

(上接D000版)

本基金的衍生品投资将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,力争为基金份额持有人获取超额收益。投资期间为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值增值锁定收益。

6. 风险管理措施

(1) 本基金将严格按照中国证监会颁布的《证券投资基金风险管理指引》及《证券投资基金流动性风险管理指引》等,并综合公司现有的风险管理措施,在各个投资环节中采取识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。

(2) 本基金在投资管理中,更重视投资组合的风险控制,由投资决策委员会负责宏观策略的制定,并在行业配置策略的指导下,投资决策委员会与风险管理部对行业配置的偏离度进行监控并及时调整,同时投资流程与风险管理部也将严格控制本基金的投资风险和合规风险。在资产配置策略的风险控制上,本基金将严格遵守公司的内部风险控制制度,控制每一个投资组合风险。

9. 基金业绩比较基准

沪深300指数\*95%+上证国债指数\*5%。

如果中证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指数或上证国债指数由其他指数替代,或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数,或市场有其他更具代表性、更切合投资策略的指数推出时,本基金管理人可以依据审慎原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,变更本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,风险与预期收益高于混合基金、债券基金及货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的品种。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2014年9月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

本投资组合报告所载数据截至2014年9月30日(“报告期末”),本报告所载财务数据未经审计。

1、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
其中:股票	1,573,646,308.31	83.83	
2	固定收益投资	99,977,000.00	5.33
其中:债券	99,977,000.00	5.33	
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
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	200,119,339.32	10.66
7	其他资产	3,512,241.84	0.19
8	合计	1,877,254,821.27	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	33,095,280.00	1.87
B	制造业	64,231,083.03	3.53
C	建筑业	798,922,306.10	44.41
D	电力、热力、燃气及生产供应	24,392,127.00	1.36
E	建筑业	116,150,387.84	6.32
F	批发和零售业	173,104,071.76	9.63
G	交通运输、仓储和邮政业	23,969,504.62	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	98,637,849.13	5.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	59,959,145.42	3.36
L	租赁和商务服务业	130,533,529.47	7.23
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	建筑业、制造业和其他服务业	-	-
P	建筑业、制造业和其他服务业	-	-
Q	建筑业、制造业和其他服务业	-	-
R	建筑业、制造业和其他服务业	-	-
S	综合	-	-
合计		1,573,646,308.31	87.48

代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	000028	2,098,342	108,484,281.40	6.03
2	002020	9,911,371	106,085,613.60	5.90
3	002681	6,325,809	99,287,114.68	5.53
4	000887	3,630,842	94,038,267.80	5.23
5	000265	6,846,534	92,802,958.80	5.21
6	002420	3,563,432	89,584,680.48	4.98
7	002104	5,870,414	85,121,003.40	4.73
8	002049	9,949,416	68,957,119.00	3.83
9	000963	1,680,297	64,790,730.30	3.60
10	600104	1,919,010	62,534,073.44	3.48

代码	债券名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	99,977,000.00	5.36
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
合计		99,977,000.00	5.36

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	140437	14债037	300,000	49,340,000.00	2.78
2	140317	14中017	200,000	30,207,000.00	1.67
3	130243	13中043	200,000	20,011,000.00	1.11

注:报告期末,本基金仅持有上述3只债券。

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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

报告期末,本基金基金资产组合中不存在股指期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与股指期货交易。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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标准差③	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额④=①-③	⑤-④	⑥-④
自基金合同生效起至2010年6月30日止期间(2010年6月30日至2011年12月31日)	18.40%	1.12%	13.38%	1.51%	5.02%	-0.39%
2011年	-22.03%	1.15%	-23.70%	1.23%	1.67%	-0.08%
2012年	3.57%	1.12%	7.44%	1.22%	-3.87%	-0.10%
2013年	24.35%	1.27%	-7.08%	1.32%	31.43%	+0.06%
2014年	-7.45%	1.24%	-6.62%	0.99%	-0.83%	0.25%
2014年7月1日至2014年9月30日	7.28%	1.13%	5.12%	0.94%	2.16%	0.19%

②自基金合同生效以来,本基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动比较

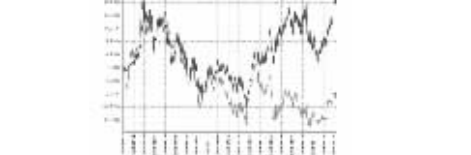


图:净值化优势股票累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年6月27日至2014年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十四)(二)投资组合和(七)2.基金资产配置比例限制的有关约定。

(一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费

2. 基金托管人的托管费

3. 基金销售服务费

4. 基金赎回费

5. 基金转换费

6. 基金申购费

7. 基金赎回费

8. 基金转换费

9. 基金申购费

10. 基金赎回费

11. 基金转换费

12. 基金申购费

13. 基金赎回费

14. 基金转换费

15. 基金申购费

16. 基金赎回费

17. 基金转换费

18. 基金申购费

19. 基金赎回费

20. 基金转换费

21. 基金申购费

22. 基金赎回费

23. 基金转换费

24. 基金申购费

25. 基金赎回费

26. 基金转换费

27. 基金申购费

28. 基金赎回费

29. 基金转换费

30. 基金申购费

31. 基金赎回费

32. 基金转换费

33. 基金申购费

34. 基金赎回费

35. 基金转换费

36. 基金申购费

37. 基金赎回费

38. 基金转换费

39. 基金申购费

40. 基金赎回费

41. 基金转换费

42. 基金申购费

43. 基金赎回费

44. 基金转换费

45. 基金申购费

46. 基金赎回费

47. 基金转换费

48. 基金申购费

49. 基金赎回费

50. 基金转换费

51. 基金申购费

52. 基金赎回费

53. 基金转换费

54. 基金申购费

55. 基金赎回费

56. 基金转换费

57. 基金申购费

58. 基金赎回费

59. 基金转换费

60. 基金申购费

61. 基金赎回费

62. 基金转换费

63. 基金申购费

64. 基金赎回费

65. 基金转换费

66. 基金申购费

67. 基金赎回费

68. 基金转换费

69. 基金申购费

70. 基金赎回费

71. 基金转换费

72. 基金申购费

73. 基金赎回费

74. 基金转换费

75. 基金申购费

76. 基金赎回费

77. 基金转换费

78. 基金申购费

79. 基金赎回费

80. 基金转换费

81. 基金申购费

82. 基金赎回费

83. 基金转换费

84. 基金申购费

85. 基金赎回费

86. 基金转换费

87. 基金申购费

88. 基金赎回费

89. 基金转换费

90. 基金申购费

91. 基金赎回费

92. 基金转换费

93. 基金申购费

94. 基金赎回费

95. 基金转换费

96. 基金申购费

97. 基金赎回费

98. 基金转换费

99. 基金申购费

100. 基金赎回费

(二) 基金费用的计提、计提方式和计提标准

1. 基金管理人的管理费

2. 基金托管人的托管费

3. 基金销售服务费

4. 基金赎回费

5. 基金转换费

6. 基金申购费

7. 基金赎回费

8. 基金转换费

9. 基金申购费

10. 基金赎回费

11. 基金转换费

12. 基金申购费

13. 基金赎回费

14. 基金转换费

15. 基金申购费

16. 基金赎回费

17. 基金转换费

18. 基金申购费

19. 基金赎回费

20. 基金转换费

21. 基金申购费

22. 基金赎回费

23. 基金转换费

24. 基金申购费

25. 基金赎回费

26. 基金转换费

27. 基金申购费

28. 基金赎回费

29. 基金转换费

30. 基金申购费

31. 基金赎回费

32. 基金转换费

33. 基金申购费

34. 基金赎回费

35. 基金转换费

36. 基金申购费

37. 基金赎回费

38. 基金转换费

39. 基金申购费

40. 基金赎回费

41. 基金转换费

42. 基金申购费

43. 基金赎回费

44. 基金转换费

45. 基金申购费

46. 基金赎回费

47. 基金转换费

48. 基金申购费

49. 基金赎回费

50. 基金转换费

51. 基金申购费

52. 基金赎回费

53. 基金转换费

54. 基金申购费

55. 基金赎回费

56. 基金转换费

57. 基金申购费

58. 基金赎回费

59. 基金转换费

60. 基金申购费

61. 基金赎回费

62. 基金转换费

63. 基金申购费

64. 基金赎回费

65. 基金转换费

66. 基金申购费

67. 基金赎回费

68. 基金转换费

69. 基金申购费

70. 基金赎回费

71. 基金转换费

72. 基金申购费

73. 基金赎回费

74. 基金转换费

75. 基金申购费

76. 基金赎回费

77. 基金转换费

78. 基金申购费

79. 基金赎回费

80. 基金转换费

81. 基金申购费

82. 基金赎回费

83. 基金转换费

84. 基金申购费

85. 基金赎回