

(上接B34版)

(7) 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1004F
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院4号楼力合大厦20层
法定代表人:陈操
联系人:宋文文
电话:(010)-82832395
传真:(010)-82832382
客户服务电话:400-800-9771
网站:https://rjyy.com

(72) 博时基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区广安门内大街2号富力城R公馆C202
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴昊
联系人:宋乐群
电话:(010)-88312877
传真:(010)-88312885
客户服务电话:400-610-0566
网站:www.bosfunds.com

基金管理人应根据《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,并及时履行公告义务。

二、注册登记机构
名称:鹏华基金管理有限公司
住所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一层第二单元
法定代表人:赵强
电话:(0755)-82031888-1668
传真:(0755)-22813258
联系人:孙威

三、律师事务所及经办律师
名称:上海市锦天城律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼
办公地址:上海市锦州路68号时代金融中心9楼
负责人:朱建宁
电话:(021)-31886666
传真:(021)-31886600
经办律师:吕建、安雯
联系人:安雯

四、会计师事务所及经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京朝阳区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
法定代表人:葛明华
电话:(010)58153000,(0755)25020888
传真:(010)58151888
联系人:肖奇、马卓懿

四、**基金的名称**
鹏华长城核心竞争力股票型证券投资基金

五、**基金的投资目标**
本基金通过投资于具有投资价值的高质量企业,分享在中国经济持续增长的大背景下中国股市的长期资本增值机会。

六、**基金的投资方向**
本基金投资范围包括依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市发行的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金管理人将根据市场变化和基金合同约定,在履行适当程序后,可以适度调整基金投资范围。

本基金将投资资产的60%-95%投资于股票等权益资产(其中,权证投资不超过基金资产净值的3%),将基金资产的3%-4%投资于债券和现金类固定收益类品种(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%)。本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。

七、**基金业绩比较基准**
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

八、**基金的投资策略**
(一)资产配置
基金管理人将根据定期公布的经济数据和宏观经济以及投资组合内主要行业、股市行情、市场情绪的综合分析,运用宏观经济模型(MEAM)模型对宏观经济进行评价,结合基金合同、投资策略的要求制定资产配置策略,投资决策委员会审核后形成资产配置方案。

(二)股票投资策略
本基金将采取自下而上的个股投资策略,利用公司股票研究数据库(SRD)对企业进行深入研究分析,并进一步挖掘具有超预期核心竞争力的个股,最后从财务指标筛选核心竞争力个股股票。

1. 东方国信研究数据库(SRD)
本基金利用研究数据库“股票研究数据库(SRD)”中的标准分析框架对上市公司的品质和估值水平进行鉴别,制定股票买入名单,并重点关注:

(1)业务价值(Franchise Value)
寻找拥有高人一等的上市公司,其一般具有以下一种或多种特征:产品定价能力、创新能力、资金实力、优势品牌、健全的销售网络和售后服务、规模化经济等,能够持续利用其独特性的成长性,经济衰退时仍能度过难关,享有高于市场平均水平的盈利能力,从而创造高业务价值,达成长期业绩目标。

(2)估值水平(Value)
对成长性、收益三大因素按设定不同的估值标准。
估值标准(1):用美国成长型上市公司估值水平的主要指标PEG,即市盈率除以盈利增长率,为了使投资人能够达到预期目标,我们选择对估值标准设定价格与其预期增长率适度匹配的原则。
估值标准(2):分散型企业在估值的基础上将公司的净资产收益率与其资本成本进行比较,我们在挑选价值型股票时,会根据公司的净资产收益率与资本成本的相对水平判断公司的合理价值,然后选出股价相对于合理价值存在折扣的股票。

估值标准(3):是依靠分红取得投资收益的股票,我们挑选收益型股票,要求其保持持续股息的政策,以及较高的股息率水平。

(3)管理能力(Management)
公司管理团队的管理经验以及管理班子的构成、学历、经验等,了解其管理能力以及是否诚信。

(4)现金流与分红政策(Cash Generation Capability)
注重企业创造现金流量的能力以及稳定透明的分红派息政策。

2.2 核心竞争力分析
在“理解长城策略数据库”筛选出来的买入名单的基础上,本基金将优先投资于“核心竞争力”较强的公司。本基金认为,所谓“核心竞争力”是指在经营与管理、产品和技术与生产等方面内存在长期动力,且具备其中一方面或多个方面的突出优势,并方竞争对手难以模仿、难以替代难以超越。“核心竞争力”是公司中国际经济环境、政策变化环境下不同时期获取可能性的核心竞争力。基金管理人主要采用定性的方式评估公司是否具有核心竞争力,以对财务指标来进行验证,核心竞争力主要体现在以下两个方面:

(1)经营与管理
管理能力强、专业、真诚务实和勤奋的管理层是公司发展的基本条件;
公司的治理结构合理,能够及时响应市场和股东利益的要求,并能规避许多潜在的风险;
公司的战略规划良好,符合公司长远利益的战略规划才能使公司拥有可持续发展的增长空间;
组织执行力即公司内部资源的能力,是公司实施商业计划,达成商业目标的关键。
规范、完善、高效的业务流程是企业的经济成功的重要体现。

(2)技术与生产
技术:具有突出的技术优势,技术积累或专利,通过不断研发技术创新,增强其在产业链中的盈利能力或行业中的竞争优势。
生产:先进的生产能力和规范的生产效率是公司在保证产品质量的前提下,实现控制成本、利润最大化的保障。

(3)产品/服务、渠道和品牌
主要产品和服务:产品和服务是为客户提供了附加或超预期的改善了客户体验,具有的大品牌及其重要性包括:差异化的产品形成一定程度的不可替代性,增强公司相对于竞争对手的价格能力,并增强公司的利润空间;而产品的创新又可以从公司现有的产品和服务中,创造出新的价值,产生溢价空间从而带动公司股价的上升;而公司通过不断创新,保持其销售渠道畅通,有利于改善其所处的竞争位置。
与产品或服务直接相关的是渠道,与渠道战略伙伴关系,是公司产品占市场,提高市场份额的有力支持。
品牌:品牌对于开拓客户忠诚度和客户口碑具有重要的重要性,使得公司能够在起和竞争激烈的行业环境中脱颖而出,并进一步巩固其品牌地位。

对于通过上述分析我们认为具备较强核心竞争力的公司,本基金将根据财务分析中的成长性指标,验证基金管理人核心竞争力的分析;同时结合估值和流动性分析,在股价位于内在价值区间。

职务分析指标:
三、截至本季报主要持仓的净利润增长率是否高于行业平均水平验证公司的核心竞争力。
估值分析:主要持仓有PE、PEG、PB、PCF、PS、EV/EBITDA等。

流动性分析:主要持仓有市场流通股量、股东分散性等。

(三)债券投资策略
债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取超额收益。
1)自上而下确定组合久期和类属资产配置
结合对宏观经济、货币政策和财政政策、市场结构变化、资金流动情况的研究,结合宏观经济模型(MEAM)判断收益率曲线变动趋势及期限,确定组合久期,进而根据各类属资产的预期收益率,结合类属配置策略确定类别资产配置。
2)自上而下选择品种
通过预期收益率曲线变动的幅度和形状,对比不同信用等级、在不同市场交易品种的预期收益率,综合考虑流动性、票息、税收,可自持购买其公允价值溢价的因素,发现市场中个别品种相对失衡状况,重点选择的债券品种包括:A、在类似信用级别和期限的债券中选择收益率较高的债券;B、同样好信用的债券;C、存在信用溢价的债券;D、收流动性溢价价值的可转债;E、收益率水平较高的债券或者市场未正确定价的创新品种。
(1)利率预期策略
基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等宏观政策走向,分析金融市场利率变动趋势,并在此基础上判断利率期限结构变动趋势,以及收益率曲线变化趋势,在预期利率水平将上升时,降低组合久期,预期市场利率将下降时,提高组合久期,并根根据收益率曲线变化情况调整相应债券期限结构如增加久期限债券、缩短组合或者调整摊余成本组合等。
(2)信用策略
基金管理人根据预期回报、融资、企业(公司)债等不同债券种类,结合各类券种税收状况、流动性状况以及发行人信用状况的分析,评定不同债券品种的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类别之间的配置比例。
个别选择策略:基金管理人对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析,从企业财务报表及构成、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分,非财务分析方面(包括偿债能力、市场地位和发展前景等指标)则主要依据实地调研和电话会议的形式实现,通过分析财务报表和各类风险、高风险定是对高风险的企业,重点投资于低风险的企业债券;对于高风险企业,有相应的风险控制,不投资于难以对风险的债券。
(3)时机策略
1)骑乘策略:当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,通过收益率水平处于上端的优势,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将缩短,从而其对应的收益率水平将较投资期初有所下降,进而获得较高的收益率的下降,进而获得资本利得收益。
2)息差策略:利用回购等手段降低债券的持仓成本,通过正回购时获得资金投资于债券以获取超额收益。
3)利差策略:对两个期限相近的债券进行配对,从而利用利率水平的未来变动赚取利差。
4)跨期限套利:当期利率水平较高时,可以买入久期收益的债券同时卖出久期收益低的债券,通过两债券利率的利差获得投资收益;当期利率水平下降时,可以买入久期收益低的债券同时买入久期收益高的债券,通过两债券利率的利差获得投资收益。
(四)股指期货投资策略
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

九、**业绩比较基准**
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
如果上述业绩比较基准计算编制或更名,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能作为市场基准的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以与基金托管人一致并经中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十、**风险提示特征**
本基金属于股票型基金,属于较高预期收益和风险的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。
十一、**投资组合报告(未经审计)**
本基金本报告期符合基金合同约定,本基金投资组合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股份有限公司根据基金合同规定,已经复核了本投资组合报告的内容,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3月31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	1,646,813,633.20	90.34
其中:股票	1,646,813,633.20	90.34	
2	固定收益投资	99,655,000.00	5.47
其中:债券	99,655,000.00	5.47	
资产支持证券	-	-	
3	货币资金	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	无形资产	-	-
其中:无形资产	-	-	
6	应收股利和应收利息合计	51,322,710.62	2.82
7	其他资产	25,056,048.62	1.37
8	合计	1,822,846,852.48	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	-	-
C	制造业	1,147,007,771.13	63.35
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	信息传输、软件和信息技术服务业	201,128,000.00	11.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	225,607,862.07	12.43
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	73,710,000.00	4.07
O	国民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,646,813,633.20	90.95

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

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	300065	中航光电	6,280,000	118,754,800.00	6.56
2	002303	奥普光电	5,174,289	115,179,731.14	6.36
3	002598	胜达能源	3,301,699	112,488,884.93	6.21
4	000651	东方电机	3,500,817	98,024,388.00	5.41
5	002701	东方电机	9,349,088.50	94,349,088.50	5.04
6	002405	四维图新	6,000,000	83,640,000.00	4.62
7	600983	合肥三电	5,852,236	77,660,251.56	4.29
8	002572	索菲亚	4,700,000	76,740,000.00	4.22
9	600832	东方明珠	6,500,000	73,710,000.00	4.07
10	000423	莱钢股份	2,100,000	71,610,000.00	3.95

证券代码:000913 证券简称:钱江摩托 公告编号:2014-020 浙江钱江摩托股份有限公司关于召开2014年第一次临时股东大会的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

浙江钱江摩托股份有限公司(以下简称“公司”)于2014年7月24日及2014年7月25日在《证券时报》及巨潮资讯网上披露了《关于召开2014年第一次临时股东大会的通知》、《关于2014年第一次临时股东大会增加网络投票方式的通知》,本次股东大会采取现场投票及网络投票相结合的方式召开,现将有关事项提示如下:

- 一、会议召开基本情况
- 1、会议召集人:浙江钱江摩托股份有限公司董事会
- 2、会议召开时间:
现场会议时间为:2014年8月8日上午9:00
网络投票时间为:2014年8月7日—2014年8月8日。其中,通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为:2014年8月8日上午9:30至11:30、下午13:00至15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为:2014年8月7日下午15:00至2014年8月8日下午15:00。
- 3、现场会议召开地点:浙江温州经济开发区浙江钱江摩托股份有限公司会议室。
- 4、会议方式:本次股东大会采取现场投票与网络投票相结合的方式,公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台,股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。
- 5、参加会议的方式:同一表决权只能选择现场、网络表决方式中的一种,网络投票方式包括深交所交易系统和互联网系统两种方式。同一表决权只能重复表決的以第一次投票结果为准。
- 6、股权登记日:2014年8月1日。
- 7、会议出席对象:
(1)截至2014年8月1日下午收市时在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的公司全体股东,并可以书面形式委托代理人出席会议和参加表决,该委托代理人不必是本公司股东;

- (2)公司董事、监事、高级管理人员;
(3)公司聘请的律师;
(4)其他相关人员。
- 二、会议审议事项
- 1、本次会议审议的提案由公司第五届董事会第二十二次会议审议通过并提交,程序合法,资料完备。
- 2、本次会议需审议的议案如下:
关于授权子公司择机全权处置创业项目的议案
3、2014年第一次临时股东大会提案内容详见刊登在2014年7月24日及2014年7月25日《证券时报》和巨潮资讯网 http://www.cninfo.com.cn 上的《第五届董事会第二十二次会议决议公告》、《关于授权子公司择机全权处置创业项目的提示性公告》。
- 三、会议登记办法
- 1、登记时间:2014年8月6日上午9:00—11:00,下午14:00—17:00。
- 2、登记方式:
(1)自然人股东:本人亲自出席会议的须持本人身份证、股票账户卡办理登记手续;委托代理人出席会议的,应持本人身份证、授权委托书、委托人股票账户卡及身份证复印件手续。
(2)机构投资者:法定代表人亲自出席的,须持本人身份证、营业执照复印件(加盖公章)、股票账户卡办理登记手续;委托代理人出席的,须持本人身份证、法人授权委托书、营业执照复印件(加盖公章)、委托人股票账户卡办理登记手续。
- 凡在会议主持人宣布现场出席会议的股东和委托代理人人数及所持有效表决权的股份总数之前到会的股东均有权参加。

- 3、登记地点:浙江温州经济开发区浙江钱江摩托股份有限公司证券部。
四、参与网络投票的股东身份认证与投票程序
在本次股东大会,公司将向股东提供网络投票平台,股东可以通过深圳证券交易所交易系统或互联网投票系统http://wlp.cninfo.com.cn参加网络投票。
- (一)采用深交所交易系统投票的程序
本次股东大会通过交易系统进行网络投票的时间为2014年8月8日上午9:30至11:30、下午13:00至15:00,投票程序比照深圳证券交易系统买入股票操作。
- 1.投资者投票代码:360913,投票简称:钱江摩托。
- 2.股东投票的具体程序为:

北京首都航艾启威节能技术股份有限公司(以下简称“公司”)于近日接到控股股东北京首航艾启威节能技术股份有限公司(以下简称“首航艾启威”)、大股东北京首航伟业科技发展有限公司(以下简称“首航伟业”)的通知,获悉:

1、首航艾启威将其持有本公司有限售条件流通股68,500,000股(占本公司股份总数的2.568%)质押给兴业证券股份有限公司,用于办理股权质押回购业务。本次质押初始交易日为2014年7月17日,赎回交易日为2015年7月17日,该笔质押手续已于2014年7月17日办理。

质押期限自2014年7月17日起至质押双向中国证劵登记结算有限责任公司深圳分公司办理解质押手续为止。

2、首航伟业将其持有本公司有限售条件流通股65,500,000股(占本公司股份总数的2.062%)质押给兴业证券股份有限公司,用于办理股权质押回购业务。本次质押初始交易日为

证券代码:002665 证券简称:首航节能 公告编号:2014-050 北京首都航艾启威节能技术股份有限公司 关于控股股东及大股东进行股权质押式回购交易的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

北京首都航艾启威节能技术股份有限公司(以下简称“公司”)于近日接到控股股东北京首航艾启威节能技术股份有限公司(以下简称“首航艾启威”)、大股东北京首航伟业科技发展有限公司(以下简称“首航伟业”)的通知,获悉:

- 1、首航艾启威将其持有本公司有限售条件流通股68,500,000股(占本公司股份总数的2.568%)质押给兴业证券股份有限公司,用于办理股权质押回购业务。本次质押初始交易日为2014年7月17日,赎回交易日为2015年7月17日,该笔质押手续已于2014年7月17日办理。
- 质押期限自2014年7月17日起至质押双向中国证劵登记结算有限责任公司深圳分公司办理解质押手续为止。
- 2、首航伟业将其持有本公司有限售条件流通股65,500,000股(占本公司股份总数的2.062%)质押给兴业证券股份有限公司,用于办理股权质押回购业务。本次质押初始交易日为

证券代码:002665 证券简称:首航节能 公告编号:2014-050 北京首都航艾启威节能技术股份有限公司 关于控股股东及大股东进行股权质押式回购交易的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

北京首都航艾启威节能技术股份有限公司(以下简称“公司”)于近日接到控股股东北京首航艾启威节能技术股份有限公司(以下简称“首航艾启威”)、大股东北京首航伟业科技发展有限公司(以下简称“首航伟业”)的通知,获悉:

- 1、首航艾启威将其持有本公司有限售条件流通股68,500,000股(占本公司股份总数的2.568%)质押给兴业证券股份有限公司,用于办理股权质押回购业务。本次质押初始交易日为2014年7月17日,赎回交易日为2015年7月17日,该笔质押手续已于2014年7月17日办理。
- 质押期限自2014年7月17日起至质押双向中国证劵登记结算有限责任公司深圳分公司办理解质押手续为止。
- 2、首航伟业将其持有本公司有限售条件流通股65,500,000股(占本公司股份总数的2.062%)质押给兴业证券股份有限公司,用于办理股权质押回购业务。本次质押初始交易日为

4.报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券种	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	99,655,000.00	5.50
4	企业债	99,655,000.00	5.50
5	公司债及中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	-	-
8	合计	99,655,000.00	5.50

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五名债券投资明细

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	140204	14附开04	500,000	50,070,000.00	2.77
2	12001	12国债10	500,000	49,585,000.00	2.74

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十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持证券。

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
本基金本报告期末未有贵金属投资。

8.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有权证投资。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期未持有股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期未持有国债期货。

11.投资组合报告附注
本基金报告期内本基金投资的股票前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况:
11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。
11.3 本基金投资的前十名债券未超出基金合同规定的投资范围。
11.4 本基金本报告期末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有处于转股期的可转换债券。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

十二、**基金的投资组合**
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表示其未来表现,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3月31日。
1、资产配置比例
本基金资产配置比例如下:
权益投资占基金资产净值的比例:60%-95%;
固定收益投资占基金资产净值的比例:3%-4%;
货币资金占基金资产净值的比例:0-10%;
买入返售金融资产占基金资产净值的比例:0-10%;
股指期货占基金资产净值的比例:0-10%;
权证占基金资产净值的比例:0-3%;
资产支持证券占基金资产净值的比例:0-10%;
现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例:5%以上。
本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

10.1.期末持仓按品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未有资产支持证券。
10.2.期末持仓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有贵金属投资。
10.3.期末持仓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有权证投资。
11.投资组合报告附注
11.1 本基金报告期内本基金投资的股票前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况:
11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。
11.3 本基金投资的前十名债券未超出基金合同规定的投资范围。
11.4 本基金本报告期末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有处于转股期的可转换债券。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

十三、**基金的投资组合**
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表示其未来表现,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3月31日。
1、资产配置比例
本基金资产配置比例如下:
权益投资占基金资产净值的比例:60%-95%;
固定收益投资占基金资产净值的比例:3%-4%;
货币资金占基金资产净值的比例:0-10%;
买入返售金融资产占基金资产净值的比例:0-10%;
股指期货占基金资产净值的比例:0-10%;
权证占基金资产净值的比例:0-3%;
资产支持证券占基金资产净值的比例:0-10%;
现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例:5%以上。
本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

十四、**基金的投资组合**
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表示其未来表现,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3月31日。
1、资产配置比例
本基金资产配置比例如下:
权益投资占基金资产净值的比例:60%-95%;
固定收益投资占基金资产净值的比例:3%-4%;
货币资金占基金资产净值的比例:0-10%;
买入返售金融资产占基金资产净值的比例:0-10%;
股指期货占基金资产净值的比例:0-10%;
权证占基金资产净值的比例:0-3%;
资产支持证券占基金资产净值的比例:0-10%;
现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例:5%以上。
本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

十五、**基金的投资组合**
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表示其未来表现,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3月31日。
1、资产配置比例
本基金资产配置比例如下:
权益投资占基金资产净值的比例:60%-95%;
固定收益投资占基金资产净值的比例:3%-4%;
货币资金占基金资产净值的比例:0-10%;
买入返售金融资产占基金资产净值的比例:0-10%;
股指期货占基金资产净值的比例:0-10%;
权证占基金资产净值的比例:0-3%;
资产支持证券占基金资产净值的比例:0-10%;
现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例:5%以上。
本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

十六、**基金的投资组合**
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表示其未来表现,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3月31日。
1、资产配置比例
本基金资产配置比例如下:
权益投资占基金资产净值的比例:60%-95%;
固定收益投资占基金资产净值的比例:3%-4%;
货币资金占基金资产净值的比例:0-10%;
买入返售金融资产占基金资产净值的比例:0-10%;
股指期货占基金资产净值的比例:0-10%;
权证占基金资产净值的比例:0-3%;
资产支持证券占基金资产净值的比例:0-10%;
现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例:5%以上。
本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

十七、**基金的投资组合**
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表示其未来表现,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3月31日。
1、资产配置比例
本基金资产配置比例如下:
权益投资占基金资产净值的比例:60%-95%;
固定收益投资占基金资产净值的比例:3%-4%;
货币资金占基金资产净值的比例:0-10%;
买入返售金融资产占基金资产净值的比例:0-10%;
股指期货占基金资产净值的比例:0-10%;
权证占基金资产净值的比例:0-3%;
资产支持证券占基金资产净值的比例:0-10%;
现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例:5%以上。
本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

十八、**基金的投资组合**
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表示其未来表现,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3月31日。
1、资产配置比例
本基金资产配置比例如下:
权益投资占基金资产净值的比例:60%-95%;
固定收益投资占基金资产净值的比例:3%-4%;
货币资金占基金资产净值的比例:0-10%;
买入返售金融资产占基金资产净值的比例:0-10%;
股指期货占基金资产净值的比例:0-10%;
权证占基金资产净值的比例:0-3%;
资产支持证券占基金资产净值的比例:0-10%;
现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例:5%以上。
本基金投资于具有核心竞争力的公司股票资产不低于基金资产净值的80%。
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
4)持仓选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策走向、资金流向、技术特征等因素。
5)2倍保护:基金管理人会对持仓股指期货头寸,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股指期货组合的持仓,具体选择与股指期货交易的对冲策略。
4)持仓选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

股票代码:600674 股票简称:川投能源 公告编号:2014-051号 转债代码:110016 转债简称:川投转债 四川川投能源股份有限公司关于“川投转债”赎回的提示性公告