

(上接B42版)

④企业所处行业发展前景良好,已进入景气复苏期,稳定增长(传统行业)或成长早期(新兴行业),预期主营业务利润和经营业务收入增长保持在较高水平;
⑤企业内部控制结构较完善,产品具有较高的市场占有率,处于行业领先水平;

2.债券投资策略
本基金债券投资部分主要运用久期调整、收益率曲线配置、类型配置、无风险套利和可转债等手段等策略。
本基金债券投资部分主要投资于信用评级和信用评级BBB以上的债券,具有以下一或更多项特征的债券,将是本组合债券投资重点关注的对象:

- (1)流动性较好;
 - (2)到期收益率相对于同类债券较高;
 - (3)发行人信用等级和财务状况良好,偿债能力强;
 - (4)符合本基金投资策略和资产配置的要求。
- (二)决策依据
- 1.国家有关法律、法规和《基金合同》的规定;
 - 2.宏观经济形势、政策趋势和宏观经济形势;
 - 3.宏观经济周期;
 - 4.行业和市场的基本面;
 - 5.证券市场发展趋势。
- (三)决策和操作流程
- 本基金参与投资决策流程的机构和部门包括:投资决策委员会、基金经理、研究员,具体程序如下:
- (1)金融工程人员选择适合的金融工具,对市场各类证券收益率曲线进行跟踪,并对各类收益率曲线之间的相对关系以及收益率曲线与基金投资组合之间的关系进行数量分析;
 - (2)研究员和基金投资部联合对宏观经济和债券市场深入研究,初步确定资产配置方案;
 - (3)基金经理构造投资组合计划;
 - (4)金融工程人员将对投资组合计划进行风险收益分析,提出修正意见;研究员跟踪分析市场宏观以及债券市场并分析,对投资组合计划进行风险评估;
 - (5)投资决策委员会最后确定投资组合方案;
 - (6)基金经理通过交易系统完成投资组合方案的构建;
 - (7)金融工程人员将对投资组合进行跟踪评估,提出风险控制意见,按照风险大小、定期或不定期对基金经理、投资总监、投资决策委员会反馈;
 - (8)风险管理部、监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行监控。

(9)评估和调整决策程序,投资决策委员会根据市场环境的变化和实际需要可调整决策的程序,基金经理调整投资组合授权经理审批程序进行;

(b)在确保基金份额持有人合法权益的前提下,基金经理有权根据市场变化 and 实际需要对上述程序做适当的调整。

(四)投资组合管理方法说明

本基金为主动型基金,采取主动投资策略,债券和现金的配置比例,在正常市场情况下,本基金投资组合的基本范围为:股票资产60%~95%,债券资产0%~45%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%,其中,股票投资的重点为由基金先行策略选股系统挑选出的、兼具成长性特征和价值洼地的股票。

十一、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准:68%*沪深300指数 + 32%*中国国债指数

说明:沪深300指数为上海证券交易所编制的在上海、深圳两个证券交易所上市流通市值最大的600只股票并以流通股本加权的指数,且目前中国资本市场中公信力较强的股票指数,同时国债指数涵盖了沪深两市的国债,是比较有市场影响力的国债指数,根据本基金的投资策略和投资范围的规定,选用以上比较基准是合适的。

十二、基金的投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人光大银行根据本基金合同已于2016年1月20日复核了本报告中财务报告数据,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。

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,624,685,754.94 | 84.09 |
| | 其中:股票 | 1,624,685,754.94 | 84.09 |
| 2 | 基金投资 | -- | -- |
| 3 | 固定收益投资 | 40,028,000.00 | 2.07 |
| | 其中:债券 | 40,028,000.00 | 2.07 |
| 4 | 资产支持证券 | -- | -- |
| 5 | 贵金属投资 | -- | -- |
| 6 | 买入返售金融资产 | -- | -- |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -- | -- |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 229,040,984.08 | 11.86 |
| 8 | 其他资产 | 38,244,869.00 | 1.98 |
| 9 | 合计 | 1,931,999,608.02 | 100.00 |

2.报告期内行业分类的基金份额投资组合

| 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 | 849,520,662.82 | 44.72 |
| D | 电力、热力、燃气及生产和供应业 | 8,942,400.00 | 0.47 |
| E | 建筑业 | -- | -- |
| F | 批发和零售业 | 32,196,968.96 | 1.69 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 26,444,709.57 | 1.39 |
| H | 住宿和餐饮业 | -- | -- |
| I | 信息技术、软件和信息技术服务业 | 237,549,335.65 | 12.50 |
| J | 金融业 | 40,826,577.00 | 2.15 |
| K | 房地产业 | 91,125,163.50 | 4.80 |
| L | 租赁和商务服务业 | -- | -- |
| M | 科学研究和技术服务业 | -- | -- |
| N | 教育、文化和体育业 | 57,830,159.64 | 3.04 |
| O | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -- | -- |
| P | 金融业 | -- | -- |
| Q | 卫生和社会工作 | 17,366,378.86 | 0.91 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 230,037,006.22 | 12.11 |
| S | 综合 | 32,846,392.02 | 1.73 |
| | 合计 | 1,624,685,754.94 | 83.52 |

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 | 002184 | 海信控制 | 1,773,997 | 76,299,610.97 | 4.02 |
| 2 | 002699 | 英诺文化 | 1,407,050 | 71,900,255.00 | 3.78 |
| 3 | 300336 | 新华文化 | 1,590,148 | 66,786,216.00 | 3.52 |
| 4 | 002239 | 科大讯飞 | 1,499,940 | 55,572,277.00 | 2.93 |
| 5 | 002292 | 亿纬锂能 | 918,649 | 47,503,339.79 | 2.50 |
| 6 | 000681 | 恒晖中国 | 1,099,742 | 41,801,193.42 | 2.20 |
| 7 | 600584 | 长电科技 | 1,879,987 | 41,397,313.74 | 2.18 |
| 8 | 600728 | 佳都软件 | 1,069,821 | 38,983,926.88 | 2.10 |
| 9 | 600651 | 广电网络 | 2,570,000 | 37,907,500.00 | 2.00 |
| 10 | 300049 | 铂信股份 | 1,200,240 | 37,207,440.00 | 1.96 |

4.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 | 140302 | 15国开22 | 200,000 | 20,014,000.00 | 1.05 |
| 2 | 150219 | 15国债19 | 200,000 | 20,014,000.00 | 1.05 |

5.报告期内未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

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

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权证投资明细

8.报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资主体监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

9.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

10.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

12.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

13.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

14.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

15.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

16.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

17.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

18.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

19.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

20.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

21.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

22.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

23.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

24.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

25.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

26.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

27.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

28.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

29.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

30.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

31.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

32.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

33.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

34.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

35.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

36.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

37.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

38.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

39.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

40.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

41.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

42.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

43.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

44.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

45.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

46.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

47.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

48.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

49.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

50.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

51.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

52.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

53.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

54.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

55.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

56.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

57.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

58.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

59.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

60.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

61.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

62.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

63.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

64.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

65.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

66.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

67.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

68.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

69.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

70.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

| 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 | 849,520,662.82 | 44.72 |
| D | 电力、热力、燃气及生产和供应业 | 8,942,400.00 | 0.47 |
| E | 建筑业 | -- | -- |
| F | 批发和零售业 | 32,196,968.96 | 1.69 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 26,444,709.57 | 1.39 |
| H | 住宿和餐饮业 | -- | -- |
| I | 信息技术、软件和信息技术服务业 | 237,549,335.65 | 12.50 |
| J | 金融业 | 40,826,577.00 | 2.15 |
| K | 房地产业 | 91,125,163.50 | 4.80 |
| L | 租赁和商务服务业 | -- | -- |
| M | 科学研究和技术服务业 | -- | -- |
| N | 教育、文化和体育业 | 57,830,159.64 | 3.04 |
| O | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -- | -- |
| P | 金融业 | -- | -- |
| Q | 卫生和社会工作 | 17,366,378.86 | 0.91 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 230,037,006.22 | 12.11 |
| S | 综合 | 32,846,392.02 | 1.73 |
| | 合计 | 1,624,685,754.94 | 83.52 |

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 | 002184 | 海信控制 | 1,773,997 | 76,299,610.97 | 4.02 |
| 2 | 002699 | 英诺文化 | 1,407,050 | 71,900,255.00 | 3.78 |
| 3 | 300336 | 新华文化 | 1,590,148 | 66,786,216.00 | 3.52 |
| 4 | 002239 | 科大讯飞 | 1,499,940 | 55,572,277.00 | 2.93 |
| 5 | 002292 | 亿纬锂能 | 918,649 | 47,503,339.79 | 2.50 |
| 6 | 000681 | 恒晖中国 | 1,099,742 | 41,801,193.42 | 2.20 |
| 7 | 600584 | 长电科技 | 1,879,987 | 41,397,313.74 | 2.18 |
| 8 | 600728 | 佳都软件 | 1,069,821 | 38,983,926.88 | 2.10 |
| 9 | 600651 | 广电网络 | 2,570,000 | 37,907,500.00 | 2.00 |
| 10 | 300049 | 铂信股份 | 1,200,240 | 37,207,440.00 | 1.96 |

4.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 | 140302 | 15国开22 | 200,000 | 20,014,000.00 | 1.05 |
| 2 | 150219 | 15国债19 | 200,000 | 20,014,000.00 | 1.05 |

5.报告期内未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

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

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权证投资明细

8.报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资主体监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

9.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

10.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

12.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

13.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

14.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

15.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

16.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

17.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

18.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

19.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

20.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

21.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

22.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

23.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

24.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

25.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

26.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

27.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

28.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

29.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

30.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

31.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

32.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

33.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

34.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

35.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

36.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

37.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

38.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

39.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

40.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。