

# Disclosure 信息披露

2015年12月12日 星期六

zqsb@stcn.com (0755)83501750

B95

(上接B94版)

| 报告期末按投资行业分类的股票投资组合 |                                |                   |
|--------------------|--------------------------------|-------------------|
| 代码                 | 行业类别                           | 公允价值(元)           |
| A                  | 农、林、牧、渔业                       | -                 |
| B                  | 采矿业                            | -                 |
| C                  | 制造业                            | -                 |
| D                  | 电力、热力、燃气及水生产和供应                | -                 |
| E                  | 建筑业                            | -                 |
| 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                | -                 |
| J                  | 金融业                            | 801,500.00 0.24   |
| K                  | 房地产业                           | -                 |
| L                  | 租赁和商务服务业                       | -                 |
| M                  | 科学研究、技术服务和地质勘查业                | -                 |
| N                  | 环境、休闲娱乐和公共管理、社会保障、组织活动和社会组织服务业 | -                 |
| O                  | 居民服务、修理和其他服务业                  | -                 |
| P                  | 教育                             | -                 |
| Q                  | 卫生和社会工作                        | -                 |
| R                  | 文化、体育和娱乐业                      | -                 |
| S                  | 综合                             | 296,191.71 0.09   |
|                    | 合计                             | 1,097,691.71 0.32 |

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五名股票投资明细

3.4 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权证投资明细

罚款所得2867万元，并处以440万元罚款。

中国平安财产保险股份有限公司的违法行为从多个角度进行了分析，认为其股价已反映相关负面消息，估值合理，情绪和市场反应正常，因此本基金管理人持有的该股票。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，对日常投资决策进行有效监督，不存在违法违规行为。

3.5 余九名证券的发行主体本报告期未被有关监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 496,157.40   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收利息    | 4,098.72     |
| 4  | 应收申购款   | 988,732.91   |
| 5  | 其他应收款   | -            |
| 6  | 坏账准备    | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,488,989.03 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

11.5 报告期末持有的一年内到期的应收票据情况的说明

11.5.1 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.2 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.3 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.4 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.5 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.6 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.7 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.8 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.9 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.10 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.11 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.12 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.13 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.14 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.15 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.16 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.17 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.18 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.19 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.20 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.21 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.22 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.23 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.24 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.25 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.26 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.27 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.28 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.29 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.30 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.31 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.32 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.33 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.34 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.35 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.36 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.37 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.38 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.39 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.40 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.41 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.42 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.43 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.44 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.45 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.46 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.47 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.48 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.49 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.50 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.51 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.52 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.53 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.54 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.55 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.56 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.57 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.58 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.59 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.60 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.61 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.62 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.63 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.64 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.65 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.66 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.67 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.68 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.69 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.70 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.71 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.72 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.73 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.74 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.75 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.76 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.77 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.78 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.79 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.80 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.81 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.82 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.83 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.84 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.85 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.86 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.87 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.88 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.89 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.90 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.91 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.92 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.93 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.94 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.95 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.96 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.97 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.98 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.99 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.100 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.101 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.102 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.103 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.104 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.105 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.106 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.107 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.108 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.109 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.110 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限情况的说明

11.5.111 报告期末应收票据前十名款项存在融资受限