

(上接B041版)
1、不谋求对上市公司的控股,不参与上市公司的经营管理;
2、有利于基金财产的安全与增值;
3、独立行使股东权利,保护基金投资者的利益;
4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会,行使股东权利,履行股东义务。

(六) 基金的投资组合报告
本基金组合报告所载数据截至2014年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	3,031,875,459.13	89.71
其中:股票		3,031,875,459.13	89.71
2 固定收益投资		-	-
3 其中:债券		-	-
货币市场工具		-	-
4 货币市场投资		-	-
5 买断式证券交易		-	-
6 银行存款和结算备付金合计		322,324,821.60	9.54
7 其他资产		25,310,799.08	0.75
8 合计		3,379,911,079.81	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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		66,740,130.00	2.00
C 制造业		677,289,740.96	20.29
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		83,770.89	0.00
E 建筑业		29,890,656.64	0.87
F 批发和零售业		64,517,096.85	1.93
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		1,402,344,201.99	42.00
J 金融业		-	-
K 劳务业		12,790,000.00	0.38
L 租赁和商务服务业		512,263,010.32	15.34
M 科学研究和技术服务业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		153,662,066.48	4.60
O 居民服务、修理和其他服务业		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生和社会工作		113,104,785.00	3.39
R 文化、体育和娱乐业		-	-
S 综合		-	-
合计		3,031,875,459.13	90.81

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十名股票投资明细

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值(%)
1	300058	蓝色光标	10,241,887	246,829,476.70	7.39
2	002400	省广股份	9,300,268	233,827,656.64	7.00
3	300315	掌趣科技	116,643,903	225,939,294.21	6.77
4	600846	金证股份	4,702,450	193,882,031.50	5.81
5	002065	东华软件	5,756,952	162,197,866.32	4.86
6	300070	碧水源	5,002,284	151,399,733.84	4.53
7	002421	达实智能	4,499,918	142,644,230.60	4.27
8	300010	立思辰	4,793,003	135,179,604.60	4.05
9	300287	飞利信	4,200,004	133,518,271.16	4.00
10	300244	通安股份	2,600,110	113,104,785.00	3.39

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本期未持有债券投资。

5. 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债券投资明细

本基金本期公允价值未持有债券投资。

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

本基金本期报告期末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序的前五名贵金属投资明细

本基金本期报告期末未持有贵金属。

8. 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

本基金本期报告期末未持有权证。

9. 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金融衍生品投资明细

本基金本期报告期末未持有金融衍生品。

10. 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型基金投资明细

本基金本期报告期末未持有股票型基金。

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金于2014年7月29日发布公告:公司在2014年4月内部自查过程中,发现公司于2008-2013年度存在部分关联方及关联交易信息披露的情况,并于2014年4月30日向上交所做出汇报。2014年5月8日收到上交所关于规范关联交易问题的口头答复。

本公司管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为该处罚不会

对公司的投资价值构成实质性影响,因此本公司管理人对上述股票的投资判断未发生变化。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体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。

2. 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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,048,998.13
2	应收证券清算款	23,424,733.36
3	应收利息	-
4	应收股息	72,461.07
5	应收申购款	764,606.32
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	25,310,799.08

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资人向提交申购申请时须按销售机构规定的方式足额申购资金,投资人向提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效而不予确认。

2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人向交易所的交易时间后收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日,并以T+1日对该交易的有效性进行确认。T日提交的申请有效,投资人可在T+2日到直销柜台进行交款或赎回机构查询确认的情况。

3. 申购和赎回款项的支付

申购采用全额付款方式,若申购资金在规定时间内未全部到账则申购不成功。

若申购成功或无误,基金管理人或代理人将投资人所缴付的申购款项划入基金管理人的银行账户。

投资人赎回成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。

在发生巨额赎回时,赎回款项的支付办法按基金合同有关约定处理。

4. (1) 报告期尚未持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限情况。

5. 投资者持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

6. 投资组合报告附注

(1) 本基金的运作情况正常,未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

(2) 本基金的财务状况正常,不存在影响基金财产安全的重大风险隐患。

(3) 本基金无重大关联交易。

(4) 本基金无未披露的关联交易。

(5) 本基金无内幕交易行为。

(6) 本基金无操纵市场行为。

(7) 本基金无重大关联交易。

(8) 本基金无未报告的重大关联交易。

(9) 本基金无未报告的重大关联交易。

(10) 本基金无未报告的重大关联交易。

(11) 本基金无未报告的重大关联交易。

(12) 本基金无未报告的重大关联交易。

(13) 本基金无未报告的重大关联交易。

(14) 本基金无未报告的重大关联交易。

(15) 本基金无未报告的重大关联交易。

(16) 本基金无未报告的重大关联交易。

(17) 本基金无未报告的重大关联交易。

(18) 本基金无未报告的重大关联交易。

(19) 本基金无未报告的重大关联交易。

(20) 本基金无未报告的重大关联交易。

(21) 本基金无未报告的重大关联交易。

(22) 本基金无未报告的重大关联交易。

(23) 本基金无未报告的重大关联交易。

(24) 本基金无未报告的重大关联交易。

(25) 本基金无未报告的重大关联交易。

(26) 本基金无未报告的重大关联交易。

(27) 本基金无未报告的重大关联交易。

(28) 本基金无未报告的重大关联交易。

(29) 本基金无未报告的重大关联交易。

(30) 本基金无未报告的重大关联交易。

(31) 本基金无未报告的重大关联交易。

(32) 本基金无未报告的重大关联交易。

(33) 本基金无未报告的重大关联交易。

(34) 本基金无未报告的重大关联交易。

(35) 本基金无未报告的重大关联交易。

(36) 本基金无未报告的重大关联交易。

(37) 本基金无未报告的重大关联交易。

(38) 本基金无未报告的重大关联交易。

(39) 本基金无未报告的重大关联交易。

(40) 本基金无未报告的重大关联交易。

(41) 本基金无未报告的重大关联交易。

(42) 本基金无未报告的重大关联交易。

(43) 本基金无未报告的重大关联交易。

(44) 本基金无未报告的重大关联交易。