

Disclosure 信息披露

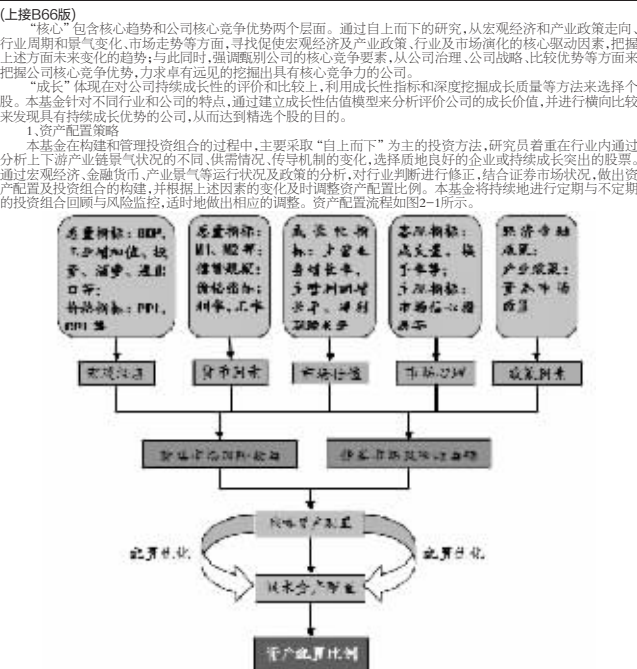


图9-1 资产配置流程图

资产配置的目的在于实现投资收益目标，其核心是选择具有竞争优势的行业和公司。资产配置的过程主要分为自上而下和自下而上两种方式。自上而下的方式，主要是通过对宏观经济、行业景气度、市场估值等因素的分析，确定资产配置的大方向。自下而上的方式，主要是通过对行业和公司的基本面分析，选择具有竞争优势的行业和公司。资产配置的过程是一个动态调整的过程，需要根据市场变化和基金的投资目标进行不断的调整。资产配置的过程可以分为以下几个步骤：1. 宏观分析；2. 行业分析；3. 资产配置；4. 组合构建；5. 跟踪调整。

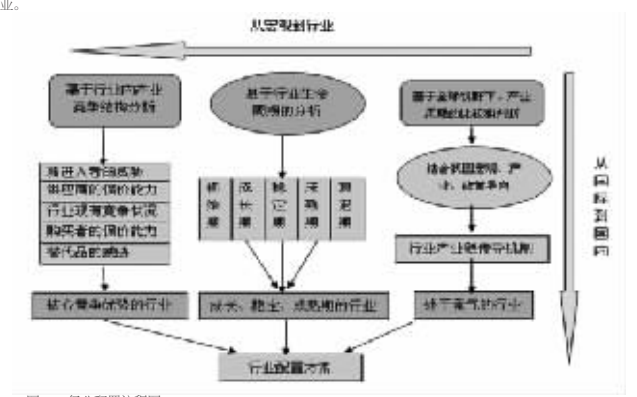


图9-2 投资组合构建流程图

投资组合构建的过程是在资产配置的基础上，选择具体的行业和个股。在这个过程中，基金经理需要根据行业和公司的基本面分析，选择具有竞争优势的行业和公司。投资组合构建的过程可以分为以下几个步骤：1. 行业分析；2. 个股选择；3. 组合构建；4. 跟踪调整。在个股选择的过程中，基金经理需要关注公司的核心竞争力和竞争优势。核心竞争力是指公司在行业内所拥有的独特资源和能力，竞争优势是指公司在市场上所拥有的相对优势。基金经理需要通过深入的研究和分析，识别具有核心竞争力和竞争优势的公司，并将其纳入投资组合。

长期来看，具有较好的发展前景或较强的盈利能力，本基金将对这些细分行业的公司进行投资。同时，对于国家扶持和鼓励型新兴产业的上市公司也会予以重点关注。本基金将综合考虑行业景气度、市场估值等因素，选择具有竞争优势的行业和公司。资产配置的过程是一个动态调整的过程，需要根据市场变化和基金的投资目标进行不断的调整。资产配置的过程可以分为以下几个步骤：1. 宏观分析；2. 行业分析；3. 资产配置；4. 组合构建；5. 跟踪调整。

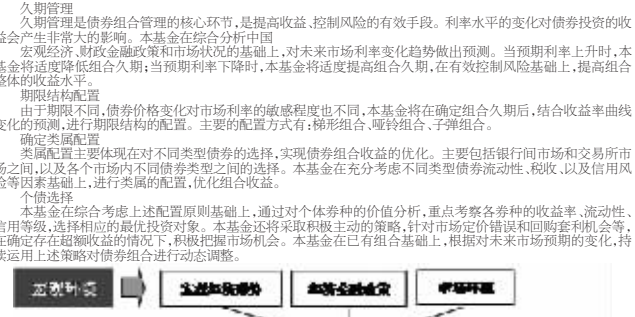


图9-3 债券投资策略示意图

债券投资策略示意图。本基金将根据宏观经济、市场估值等因素，选择具有竞争优势的行业和公司。资产配置的过程是一个动态调整的过程，需要根据市场变化和基金的投资目标进行不断的调整。资产配置的过程可以分为以下几个步骤：1. 宏观分析；2. 行业分析；3. 资产配置；4. 组合构建；5. 跟踪调整。

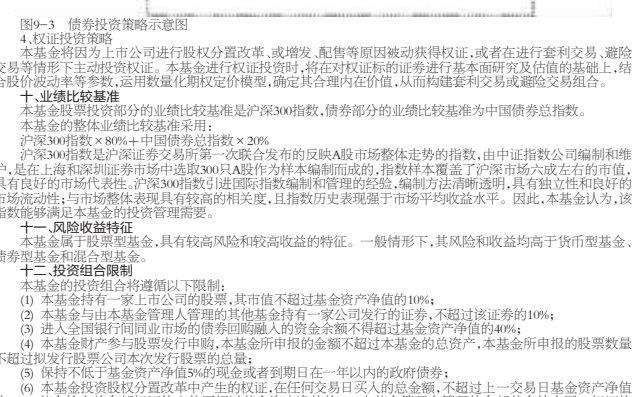


图9-4 资产配置流程图

资产配置流程图。本基金将根据宏观经济、市场估值等因素，选择具有竞争优势的行业和公司。资产配置的过程是一个动态调整的过程，需要根据市场变化和基金的投资目标进行不断的调整。资产配置的过程可以分为以下几个步骤：1. 宏观分析；2. 行业分析；3. 资产配置；4. 组合构建；5. 跟踪调整。

十五、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。
2. 有利于基金资产增值。
3. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

十六、基金的投资组合报告

截至2014年9月30日，本基金投资组合情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,801,034,620.25	87.35
2	固定收益投资	15,019,500.00	0.12
3	货币资金	15,019,500.00	0.12
4	其他资产	-	-
5	合计	12,835,539,199.96	100.00

注：1. 报告期内，本基金权益类资产的公允价值之和与持仓市值可能存在差异。2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	21,612,191.68	0.18
B	采矿业	515,904,312.00	4.20
C	制造业	9,042,294,617.87	73.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	400,170,773.68	3.26
E	建筑业	321,374,743.35	2.62
F	批发和零售业	299,204,763.01	2.44
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	731,634,232.34	5.96
J	金融业	189,880,000.00	1.55
K	房地产业	32,799,018.00	0.27
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	162,235,000.00	1.32
O	居民服务、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	合计	10,801,034,620.25	87.98

注：1. 报告期内，本基金权益类资产的公允价值之和与持仓市值可能存在差异。2. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

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	600372	中航电子	26,000,000	589,420,000.00	4.80
2	600118	中国卫星	27,916,900	515,904,312.00	4.20
3	600893	中航光电	19,700,000	507,669,000.00	4.14
4	600150	中国船舶	19,001,428	400,170,773.68	3.26
5	600343	航天动力	29,000,000	356,016,000.00	2.86
6	002653	惠思科	17,007,127	326,538,838.40	2.66
7	300055	万邦达	10,694,667	321,374,743.35	2.62
8	600855	航天长峰	15,800,000	265,366,000.00	2.16
9	600180	瑞凌透	23,575,910	248,725,850.00	2.03
10	000738	中航控制	19,900,000	245,964,000.00	2.00

报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

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	1280275	12国债(零)第十一期	150,000	15,019,500.00	0.12

十六、基金投资组合报告

截至2014年9月30日，本基金投资组合情况如下：

资产类别	账面价值	评估价值	增值额	增值率(%)
流动资产	852.97	866.16	13.19	1.55
固定资产	394.32	429.06	44.74	11.35
无形资产	246.77	247.20	0.43	0.17
长期待摊费用	0.16	0.10	-0.06	-0.00
递延所得税资产	2.54	0.00	-2.54	-100.00
资产合计	1,496.76	1,552.42	55.66	3.72
负债合计	75.08	75.08	-	-
净资产合计	1,421.68	1,477.34	55.66	3.92

十七、基金业绩

本基金自成立以来的业绩表现如下：

期间	净值增长率	业绩比较基准
自基金成立至今	49.68%	1.74%

(4) 报告期末无处于转股期的可转换债券。(5) 本报告期未发生资产支持证券。(6) 本报告期未发生资产支持证券。(7) 本报告期未发生资产支持证券。(8) 本报告期未发生资产支持证券。(9) 本报告期未发生资产支持证券。

期间	净值增长率	业绩比较基准
过去一个月	7.45%	1.09%
过去三个月	9.32%	1.10%
过去六个月	5.58%	1.33%

十八、基金的费用与税收

(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. 基金合同生效后发生的信息披露费用；
5. 基金合同生效后发生的审计费和律师费；
6. 基金合同生效后发生的其他费用；
7. 基金财产拨划支付的银行费用；
8. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

十九、基金资产的估值

基金资产的估值方法如下：

1. 估值日为本基金估值日，按月末估值。2. 估值对象为本基金持有的股票、债券、权证、股指期货、资产支持证券等金融资产。3. 估值程序为：估值对象按公允价值估值。4. 估值原则为：公允价值原则。

期间	净值增长率	业绩比较基准
过去一个月	7.45%	1.09%
过去三个月	9.32%	1.10%
过去六个月	5.58%	1.33%

二十、基金的业绩

本基金自成立以来的业绩表现如下：

期间	净值增长率	业绩比较基准
自基金成立至今	49.68%	1.74%

大众交通集团股份有限公司关于转让二家控股子公司股权的关联交易公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

陈非另有说明，以下简称在本公告中含义如下：
大众交通：上海大众汽车集团有限公司
陈非：上海大众汽车集团有限公司
大众交通集团：上海大众汽车集团有限公司
大众交通集团：上海大众汽车集团有限公司
大众交通集团：上海大众汽车集团有限公司
大众交通集团：上海大众汽车集团有限公司

大众交通集团最近五年之内无受过行政处罚、刑事处罚；无涉及与经济纠纷有关的重大民事诉讼或被仲裁。

一、关联交易的基本情况

1. 关联方的认定标准
2. 关联关系的认定标准

二、关联交易的主要内容

1. 关联交易的基本情况
2. 关联交易的主要内容

大众交通集团最近五年之内无受过行政处罚、刑事处罚；无涉及与经济纠纷有关的重大民事诉讼或被仲裁。

一、关联交易的基本情况

1. 关联方的认定标准
2. 关联关系的认定标准

二、关联交易的主要内容

1. 关联交易的基本情况
2. 关联交易的主要内容

大众交通集团股份有限公司第七屆董事会第十五次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

一、会议的基本情况

二、会议的主要内容

宜宾五粮液股份有限公司关于四川省宜宾五粮液集团财务有限公司对单一股东发放贷款余额超过该股东对财务公司出资的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

一、公告的基本情况

二、公告的主要内容

江铃恒立高压油缸股份有限公司关于获得专项资金的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

一、公告的基本情况

二、公告的主要内容

北京北斗星通导航技术股份有限公司第三屆董事会第二十七次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、会议的基本情况

二、会议的主要内容

吉林紫鑫药业股份有限公司关于全资子公司收到政府补助的公告

本公司董事会及全体董事保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、公告的基本情况

二、公告的主要内容

浙江钱江摩托股份有限公司关于部分贷款到账的公告

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

一、公告的基本情况

二、公告的主要内容

江苏恒立高压油缸股份有限公司关于获得专项资金的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

一、公告的基本情况

二、公告的主要内容

广西北生药业股份有限公司关于股东所持股权解除冻结的公告

本公司董事会及全体董事保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、公告的基本情况

二、公告的主要内容

吉林紫鑫药业股份有限公司关于全资子公司收到政府补助的公告

本公司董事会及全体董事保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、公告的基本情况

二、公告的主要内容