

2013年9月30日 星期一

(上接B025版)

电话: 021 38676161 传真: 021 38670161 联系人: 苏倩琪 客户服务电话: 95521, 400-8888-666 网址: www.gtja.com

09 中国建银投资银行股份有限公司 住所: 北京市朝霞路183号东都广场A座34楼 办公地址: 北京市朝霞路171号东都广场A座34楼

01 广发证券股份有限公司 住所: 广州天河区珠江东路183号广东会堂A座34楼 办公地址: 广州市天河区北路183号东都广场A座36, 38, 41, 42楼

02 交通银行股份有限公司 住所: 上海市浦东新区中山东路100号 办公地址: 上海市浦东新区中山东路100号

(上接B027版)

司进行盈利质量分析, 本基金管理人将采用主观赋权和打分排序的方法, 得到相关股票的综合评分, 选取排名处于前1/2的股票进行盈利增长潜力的深入分析。

图7 盈利质量分析的相关指标框架 指标类别 基本指标 盈利表现 净利润率 净资产收益率 主营业务收入增长率 盈利速度 应收账款周转率 估值合理性 流动性比率 净值比率

图8 股票组合增长精选指标框架 指标类别 基本指标 盈利表现 净利润率 净资产收益率 主营业务收入增长率 盈利速度 应收账款周转率 估值合理性 流动性比率 净值比率

图9 金元惠理宝石动力混合型证券投资基金公司治理分析指标框架 评估指标 财务稳健性 企业治理的纪律性约束 对股东利益的关注 企业战略执行评估 企业的社会责任感 持续创新能力 估值水平

图10 债券组合投资实现方法 宏观环境、投资策略研究 策略调整 基金持仓的构建和动态调整 债券组合的构建 策略实施 风险控制 投资组合调整

图11 债券组合投资实现方法 宏观环境、投资策略研究 策略调整 基金持仓的构建和动态调整 债券组合的构建 策略实施 风险控制 投资组合调整

图12 债券组合投资实现方法 宏观环境、投资策略研究 策略调整 基金持仓的构建和动态调整 债券组合的构建 策略实施 风险控制 投资组合调整

Table with 2 columns: 序号, 项目. Rows include 1. 权益类资产, 2. 固定收益类资产, 3. 其他类资产, 4. 现金类资产, 5. 其他类资产, 6. 其他类资产, 7. 合计

网址: www.lhsc.com.cn 00 中信证券 浙江 证券有限责任公司 住所: 浙江省杭州市中河南路11号凯悦庭商务楼A座 办公地址: 浙江省杭州市中河南路11号凯悦庭商务楼B座 法定代表人: 刘军 电话: 0571 85776115

01 华泰证券股份有限公司 住所: 南京市江东中路222号华泰证券大厦15层 办公地址: 南京市江东中路222号华泰证券大厦15层 法定代表人: 吴志勇 电话: 0531 85022605

02 招商证券股份有限公司 住所: 深圳市福田区福田街道福华一路111号 办公地址: 深圳市福田区福华一路111号 法定代表人: 宫少林 电话: 0755 82943666

03 国泰君安证券股份有限公司 住所: 上海市浦东新区银城中路168号 办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人: 王松华 电话: 021 38888888

2. 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(元) 占基金资产净值比例(%) A 农林牧渔 0.00 0.00 B 采矿业 155,852,776.00 42.87

3. 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 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 002638 鹏上光电 2,219,819 30,655,700.39 8.43

4. 期末按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(元) 占基金资产净值比例(%) 1 国债债券 19,466,800.00 5.36

5. 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券 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 1380120 13国债零二 500,000 503,535,000.00 13.90

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 本报告期末本基金持有资产支持证券 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 本报告期末本基金未持有权证投资

9. 投资组合报告附注 1. 本基金本期投资的前十名证券中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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。 3. 期末其他资产构成 单位: 人民币元

序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59 合计 6,562,080.02

4 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59

网址: www.dhfg.com.cn 03 西南证券股份有限公司 住所: 重庆市江北区江北嘴 办公地址: 重庆市江北区江北嘴8号西南证券大厦 法定代表人: 余维佳 电话: 023 63786141

04 华泰证券股份有限公司 住所: 南京市江东中路222号 办公地址: 南京市江东中路222号 法定代表人: 吴志勇 电话: 0531 85022605

05 招商证券股份有限公司 住所: 深圳市福田区福田街道福华一路111号 办公地址: 深圳市福田区福华一路111号 法定代表人: 宫少林 电话: 0755 82943666

06 国泰君安证券股份有限公司 住所: 上海市浦东新区银城中路168号 办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人: 王松华 电话: 021 38888888

3. 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 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 002638 鹏上光电 2,219,819 30,655,700.39 8.43

4. 期末按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(元) 占基金资产净值比例(%) 1 国债债券 19,466,800.00 5.36

5. 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券 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 1380120 13国债零二 500,000 503,535,000.00 13.90

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 本报告期末本基金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名的前五名权证投资明细 本报告期末本基金未持有权证投资

9. 投资组合报告附注 1. 本基金本期投资的前十名证券中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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。 3. 期末其他资产构成 单位: 人民币元

序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59 合计 6,562,080.02

4 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59

4 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59

01 华泰证券股份有限公司 住所: 南京市江东中路222号 办公地址: 南京市江东中路222号 法定代表人: 吴志勇 电话: 0531 85022605

02 招商证券股份有限公司 住所: 深圳市福田区福田街道福华一路111号 办公地址: 深圳市福田区福华一路111号 法定代表人: 宫少林 电话: 0755 82943666

03 国泰君安证券股份有限公司 住所: 上海市浦东新区银城中路168号 办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人: 王松华 电话: 021 38888888

04 华泰证券股份有限公司 住所: 南京市江东中路222号 办公地址: 南京市江东中路222号 法定代表人: 吴志勇 电话: 0531 85022605

3. 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 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 002638 鹏上光电 2,219,819 30,655,700.39 8.43

4. 期末按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(元) 占基金资产净值比例(%) 1 国债债券 19,466,800.00 5.36

5. 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券 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 1380120 13国债零二 500,000 503,535,000.00 13.90

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 本报告期末本基金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名的前五名权证投资明细 本报告期末本基金未持有权证投资

9. 投资组合报告附注 1. 本基金本期投资的前十名证券中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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。 3. 期末其他资产构成 单位: 人民币元

序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59 合计 6,562,080.02

4 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59

4 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59

01 华泰证券股份有限公司 住所: 南京市江东中路222号 办公地址: 南京市江东中路222号 法定代表人: 吴志勇 电话: 0531 85022605

02 招商证券股份有限公司 住所: 深圳市福田区福田街道福华一路111号 办公地址: 深圳市福田区福华一路111号 法定代表人: 宫少林 电话: 0755 82943666

03 国泰君安证券股份有限公司 住所: 上海市浦东新区银城中路168号 办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人: 王松华 电话: 021 38888888

04 华泰证券股份有限公司 住所: 南京市江东中路222号 办公地址: 南京市江东中路222号 法定代表人: 吴志勇 电话: 0531 85022605

3. 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 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 002638 鹏上光电 2,219,819 30,655,700.39 8.43

4. 期末按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(元) 占基金资产净值比例(%) 1 国债债券 19,466,800.00 5.36

5. 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券 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 1380120 13国债零二 500,000 503,535,000.00 13.90

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 本报告期末本基金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名的前五名权证投资明细 本报告期末本基金未持有权证投资

9. 投资组合报告附注 1. 本基金本期投资的前十名证券中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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。 3. 期末其他资产构成 单位: 人民币元

序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59 合计 6,562,080.02

4 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59

4 本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 161,177.00 2 应收证券利息 3 应收股利 3,828,498.60 4 应收申购款 1,678.92 5 其他应收款 6 应付股利 7 其他 3,991,335.59