

(上接B009版)

本基金的衍生品投资严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

6. 风险管理

本基金将根据境外风险管理的成功经验如Barra多因子模型、风险预算模型等,结合公司现有的风险管理经验,设计优化的风控策略,通过监控和投资风险管理小组进行监控,在行业配置策略的风险控制上,由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控;在行业配置策略的风险控制上,投资流程及风险管理对行业的风险进行监控及风险预警,同时投资流程及风险管理也将严控本基金的投资风险,在充分考虑投资的性价比及选择策略的风险控制上,本基金将严格遵守公司的内部规定,并结合公司现有的风险管理经验,设计优化的风控策略。

7. 基金的基本业绩比较基准

沪深300指数\*95%+上证国债指数\*5%。

如果其中指数有限公司变更或停止沪深300指数或上证国债指数的编制及发布,或沪深300指数停止上证国债指数由其他指数替代,或指数编制方法发生重大变化,基金管理人将根据实际情况,对本基金的业绩比较基准进行调整,并报中国证监会备案。

8. 其他的风险特征

本基金属于股票型基金,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于高风险、高预期收益的品种。

9. 基金的投资组合报告

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,并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

10. 基金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,并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

11. 其他需要说明的事项

本基金合同公告的所载数据截至2014年9月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

12. 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,573,646,308.31 83.83

2 固定收益投资 1,573,646,308.31 83.83

3 贵金属投资 99,977,000.00 5.56

4 其他投资 99,977,000.00 5.56

5 买入返售金融资产

6 银行存款和结算备付金合计 200,119,339.32 10.66

7 其他资产 3,512,174.24 0.19

8 合计 1,877,254,821.87 100.00

13. 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 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 500,000.00 2.78

2 行业票据 -

3 金融债券 99,977,000.00 5.56

4 其中:政策性金融债 99,977,000.00 5.56

5 企业债券 -

6 债券回购 -

7 可转债 -

8 其他 -

9 合计 99,977,000.00 5.56

14. 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

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金条 -

2 金条 -

3 金条 -

4 金条 -

5 金条 -

6 金条 -

7 金条 -

8 其他 -

9 合计 3,512,174.24

15. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

16. 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

报告期末,本基金未持有权证投资。

17. 其他资产

18. 其他负债

19. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况说明

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

20. 其他

21. 基金管理人对本基金定期报告的投资组合报告的说明

基金管理人依照有关法律法规及基金合同的规定,通过科学严谨的研究方法,对本基金定期报告的投资组合报告进行分析,在报告中披露基金资产配置比例、基金投资组合情况、基金投资策略、基金业绩表现等信息。

22. 基金的业绩

基金管理人依照有关法律法规及基金合同的规定,通过科学严谨的研究方法,对本基金定期报告的基金业绩进行评价。

23. 其他需要说明的事项

1. 投资者在在荷兰办理上述基金投资业务,具体办理规则及程序请遵循新荷兰的规定。

2. 投资者不了解上述基金的详细情况,请仔细阅读刊登于本公司网站(www.99fund.com)的基金合同、《招募说明书》及法律文件,以及相关业务公告。

3. 其他重要提示

1. 投资者在在荷兰办理上述基金投资业务,具体办理规则及程序请遵循新荷兰的规定。

2. 投资者通过以途径咨询有关详情

3. 投资者通过以途径咨询有关详情

4. 投资者通过以途径咨询有关详情

5. 其他重要提示

1. 投资者在与中国工商银行的定期定投业务的每期最低扣款金额为人民币100元人民币/含定投申购费用)。

2. 投资者应充分了解基金定期定投投资存续等储蓄方式的区别。定期定投投资是引导投资者长期投资,平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定投并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资者获得收益,也不是替代储蓄的等效理财。

3. 其他重要提示

1. 投资者在与中国工商银行的定期定投业务的每期最低扣