

(上接B043版)

网站:www.westsecu.com.cn
(44)华宝证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层
法定代表人:陈林
联系人:宋歌
电话:021-68778908
传真:021-68778108
客户服务电话:4008209898
网站:www.cmbstock.com
(45)建信证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市南京西路758号24楼
法定代表人:宫龙云
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-68723703
客服热线:021-63340678
网站:www.jaizq.com
(46)华福证券有限责任公司
注册(办公)地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
联系人:张捷
电话:0691-87383623
传真:0691-87383610
客户服务电话:96326(福建省外请加拨0591)
网站:www.hfzq.com.cn
(47)信达证券股份有限公司
注册(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:高冠江
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服热线:400-800-8899
网站:www.cindasc.com
(48)东方证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
联系人:王睿
电话:0755-83007069
传真:0755-83007167
客服热线:0755-26982993
网站:www.ydsc.com.cn
(49)宏源证券股份有限公司
注册(办公)地址:新疆乌鲁木齐文艺路233号
法定代表人:冯戎
联系人:李巍
电话:010-88085858
传真:010-88085195
客服热线:400-800-0562
网站:www.hysec.com
(50)华泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
联系人:吴万善
电话:0755-82492193
客户服务电话:95597
网站:www.htsc.com.cn
(51)华龙证券有限责任公司
注册(办公)地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-4890208
客户服务电话:0931-96668、4006898888
网站:www.hlzqgs.com
(52)国金证券股份有限公司
注册(办公)地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:金磊
电话:028-86690126
传真:028-86690126
客户服务电话:4006600109
网站:www.gjzq.com.cn
(53)浙商证券股份有限公司
注册(办公)地址:浙江杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A-6/7楼
法定代表人:吴承根
联系人:许嘉行
客服电话:0571-967777
网站:www.stocke.com.cn
(54)中航证券有限公司
注册(办公)地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
法定代表人:杜航
联系人:戴鑫
联系电话:0791-86769681
客户服务电话:400-8866-567
公司网站:www.avicsec.com
(55)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:胡皓
电话:010-60838888
传真:010-60833739
客服电话:96548
网站:www.cs.citic.com
(56)中国中投证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及04层02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
法定代表人:龙澄荣
联系人:刘殿
联系电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客服电话:400 600 8008
网站:www.china-invsn.cn
(57)长江证券股份有限公司
注册(办公)地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
客户服务电话:95579或4008-888-999
网站:www.95579.com
(58)东莞证券有限责任公司
注册(办公)地址:东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人:张运明
联系人:张巧玲
电话:0769-22116572
传真:0769-22119426
客户服务电话:0769-961130
网站:www.dgzq.com.cn
(59)东方财富证券股份有限公司
法定代表人:潘鑫军
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层
联系人:胡月波
电话:021-63325888
传真:021-63326729
客户服务电话:95503
公司网站:http://www.dfzq.com.cn
(60)齐鲁证券有限公司
注册(办公)地址:济南市经七路66号
法定代表人:李玮
联系人:吴昊
电话:0631-68909155
传真:0631-68889752
客户服务电话:95538
网站:www.qizq.com.cn
(61)国盛证券有限责任公司
注册(办公)地址:南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)
法定代表人:曾小晋
联系人:陈明
电话:0791-86281305
传真:0791-86285337
客户服务电话:400 8222 111
网站:www.gsstock.com
(62)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
办公地址:深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人:张雅维
联系人:牛孟宇
联系电话:0755-83709350
传真:0755-83700205
客户服务电话:95563
公司网站:www.ghzq.com.cn
(63)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
办公地址:青岛市市南区东海西路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0632-85022326
传真:0632-85022605
客户服务电话:95548
网站:www.zitissd.com
(64)西南证券股份有限公司
注册(办公)地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
传真:023-63786212
客服电话:400 809 6096
公司网站:www.swsc.com.cn
(65)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州陵西西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:刘化军
电话:021-20333333
传真:021-50498825
客户服务电话:95548
网站:www.dhsc.com.cn
(66)浙商证券有限责任公司
注册(办公)地址:杭州市上城区钱江路222号浙商证券大厦
法定代表人:陈峰
联系人:董彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
客户服务电话:4006-789-887
金友贵金属网:www.zlfund.com
基金买卖网:www.jimw.com.cn
(67)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦1楼2楼
法定代表人:陈柏青
联系人:周晟昊
电话:0571-28829790、021-60897869
传真:0571-26698533
客户服务电话:4000-766-123
网站:www.fund123.cn
(68)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册(办公)地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋
法定代表人:汪静波
联系人:方成

电话:021-39602377
传真:021-39505777
客户服务电话:400-821-5399
网站:www.noah-fund.com
(69)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号裕景国际B座16层
法定代表人:张庆伟
联系人:袁岭
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.eichfund.com
(70)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区吴淞路685弄37号4号楼4494
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-58870011
传真:021-68596916
客户服务电话:400 700 9665
网站:www.ehowbuy.com
(71)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:宋丽甫
电话:010-62020088
传真:010-62020356
客户服务电话:400-888-8881
网站:www.myfund.com
(72)和讯信息科技有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区外大街22号泛利大厦10层
北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:习娟
联系电话:010-85650920
传真号码:010-85657357
全国统一客服热线:400-920-0022/ 021-20835588
公司网址:licaike.hexun.com
(73)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号东方财富大厦2楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:潘世华
电话:021-64500888
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
网址:http://www.1234567.com.cn
(74)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:吴昊
联系电话:0571-88911818-8565
传真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772 0571-88920897
网站:www.5ifund.com
(75)万银财富(北京)基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:高晓芳
电话:010-59393923
传真:010-59393074
客户服务电话:400-808-0069
网站:www.wy-fund.com
(76)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京SOHO塔808号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室
法定代表人:沈伟伟
联系人:程刚
电话:010-85892781
传真:010-57961601
客户服务电话:400-809-9500
网站:www.yixinfund.com
(77)北京同创基金销售有限公司
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:罗细安
联系人:孙晋峰
电话:010-67000888
传真:010-67000889-6000
客户服务电话:400-001-8811
网站:www.zccvc.com.cn
(78)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册(办公)地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场15楼
法定代表人:林松
联系人:袁艳艳
电话:0592-3122703
传真:0592-9600771
客户服务电话:400-6980-777
网站:www.dkhs.com.cn
(79)北京展晟天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人:蒋辉
联系人:徐长臣、林凌
电话:010-58170943、010-58170918
传真:010-58170800
客户服务电话:400-818-8866
网站:www.shengshiview.com
(80)嘉实财富管理有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期4606-10单元
法定代表人:赵学军
联系人:刘捷
电话:021-20289890
传真:010-85097308
客户服务电话:400-021-8850
网站:www.harvestwm.cn
(81)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人:陈操
联系人:刘亚文
电话:010-58325395
传真:010-58325282
客户服务电话:400-850-7771
网站:https://t.jrj.com
(82)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区阜成门内大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪涛
联系人:殷嘉璐
电话:010-88312877
传真:010-88312885
客户服务电话:400-001-1566
网站:www.yilucaifu.com
(83)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座22层
法定代表人:梁越
联系人:陈攀
电话:010-5776019
传真:010-57761190
客户服务电话:400-786-8968-5
网站:www.chtfund.com
(84)北京钱景财富投资管理有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:陈华
电话:010-57411829
传真:010-57696771
客户服务电话:400-678-5095
网站:www.niuji.net
(85)深圳开元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
办公地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
法定代表人:曾革
联系人:廖莎莎
电话:0755-33376853
传真:0755-33065516
客户服务电话:4006-877-899
网站:www.tenyuanfund.com
(86)北京创金启富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁睿
联系人:张磊磊
电话:010-66154828
传真:010-88067526
客户服务电话:010-88067525
网站:www.5icnh.com
(87)北京诺亚财富投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路100号202室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A303
法定代表人:王岩
联系人:胡明会
电话:010-59200855
传真:010-59200800
客户服务电话:400-819-9868
网站:www.noahfund.com
基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时进行公告义务。

二、注册登记人
名 称:景顺长城基金管理有限公司
住 所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人:赵如旭
电 话:0755-82270388-1668
传 真:0755-22281325
联系人:杨敏
三、律师事务所及经办律师
名 称:北京金诚同达律师事务所
住 所:北京建国门内大街22号华夏银行11层
负责人:田子
电 话:010-85237766
传 真:010-616185057
经办律师:贺宝强、涂志浩
四、会计师事务所及经办注册会计师
法定名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:单峰、陈嘉

四、基金名称
景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金。

五、基金的类型
契约型开放式。

六、基金的投资目标
本基金通过投资于成长型于内需拉动型行业中的优势企业,分享中国经济和行业的快速增长带来的最大收益,实现基金资产的长期、可持续的稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。
在资产配置方面,投资于股票的最大比例和最小比例分别是95%和70%,投资于债券的最大比例是30%。

本基金优先投资于和经济增长最为密切的内需拉动型行业中的优势企业,对这些行业的投资占股票投资的比例不低于80%。

八、基金的投资策略
1、股票投资策略
在构建和管理投资组合的过程中,主要采取“自上而下”为主的投资方法,着重在内需拉动型行业内选择基本面良好的优势企业或估值偏低的股票。基于对宏观经济运行状况及政策分析、金融货币运行状况及政策分析、产业运行景气状况及政策的分析,对行业偏好进行修正,进而结合证券市场状况及政策分析,做出资产配置及组合构建的决定。
股票投资部分以“内需拉动型”行业的优势企业为主,以成长、价值及稳定收入为基础,在合适的价位买入具有成长性的成长型股票,价值被市场低估的价值型股票,以及能提供稳定收入的收益型股票。

2、债券投资策略
本基金在债券投资中着重本金安全性和流动性。综合分析宏观经济形势,并对货币政策与财政政策以及社会政治状况等进行研究,着重利率的变化趋势预测,建立对收益率曲线变动的预期模型。通过该模型进行估值分析,确定价格中板的变动趋势;同时,计算债券投资组合久期、到期收益率和期限等指标,进行“自下而上”的债券和债券品种配置。
3、权证投资策略
本公司将在有效进行风险管理的前提下,通过对权证证券的基本面研究,并结合期权定价模型估计权证价值,谨慎进行投资。

本基金除权证以外的其他证券资产净值占3%。
本基金将持续地进行定期与不定期的投资组合回顾与风险监控,适时地做出相应的调整。

九、基金的业绩比较基准
基金整体业绩比较基准=沪深综合指数总市值加权指数×80%+中国债券总指数×20%。

使用上述业绩比较基准的主要理由为:
1、市场代表性
上证综指综合指数分别反映上海/深圳证券交易所全部上市股票价格变动的总股本加权指数,以两者按照总市值权重加权形成的沪深综合指数总市值加权指数可以完整地反映国内全部上市股票价格变动情况,具有很好的市场代表性。
2、复合基准构建的公允性
本基金是一只持股股票的基金,股票投资比例范围为基金资产的70%-95%,其中市场中性的股票仓位为80%。本基金股票和债券投资的比较基准分别使用具有充分市场认同度的沪深综合指数和总市值加权指数和中国债券总指数,股票和债券投资的比较基准在基金业绩比较基准中,反映市场中性时两类资产的投资比例确定,可以比较充分地反映基金管理人的投资管理能力。
如果本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,本基金的管理人可以在报中国证监会备案后,使用其他可以合理的作为业绩比较基准的指数代替原有指数。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征
本基金是风险程度较高的投资品种。
各类别风险定义:
1、投资组合风险
在基金日常管理风险过程中,由投资组合对投资组合风险进行监控和管理。此类风险主要包括以下几种:
(1)系统性风险:基金在投资中因市场原因而无法规避的风险;
(2)行业配置风险:基金中某行业投资比例出现与基准的较大偏差而可能产生的风险;

(3)证券选择风险:基金中某只股票的持仓比例出现与基准的较大偏差而可能产生的风险;
(4)风格风险:基金在投资风格上与基准之间产生偏差,偏离于某种风格而产生的风险。
2、个股风险
在基金日常管理风险过程中,由投资组合对个股风险进行监控和管理。此类风险主要包括以下几种:
(1)财务风险:基金在投资过程中,由于对上市公司基本面特别是财务状况判断出现失误,造成基金资产净值受损的风险;
(2)流动性风险:基金资产不能迅速、低成本地转变成现金,或者不能应付可能出现地投资者大额赎回的风险;
(3)价格风险:在一定时期期限内,当基金中某只证券的二级市场股票价格波动幅度超出一定比例。

3、衍生工具风险
在基金日常管理风险过程中,由投资组合对个股风险进行监控和管理。目前,此类风险主要指由权证投资引发的风险。
4、作业执行风险
在基金日常管理风险过程中,由运营部及法律、监察稽核部对作业风险进行实时预警与监控。此类风险主要包括基金在日常操作中可能出现违反法规或公司相关管理制度,或者交易执行中的操作失误以及信息系統故障产生的风险。
十一、基金投资组合报告(未经审计)
景顺长城基金管理有限公司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。
基金托管人中国工商银行根据基金合同规定,已经复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。财务数据截至2014年9月30日,本报告中所有财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,258,513,484.18	90.79
	其中:股票	7,258,513,484.18	90.79
2	固定收益投资	136,552,061.20	1.71
	其中:债券	136,552,061.20	1.71
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	158,410,811.21	1.98
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	341,839,379.64	4.28
7	其他资产	99,759,369.99	1.25
8	合计	7,995,075,106.22	100.00

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	6,745.23	0.00
C	制造业	6,501,130,744.55	82.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	信息技术、软件和信息技术服务业	7,190,188.88	0.09
J	金融业	399,852,941.41	5.06
K	房地产业	228,753,976.35	2.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	121,578,887.76	1.54
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,258,513,484.18	91.82

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	002594	比亚迪	12,153,207	593,441,097.81	7.51
2	300124	汇川技术	14,825,129	446,088,131.61	5.64
3	600525	长园集团	23,109,022	312,433,977.44	3.95
4	600609	汾阳润达	11,887,824	299,573,164.80	3.79
5	002048	宁波华翔	16,999,745	293,415,598.70	3.71
6	000895	双汇发展	8,044,060	269,958,653.60	3.42
7	000538	云南白药	5,100,073	261,480,742.71	3.31
8	002460	赣锋锂业	12,429,732	245,611,504.32	3.11
9	002249	大洋电机	16,681,765	236,046,974.75	2.99
10	300001	特锐德	11,062,274	232,750,244.96	2.94

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,267,000.00	1.65
	其中:政策性金融债	130,267,000.00	1.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,285,061.20	0.08
8	其他	-	-
9	合计	136,552,061.20	1.73

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	140404	14农发04	500,000	50,125,000.00	0.63
2	140429	14农发29	500,000	50,115,000.00	0.63
3	140317	14鲁证17	300,000	30,027,000.00	0.38
4	113003	重工转债	45,930	6,285,061.20	0.08

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
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
本基金本报告期末未持有权证。
8. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10. 本期国债期货投资政策
根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
10.4 投资衍生品报告附注
11
11.1 江西赣锋锂业股份有限公司(下称“赣锋锂业”,股票代码:002460)于2014年8月29日收到江西证监局《关于对江西赣锋锂业股份有限公司及相关当事人采取出具警示函措施的决定》,因其在信息披露和内外部信息知情人登记方面违反了相关法律法规,江西证监局对其及相关当事人采取出具警示函的监管措施。
本基金研究人员从公开渠道获悉,该公告收到警示函,主要源于该公告管理层的内幕信息知情人的信息披露上存在未及时向公司未公开信息知情人公告及披露人公告披露内幕信息,确实在信息披露方面存在问题。但本基金对赣锋锂业的投资主要是基于赣锋锂业汽车发展稳健需求的长期资产的投资及与公司的收购并无关联,且事先也并不知晓该并购事项。而且该公告收到警示函后经过了一系列整改,有利于完善其信息披露制度及其长期发展。该公司在锂产业的布局及其生产能力使其保持在未来锂电池发展中的竞争力。
本基金依据相关法律法规及公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对赣锋锂业进行了投资。

12
12.1 基金九名证券的发行主体本报告期内没有被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。
12.2 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。
12.3 其他资产构成

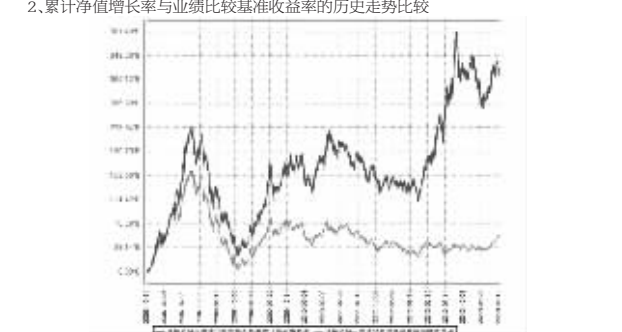
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,545,039.50
2	应收证券清算款	92,119,789.99
3	应收股利	-
4	应收利息	3,604,728.30
5	应收申购款	2,489,812.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,759,369.99

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112003	重工转债	6,285,061.20	0.08

11.5 报告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。

十二、基金的业绩
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2014年9月30日。
1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2006年10月11日至2006年12月31日	41.20%	1.14%	34.32%	1.07%	6.88%	0.07%
2007年	114.59%	2.10%	79.80%	1.76%	34.79%	0.34%
2008年	-54.92%	2.18%	-54.74%	2.28%	-0.18%	-0.10%
2009年	99.63%	1.85%	64.78%	1.53%	34.85%	0.32%
2010年	10.84%	1.56%	-7.69%	1.15%	18.53%	0.41%
2011年	-19.47%	1.13%	-18.76%	0.96%	-0.71%	0.17%
2012年	1.24%	1.21%	3.07%	0.92%	-1.83%	0.29%
2013年	69.14%	1.87%	-1.04%	0.94%	70.18%	0.93%
2014年1月1日至2014年6月30日	-5.69%	1.27%	0.10%	0.75%	-5.79%	0.52%
2014年1月1日至2014年9月30日	1.76%	1.22%	13.94%	0.72%	-12.18%	0.50%
2006年10月11日至2014年9月30日	324.15%	1.70%	56.96%	1.39%	267.19%	0.31%



注:本基金的资产配置比例为:投资于股票的最大比例和最小比例分别是95%和70%,投资于债券的最大比例是