

(上接B58版)  
联系人:杨利  
联系电话:010-50938070  
传真:010-50938070  
电子邮箱:yangli@hase.com.cn  
三)律师事务所  
名称:北京市天元律师事务所  
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
法定代表人:李小强  
联系人:杨利  
联系电话:010-57763888  
传真:010-57763777  
经办律师:吴延雄、杨利

四)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号展业楼三层A座  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展业楼三层A座  
联系人:李天  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238880  
联系人:李天  
联系电话:021-23238888  
经办注册会计师:李天、洪磊

五)基金的投资目标  
本基金的投资目标:把握经济发展趋势和市场中蕴涵的机会,以行业投资价值为导向,在充分利用市场资源的基础上,通过精选个股和配置行业资产,实现基金资产的长期增值。

六)基金的投资范围  
本基金的投资范围:具有良好投资价值的股票,包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

七)基金的风险收益特征  
本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中风险较高的品种。

八)基金的投资策略  
本基金资产配置采用“自上而下”的多元分析法和资产配置手段,综合考虑宏观经济、政策形势、证券市场走势的态势分析,动态调整资产配置,进行前瞻性的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整股票、债券和货币市场的资产配置,以最大限度降低投资组合的风险。

九)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十一)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十二)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十三)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十四)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十五)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十六)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十七)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十八)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

十九)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十一)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十二)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十三)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十四)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十五)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十六)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十七)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十八)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

二十九)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十一)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十二)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十三)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十四)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十五)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十六)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十七)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十八)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

三十九)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十一)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十二)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十三)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十四)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十五)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十六)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十七)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

四十八)基金的投资组合报告  
截至本报告期末本基金投资组合符合以下规定:  
1. 权益类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
2. 债券类资产占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。  
3. 货币市场工具占基金资产净值的比例符合基金合同的约定。

### 9. 基金的投资组合报告

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资的业绩比较基准为上证指数。整体业绩比较基准构成: 跟踪收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。未来,如基金变更投资比例范围,或市场出现代表性更强、更能反映本基金投资方向的宽基指数,或指数编制方法变更或停止指数的编制及发布,基金管理人可在履行适当程序后,变更本基金的业绩比较基准及指数。

本基金风险收益高于货币型基金,属于证券投资基金中风险较高的品种。  
本基金投资组合报告  
以下内容摘自本基金2016年第1季度报告:  
5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,867,040,111.07	83.73
2	固定收益投资	199,988,000.00	8.21
3	资产支持证券	109,988,000.00	3.21
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,404,134,903.93	12.97
7	其他各项资产	2,220,487.41	0.09
8	合计	3,423,989,591.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合  
金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	79,877,468.68	2.39
B	采矿业	26,582,155.82	0.80
C	制造业	1,733,925,353.94	51.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,438,371.36	2.41
E	建筑业	101,463,274.02	3.04
F	批发和零售业	93,235,168.23	2.79
G	交通运输、仓储和邮政业	1,920,000.00	0.06
H	住宿和餐饮业	9,998,306.94	0.30
I	信息技术	173,488,102.44	5.19
J	金融业	14,740,988.03	0.44
K	房地产业	17,694,601.36	5.11
L	租赁和商务服务业	119,968,620.25	3.52
M	科学研究和技术服务业	5,960,600.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	86,556,693.38	2.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,330,864.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	23,580,370.82	0.71
S	综合	217,800,000.00	6.07
合计		2,867,040,111.07	88.81

5.3 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  
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300070	碧水源	2,037,462	60,840,643.38	2.38
2	002400	旭辉股份	3,925,790	71,941,957.00	2.13
3	600071	广汇集团	16,452,360	65,013,629.20	2.15
4	300156	神华集团	1,386,903	64,419,442.48	1.92
5	600666	中国铝业	3,149,885	63,942,665.50	1.91
6	600530	大冷股份	3,282,364	59,695,263.76	1.77
7	002701	奥瑞金	2,216,061	54,093,848.40	1.62
8	602517	恒美药业	1,148,123	53,272,307.20	1.59
9	300145	国农科技	1,332,337	52,294,227.35	1.57
10	600337	美克药业	3,949,241	52,090,488.79	1.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,988,000.00	3.29
4	企业债券	109,988,000.00	3.29
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	109,988,000.00	3.29

5.5 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  
金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	160401	16政发01	500,000	50,020,000.00	1.50
2	110220	11国开30	400,000	39,980,000.00	1.20
3	110233	11国开35	200,000	19,988,000.00	0.60
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 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  
金额单位:人民币元

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)	
1	160401	16政发01	500,000	50,020,000.00	1.50
2	110220	11国开30	400,000	39,980,000.00	1.20
3	110233	11国开35	200,000	19,988,000.00	0.60
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.7 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  
金额单位:人民币元

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值	占基金资产净值比例(%)	
1	160401	16政发01	500,000	50,020,000.00	1.50
2	110220	11国开30	400,000	39,980,000.00	1.20
3	110233	11国开35	200,000	19,988,000.00	0.60
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.8 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  
金额单位:人民币元

序号	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)	
1	160401	16政发01	500,000	50,020,000.00	1.50
2	110220	11国开30	400,000	39,980,000.00	1.20
3	110233	11国开35	200,000	19,988,000.00	0.60
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注  
5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 本基金其他资产构成  
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,024,943.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	528,782.48
5	应收申购款	366,662.22
6	其他应收款	6,575.78
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,926,887.41

5.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分由“四、投资组合报告”中的“5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分”予以说明。

5.11.7 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.8 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.9 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.10 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.11 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.12 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.13 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.14 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.15 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.16 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.17 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.18 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.19 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.20 本基金投资的前