传真: 021-68775878
联系人: 曹博
客户服务热线: 021-38784818
网址: www.hbzq.com
077 国信证券
注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人: 孙名扬
联系人: 周昆
联系电话: 0451-85863278
传真: 0451-8237279
客户服务热线: 400-666-2266
网址: www.guang.com.cn
078 金元证券
注册地址: 海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
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: 周海
联系人: 马静涛
联系电话: 0755-83025022
客户服务热线: 400-8888-228
传真: 0755-8302628
网址: www.jyzt.com
079 开华证券
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: 李刚
联系电话: 029-81876633
客户服务热线: 400-860-8866
传真: 029-88474611
网址: www.kysec.com
080 平安证券
注册地址: 深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址: 深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人: 谢永林
联系人: 王莉英
联系电话: 021-38631117
客户服务热线: 95511-8
传真: 021-50991896
网址: www.pingan.com
081 日信证券
注册地址: 内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
办公地址: 内蒙古
联系人: 陈文彬
联系电话: 010-83991716
客户服务热线: 400-660-9839
传真: 010-66412537
网址: www.rdq.com.cn
082 山西证券
注册地址: 太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址: 太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人: 侯健
联系人: 郭海
联系电话: 0351-8686659
客户服务热线: 85573828;400-666-1618
传真: 0351-8686619
网址: www.sx18.com.cn
083 上海证券
注册地址: 上海市西藏中路336号
办公地址: 上海市西藏中路336号
法定代表人: 龚德雄
联系人: 王君
联系电话: 021-53519888
客户服务热线: 021-962518
传真: 021-53519888
网址: www.962518.com
084 申万宏源西部证券
注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2905室
办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2905室
法定代表人: 李季
联系人: 李琳
联系电话: 010-88088888
客户服务热线: 400-800-0562
传真: 010-88088195
网址: www.shw.com.cn
085 申万宏源证券
注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人: 李梅
联系人: 曹颖
联系电话: 021-33388888
客户服务热线: 95521,4008995523
传真: 021-33388224
网址: www.swhyc.com.cn
086 世纪证券
注册地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
办公地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
法定代表人: 姜英军
联系人: 陈静东
联系电话: 0755-83195111
开放式基金咨询电话: 0755-83199511
开放式基金业务传真: 0755-83199545
网址: www.cc.com.cn
087 天风证券
注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
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: 杨俊
联系电话: 027-87107553
客户服务热线: 4008000000
网址: www.tfzq.com
088 万联证券
注册地址: 广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
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: 甘智
联系电话: 020-38286206
客户服务热线: 400-8888-133
传真: 020-38286588
网址: www.wljz.com.cn
089 西南证券
注册地址: 重庆市江北北区协信中心
办公地址: 重庆市江北北区协信中心西南证券大厦
法定代表人: 余洪雄
联系人: 王芳芳
联系电话: 023-6786333
客户服务热线: 4008796996
网址: www.swsc.com.cn
090 信达证券
注册地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人: 张志刚
联系人: 唐静
联系电话: 010-63081000
客户服务热线: 400-800-8899
传真: 010-63080778
网址: www.cindasc.com.cn
091 兴业证券
注册地址: 福州市湖东路268号
办公地址: 上海市浦东新区民生路1199号证大五道口广场1号楼20层
法定代表人: 兰荣
联系人: 林国雄
联系电话: 0591-38509750
客户服务热线: 95562
网址: www.xyzq.com.cn
092 银河证券
注册地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址: 北京市西城区金融大街
联系人: 吴昊
联系电话: 010-66562922
客户服务热线: 4008-888-8888
传真: 010-66568900
网址: www.chinastock.com.cn
093 招商证券
注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人: 宫少林
联系人: 黄辉
联系电话: 0755-82943668
客户服务热线: 400-888-1111
传真: 0755-82943630
网址: www.newe.com.cn
094 中银证券
注册地址: 南昌市长红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座11楼
办公地址: 南昌市长红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座11楼
法定代表人: 王志刚
联系人: 王志刚
联系电话: 010-68180311
客户服务热线: 400-8866-567
办公地址: 上海市徐汇区龙田路190号东方财富中心20楼
联系人: 李羿
联系电话: 021-50105116
客户服务热线: 400-881-8888
网址: www.ccb.com.cn
095 中银证券
注册地址: 深圳市南山区科技中一路西华强高科技大厦7楼B1层
办公地址: 深圳市南山区海德三道创世纪科技园电子商务产业园2号楼2楼
联系人: 李宇杰
联系电话: 0757-89911878
客户服务热线: 4008-773-772
传真: 0757-89004233
网址: www.bzwd.com.cn
096 齐鲁证券
注册地址: 山东省济南市经一路66号
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座3201
法定代表人: 李琦
联系人: 李琦
联系电话: 021-20313255
客户服务热线: 95538
传真: 021-20315137
网址: www.gdsc.com.cn
097 中银证券
注册地址: 辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址: 辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
联系人: 马功健
联系电话: 024-23280810
客户服务热线: 4000180315
公司网站: http://www.stcn.com/

客户服务热线: 0592-3122716
公司网站: www.sdb.com.cn
基金业协会网站: www.fund.org.cn
0130 新创元
注册地址: 北京市海淀区北四环西路88号理想国际大厦906室
办公地址: 北京市海淀区北四环西路88号理想国际大厦906室
法定代表人: 王文斌
联系人: 王文斌
客户服务热线: 010-6275309
网址: www.xincyu.com
网址: http://www.xincyu.com/

0131 一路财富
注册地址: 北京西城区车公庄大街9号华融大厦C座702
办公地址: 北京市朝阳区阜成门内大街27号新世界广场B座208
法定代表人: 吴奇涛
联系人: 吴奇涛
电话: 010-88312877
传真: 010-88312999
客户服务热线: 400-001-1566
公司网站: www.yilucaifu.com
0132 宜信基金
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址: 北京市朝阳区望京东路8号望京国际中心A座1205室
法定代表人: 王正明
联系人: 胡波
电话: 010-60888888
传真: 010-60881155
客户服务热线: 4008-955-811
网站: www.yifund.com

0133 宜信普泽
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SOHO现代城C座1809
法定代表人: 沈伟博
联系人: 王玥明
电话: 010-53855163
传真: 010-58894285
客户服务热线: 400-6099-200
公司网站: www.yxinfund.com
0134 歌华证券
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室
法定代表人: 肖文
联系人: 黄晓娟
电话: 020-89629019
传真: 020-89629011
客户服务热线: 020-89629066
公司网站: www.gohua.com

0135 增裕基金
注册地址: 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1208-1209室
法定代表人: 李勇安
联系人: 史国辉
电话: 010-67000888
传真: 010-67000888-6000
客户服务热线: 400-001-8811
公司网站: www.zycf.com.cn

0136 展信基金
注册地址: 北京市朝阳区顺义区后沙峪镇顺安街6号
办公地址: 北京市朝阳区安苑路15-15号邮电新闻大厦2层
法定代表人: 闫俊波
联系人: 王琳
联系电话: 010-62020988
客户服务热线: 400-6262-818
公司网站: www.zxifund.com

0137 中期资产
注册地址: 北京市朝阳区朝外大街19号11层11103号
办公地址: 北京市朝阳区朝外大街19号11层1103号
法定代表人: 姜新
联系人: 姜新
电话: 010-62020355
网址: www.myfund.com

0138 中期资管
注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路14号11层11103号
办公地址: 北京市朝阳区朝外大街19号11层1103号
法定代表人: 姜新
联系人: 姜新
电话: 010-62020355
网址: www.myfund.com

0139 中融基金
注册地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1306室、14层
办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1306室、14层
联系人: 李强
电话: 0755-23952913
传真: 0755-83217421
客户服务热线: 400-990-8826
公司网站: http://www.zrctf.com/

0140 众基金
注册地址: 深圳市罗湖区笋岗路物资置地大厦楼
办公地址: 深圳市罗湖区笋岗路物资置地大厦楼
法定代表人: 薛峰
联系人: 董彩平
电话: 020-38799345
传真: 020-38799345
公司网站: www.zfund.com www.jinnu.com

(二) 基金登记机构
名称: 转融通基金管理有限公司
注册地址: 广东省珠海市横琴新区宝中三路3号4004-8室
办公地址: 广州市天河区珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
联系人: 李强
电话: 4008819888
传真: 020-38799249
联系人: 李强
(三) 律师事务所和经办律师
律师事务所: 国浩律师(广州)事务所
地址: 广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层
负责人: 程秉
电话: 020-38799345
传真: 020-38799345
经办律师: 黄丹、冯海潮
联系人: 黄丹
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 普华永道会计师事务所(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)
主要办公场所: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
会计师事务所人: Ng Albert Kong 吴英华
电话: (010) 58133000
联系人: 李博
电话: (010) 58182829
办公地址: 北京市朝阳区朝来庄188号
联系人: 李博
电话: 020-38799345
传真: 020-38799345
经办律师: 黄丹、冯海潮
联系人: 李强

(二) 基金登记机构
名称: 转融通基金管理有限公司
注册地址: 广东省珠海市横琴新区宝中三路3号4004-8室
办公地址: 广州市天河区珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
联系人: 李强
电话: 4008819888
传真: 020-38799249
联系人: 李强

(三) 律师事务所和经办律师
律师事务所: 国浩律师(广州)事务所
地址: 广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层
负责人: 程秉
电话: 020-38799345
传真: 020-38799345
经办律师: 黄丹、冯海潮
联系人: 李强

(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 普华永道会计师事务所(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)
主要办公场所: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
会计师事务所人: Ng Albert Kong 吴英华
电话: (010) 58133000
联系人: 李博
电话: (010) 58182829
办公地址: 北京市朝阳区朝来庄188号
联系人: 李博
电话: 020-38799345
传真: 020-38799345
经办律师: 黄丹、冯海潮
联系人: 李强

六、基金的投资目标
 本基金为混合型基金,追求超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资范围
 本基金的投资范围包括依法发行、上市的股票(包括创业板、中小板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、证券公司短期融资券、次级债、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货及其他法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

八、基金的投资策略
 本基金为混合型基金,股票资产占基金资产的比例70%-90%,扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例5%-20%,股指期货及其他金融衍生品投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。本基金现金资产占基金资产净值的比例不低于基金资产净值的5%。

九、基金的投资限制
 1. 资产支持证券
 本基金投资资产支持证券,应综合考虑信用等级、流动性、市场估值、提前偿还等因素,尤其关注各项政策对资产支持证券的影响,确定组合中资产支持证券、债券等资产类别的配置比例。

2. 新券上市的限制
 本基金所投资的新券是指中国经济出现出的经济增速放缓、经济结构不断优化,以及经济增长动力从要素驱动和投资驱动向创新驱动的转型。具体而言,本基金所投资的新券类型包括:与宏观经济同步、具有市场需求的消费品;预期经济产出稳定,产业驱动效应强等带来的生产力的进步;从科技驱动新兴产业发展方向来看,随之受益的产业包括不限于节能环保、高端装备制造、信息技术、生物医药、新材料、新能源等。经济生活的全面发展与制度创新和科技创新,改革包括经济、政治、社会文化等各方面内容,随着改革的全面深入,改革红利可能以不同的形式和途径显现,从而影响相关产业和公司并使其处于受益地位,进而对资本市场产生积极影响。本基金重点投资于上述新兴产业及相关产业链公司的股票,包括但不限于与基金投资组合相一致、资源禀赋佳、成长性高、估值合理、流动性好、具有明确的增长逻辑和竞争优势、商业模式清晰、运营效率高、公用事业、金融等服务产业。

3. 消费类资产
 随着中国经济的发展,国内收入和居民财富的不断积累,人口出生日益老龄化,居民消费结构快速升级和消费升级,消费升级和消费升级,本基金所投资的新券类型包括:与宏观经济同步、具有市场需求的消费品;预期经济产出稳定,产业驱动效应强等带来的生产力的进步;从科技驱动新兴产业发展方向来看,随之受益的产业包括不限于节能环保、高端装备制造、信息技术、生物医药、新材料、新能源等。经济生活的全面发展与制度创新和科技创新,改革包括经济、政治、社会文化等各方面内容,随着改革的全面深入,改革红利可能以不同的形式和途径显现,从而影响相关产业和公司并使其处于受益地位,进而对资本市场产生积极影响。本基金重点投资于上述新兴产业及相关产业链公司的股票,包括但不限于与基金投资组合相一致、资源禀赋佳、成长性高、估值合理、流动性好、具有明确的增长逻辑和竞争优势、商业模式清晰、运营效率高、公用事业、金融等服务产业。

4. 对外投资策略
 以“端上-中游-下游经济”和“端上-中游-下游经济”为代表的系列区域经济一体化战略对外经济战略,代表了中国经济转型升级和对外开放的新需求,旨在通过投资各区域进行包括基础设施、金融、高新技术、公用事业、文化产业等产业的开发,实现区域发展。随之受益的产业包括不限于交通物流、能源、商业贸易、金融、文化、旅游、农林渔牧产业等。

5. 新常态主题相关资产的投资
 5.1 新常态主题相关资产是指一个动态的过程,随着经济和技术的持续发展,可能会出现新的符合新常态特征的产品,届时本基金将其纳入投资体系之中,中期不符合新常态特征的产品。

3. 个股投资策略
 (1) 基本面策略
 在新常态主题相关产业的基础上,本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司:公司在行业景气度较高;具有可持续性;公司在行业竞争格局良好;有潜力成为行业龙头地位的公司;公司管理层素质优秀,股权结构合理;管理团队经验丰富;具有明确的增长逻辑和竞争优势;盈利能力较强。

(2) 估值策略
 本基金将选择上市公司中价值低估及公司本身的特征,选择合理的股票估值方法,可采用市盈率法(PE)、市净率法(PB)、市盈率-现金流法(P/E)、企业价值/销售收入(EV/Sales)、企业价值/息税前利润(EV/EBITDA)、自由现金流贴现法(FCF、FCFE)或股利贴现模型(DDM)等,通过估值分析,选择基金管理人认为价值低估或估值合理的股票。

(3) 股票组合的构建与调整
 本基金在新常态主题相关产业的公司中,基于基本面、估值水平等因素基础上进行股票组合的构建,当行业或公司不再符合本基金的投资条件,或行业、公司的基本面、估值水平出现较大变化时,本基金将调整组合适时进行跟踪调整。

4. 债券投资策略
 (1) 在债券投资方面,本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次,本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场不同类属债券的收益率水平,定期对投资组合类属资产,在国债、金融债、企业债、公司债、可转债、中期票据、资产支持证券、短期融资券等固定收益品种之间进行配置,并结合经济变化趋势,适时调整不同品种的配置比例。在券种选择方面,本基金将密切跟踪市场利率变化,选择流动性好、信用高、具有良好投资价值的品种进行投资。

(2) 债券组合的构建与调整
 本基金在新常态主题相关产业的公司中,基于基本面、估值水平等因素基础上进行股票组合的构建,当行业或公司不再符合本基金的投资条件,或行业、公司的基本面、估值水平出现较大变化时,本基金将调整组合适时进行跟踪调整。

5. 衍生品投资策略
 (1) 本基金将以套期保值交易为目的,根据风险管理的原则,适度开展衍生品投资。本基金将根据对现货市场和衍生品市场的相关性分析,采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。具体投资策略包括:1)对冲投资组合的系统性风险;2)有效管理现金流量,降低组合仓位过程中的冲击成本等。

(2) 本基金将根据对宏观经济和外部市场利率变化,适时调整不同品种的配置比例,并结合经济变化趋势,适时调整不同品种的配置比例。

(3) 本基金将关注其他金融衍生品的发展,如法律法规允许和基金投资需要的前提下,本基金将选择流动性好、具有明确的增长逻辑和竞争优势、盈利能力较强。

十、基金的风险控制
 本基金的风险控制遵循以下原则:1. 事前风险控制:在投资决策前,通过风险评估和压力测试,识别潜在风险;2. 事中风险控制:在投资过程中,实时监控投资组合的风险敞口,及时调整仓位;3. 事后风险控制:在投资结束后,对投资组合的风险敞口进行复盘,总结经验教训。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)
 截至2015年9月30日,本基金投资组合情况如下:

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	4,347,238,754.42	63.04
2	其中:股票	4,347,238,754.42	63.04
3	固定收益投资	510,309,393.40	7.40
4	其中:债券	510,309,393.40	7.40
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	837,602,136.40	12.15
8	银行存款和结算备付金合计	1,162,580,186.16	16.86
9	其他资产	37,818,175.74	0.55
8	合计	6,895,548,541.82	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	2,360,540,107.39	34.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,979,625	0.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	23,200,350.08	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息、软件和信息技术服务业	1,135,715,691.69	16.52
J	金融业	61,899,752.40	0.90
K	房地产业	134,081,518.93	1.95
L	租赁和商务服务业	135,557,023.80	1.97
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和其他制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	182,803,841.05	2.66
R	文化、体育和娱乐业	313,546,467.08	4.56
S	综合	-	-
合计		4,347,238,754.42	63.23

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	600074	保千里	25,866,249	314,274,925.35	4.57
2	300144	瑞福深芝	13,886,022	313,546,467.08	4.56
3	300182	福耀股份	6,979,625	303,639,973.75	4.42
4	002025	招商股份	11,529,858	302,082,279.60	4.39
5	301046	东方雨虹	8,000,000	235,600,000.00	3.43
6	300222	科大智能	15,133,311	225,032,334.57	3.27
7	002230	科大讯飞	7,500,000	201,000,000.00	2.92
8	300204	机器人	3,400,000	192,780,000.00	2.80
9	002292	奥飞动漫	4,921,870	144,013,916.20	2.09
10	300244	迦安诺	2,000,000	138,580,000.00	2.02

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(%)
1	国债投资	281,393.40	0.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	510,228,000.00	7.42
4	其中:政策性金融债	510,228,000.00	7.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	待摊费用	-	-
8	待偿债券	-	-
9	合计	510,309,393.40	7.42

5. 报告期末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	150416	15债16	2,600,000	260,079,000.00	3.7