# 关于景顺长城景丰货币市场基金收益支付的提示性公告

景顺长城景丰货币市场基金（基金代码：000701(A类)/000707(B类)，以下简称“本基金”）基金合同约定，本基金收益分配遵循“每日分配、按月支付”的原则。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。本基金每月例行对上月实现的收益进行收益结转（如遇节假日顺延），每月例行的收益结转不再另行公告。现将本基金收益支付规则公告如下：

一、收益支付说明

本基金基金份额持有人的累计收益定于每月15日（集中支付日）集中支付并按1.00 元的份额面值自动结转为基金份额，若该集中支付日为非工作日，则顺延至下一工作日。收益累计期间为上月集中支付日至本月集中支付日的前一日。

本基金基金份额持有人的累计收益具体计算公式如下：

基金份额持有人累计收益=∑基金份额持有人每日收益

基金份额持有人每日收益=（基金份额持有人当日持有的基金份额/10000）X当日每万份基金净收益

基金份额持有人每日收益的精度为0.01元，第三位采用去尾的方法。

二、收益支付对象

集中支付日前一个工作日在景顺长城基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人。

三、收益支付办法

本基金收益支付方式只采用红利再投资方式，收益结转的基金份额将于集中支付日直接计入基金份额持有人的基金账户，基金份额持有人可于集中支付日的下一个工作日通过相应的销售机构及其网点查询和赎回收益结转的基金份额。

四、有关税收和费用的说明

1、根据财政部、国家税务总局的财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

2、本基金收益支付免收收益支付手续费和再投资手续费。

五、其他需要提示的事项

1、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

2、若本基金基金份额持有人于集中支付日前一工作日赎回本基金全部基金份额，其累计收益将自动计算，并与赎回款一起以现金形式支付，不参与收益结转。

六、咨询办法

1、景顺长城基金管理有限公司网站www.igwfmc.com。

2、景顺长城基金管理有限公司客户服务电话：4008888606。

风险提示：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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一四年十月十五日

# 景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2014年第10号）

公告送出日期：2014年10月15日

1.公告基本信息

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 景顺长城货币市场证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城货币 |
| 基金主代码 | 260102 |
| 基金合同生效日 | 2003年10月24日 |
| 基金管理人名称 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 公告依据 | 《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》、《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》 |
| 收益集中支付并自动结转为基金份额的日期 | 2014年10月15日 |
| 收益累计期间 | 自2014年9月15日至2014年10月14日止 |

2. 与收益支付相关的其他信息

| | |
|---|---|
| 累计收益计算公式 | 基金份额持有人累计收益=∑基金份额持有人每日收益，基金份额持有人每日收益=（基金份额持有人当日持有的基金份额/10000）x当日每万份基金净收益，基金份额持有人每日收益的精度为0.01元，第三位采用去尾的方法。 |
| 收益结转的基金份额可赎回起始日 | 2014年10月16日 |
| 收益支付对象 | 收益支付日前一个工作日在景顺长城基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人。 |
| 收益支付办法 | 本基金收益支付方式只采用红利再投资方式，本基金基金份额持有人收益结转的基金份额于2014年10月15日直接计入其基金账户，2014年10月16日起可查询及赎回。 |
| 税收相关事项的说明 | 根据财政部、国家税务总局的财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。 |
| 费用相关事项的说明 | 本次收益支付免收收益支付手续费和再投资手续费。 |

3.其他需要提示的事项

1、2014年10月14日申购的有效基金份额不享有当日收益，2014年10月14日申请赎回的有效基金份额享有当日收益。

2、若本基金基金份额持有人于2014年10月14日赎回全部基金份额，其累计收益将自动计算，并与赎回款一起以现金形式支付。

3、本基金基金份额持有人的累计收益于每月集中支付并按1元面值自动转为基金份额。

4、咨询办法

（1）景顺长城基金管理有限公司网站 www.igwfmc.com。

（2）景顺长城基金管理有限公司客户服务热线：4008888606。

（3）向本基金各销售机构查询：中国银行、中国工商银行、中国农业银行、中国建设银行、交通银行、招商银行、广发银行、浦发银行、兴业银行、光大银行、民生银行、北京银行、中信银行、平安银行、渤海银行、浙商银行、温州银行、华夏银行、金华银行、嘉兴银行、花旗银行、包商银行、南京银行、长城证券、广发证券、银河证券、国泰君安证券、中信建投证券、申银万国证券、招商证券、国都证券、兴业证券、光大证券、海通证券、中信证券（浙江）、中银国际证券、安信证券、国元证券、国信证券、中金公司、方正证券、天相投顾、西部证券、华宝证券、爱建证券、华福证券、信达证券、英大证券、宏源证券、华泰证券、华龙证券、国金证券、浙商证券、中航证券、中信证券、中投证券、长江证券、东莞证券、东方证券、齐鲁证券、国盛证券、国海证券、中信万通证券、西南证券、东海证券、众禄基金、数米基金网、诺亚正行、长量基金、好买基金、展恒基金、和讯科技、天天基金、同花顺基金、万银财富、宜信普泽、增财基金、鑫鼎盛、晨视天下、嘉实财富、新兰德、一路财富、恒天明泽、钱景财富、腾元基金、创金启富和唐鼎耀华等机构代销网点。

证券代码：000408 证券简称：金谷源 公告编号：2014-47

# 金谷源控股股份有限公司 2014年度前三季度业绩预亏预告

本公司及董事会全体成员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、本期业绩预计情况

1.业绩预告期间：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 30 日

2.预计的业绩：亏损

（1）2014 年 1-9 月业绩预计情况

| 项 目 | 本报告期 | 上年同期 |
|---|---|---|
| 归属于上市公司股东的净利润 | 亏损：约4000万元 | 盈利：401.24万元 |
| 基本每股收益 | 亏损：约 -0.1585 | 盈利：0.016 |

（2）2014 年 7-9 月业绩预计情况

| 项 目 | 本报告期 | 上年同期 |
|---|---|---|
| 归属于上市公司股东的净利润 | 亏损：约4400万元 | 盈利：-77.97万元 |
| 基本每股收益 | 亏损：约-0.1744 | 盈利：-0.0031 |

二、业绩预告预审计情况

业绩预告未经公司注册会计师预审计。

三、业绩变动原因说明

因公司筹划重大事项，公司本期营业收入大幅缩减，以及对部分科目计提坏账准备和预计负债，导致1-9月份业绩亏损。

四、其他相关说明

本业绩预告是公司财务部门初步测算的结果，最终数据以公司披露的 2014年三季度报告为准，请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

金谷源控股股份有限公司

董事会

二〇一四年十月十五日

证券代码：000408 证券简称：金谷源 公告编号：2014-48

# 金谷源控股股份有限公司 关于签署债务重组之合作协议的公告

本公司及董事会全体成员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。

特别提示：

1、本协议为双方合作的框架协议，不涉及任何具体的交易标的和标的金额，具体的实施内容和进度存在不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

2、本协议的签订，不影响当期利润。

3、公司将根据具体事项进展情况，按相关规定履行审批程序并及时披露有关信息。

近日，本公司分别与西藏自治区国有资产经营公司（以下简称“西藏国资公司”）及本公司控股股东北京路源世纪投资管理有限公司（以下简称“路源世纪”）就本公司债务重组事宜的合作达成了框架协议，鉴于本公司因历史遗留问题等原因形成的部分债务及或有债务多年得不到解决，本公司拟通过与西藏国资公司及路源世纪合作以解决相关的债务问题。

本公司与西藏国资公司签订的合作协议涉及的债务主要为本公司的或有债务，由西藏国资公司出资购买债权人持有的对本公司的债权。本协议签署后，西藏国资公司应当积极开展与相关债权人的谈判和磋商，争取尽快达成债务收购方案，并与债权人签署《债权转让协议》。本公司指派专门人员和西藏国资公司一起与重组债务债权人进行协商、谈判，并起草有关收购协议等法律文件。本协议项下合作期限为一年，合作期限届满后，本协议可由双方协商延期。

本公司与路源世纪签订的协议涉及的债务主要为本公司的部分债务，路源世纪通过主动偿还、债务转移等形式解除债务对本公司的影响，使最终的债权人对本公司能够豁免债务。本公司指派专门人员和路源世纪一起与重组债务债权人进行协商、谈判。本协议签署后，路源世纪应当积极开展与相关债权人的谈判和磋商，争取尽快达成债务重组方案。本协议项下合作期限为一年，合作期限届满后，本协议自动终止。

本公司与西藏国资公司及路源世纪签订的协议均不涉及任何具体的交易标的和标的金额。本次签订协议旨在确立合作方向和合作原则，双方将就具体合作事宜进行深入磋商，并在达成具体合作方案后履行相关审批程序及签订相关正式协议。

合作协议的签订，有利于公司尽快解除公司历史遗留债务对公司的制约，有利于公司尽快摆脱当前的经营困境，也有利于本公司的重大事项得到顺利的实施。

公司将根据具体事项进展情况，按相关规定履行审批程序并及时披露有关信息。公司所有信息披露刊载于指定信息披露媒体《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网，敬请广大投资者以公司指定信息披露媒体公告信息为准，同时敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

金谷源控股股份有限公司

董事会

二〇一四年十月十五日

证券代码：002178 证券简称：延华智能 公告编号：2014-078

# 上海延华智能科技（集团）股份有限公司 关于筹划重大资产重组的停牌公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

一、停牌事由和工作安排

上海延华智能科技（集团）股份有限公司（以下简称"公司"或"本公司"）正在筹划重大资产重组事项，因有关事项存在不确定性，为了维护投资者利益避免对公司股价造成重大影响，根据深圳证券交易所的相关规定，经公司申请，公司股票（股票简称：延华智能，代码：002178）自2014年10月15日开市时起停牌。公司承诺争取停牌时间不超过30个自然日，即承诺争取于2014年11月14日前按照《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第26 号—上市公司重大资产重组申请文件》的要求披露重大资产重组预案（或报告书）；公司股票将在公司董事会审议通过并公告重大资产重组预案（或报告书）后复牌。

如公司未能在上述期限内披露重大资产重组预案（或报告书），公司将根据重组推进情况确定是否向交易所申请延期复牌。公司未提出延期复牌申请或延期复牌申请未获交易所同意的，公司股票将于2014年11月14日开市时起复牌，并承诺自公司股票复牌之日起三个月内不再筹划重大资产重组事项。公司提出延期复牌申请并获交易所同意的，公司承诺累计停牌时间不超过三个月，如公司仍未能在延期复牌期限内披露重大资产重组预案（或报告书），公司承诺自公司股票复牌之日起六个月内不再筹划重大资产重组事项。

如本公司在停牌期限内终止筹划重大资产重组的，公司将及时披露终止筹划重大资产重组相关公告，公司承诺自复牌之日起三个月内不再筹划重大资产重组事项，公司股票将在公司披露终止筹划重大资产重组相关公告后恢复交易。

二、停牌期间安排

公司自停牌之日将按照相关规定，积极开展各项工作，履行必要的报批和审议程序，督促公司聘请的独立财务顾问、审计、评估、法律等中介机构加快工作。公司股票停牌期间，公司将按照相关规定，至少每五个交易日发布一次相关事项进展公告。

三、必要风险提示

本公司筹划的重大资产重组事项，尚存较大不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

四、备查文件

1.经公司董事长签字的停牌申请。

2、深交所要求的其他文件。

特此公告。

上海延华智能科技（集团）股份有限公司

董事会

2014年10月15日

股票代码：002730 股票简称：电光科技 公告编号：2014-003

# 电光防爆科技股份有限公司 关于公司竞拍厂房的公告

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。

2014年10月10日，电光防爆科技股份有限公司（下称"公司"）以人民币3497万元在乐清市人民法院淘宝网司法拍卖网络平台上竞得乐清市德正实业有限公司一处厂房（包括厂房内空调、客梯、监控设备、办公桌、柜、沙发、配电设备），土地证号：1-2008-39-866，房屋所有证号：116975，土地性质：国有出让，房屋所有权确权面积13667.82平方米，土地使用面积12765平方米，土地用途：工业用地。根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定，本次竞买厂房事项无需经公司董事会、股东大会审议批准。不构成关联交易，也不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。现将具体情况公告如下

一、竞得厂房情况

1.挂牌人：浙江省乐清市人民法院 竞得人：电光防爆科技股份有限公司

2.厂房位置：乐清经济开发区纬五路188号一处厂房

3房屋所有权确权面积：13667.82平方米 土地使用面积：12765平方米

4.厂房用途：公司储备用

5.出让年限：至2057年7月14日止

6.成交价格：3497万元

7.公司拟使用资金来源：自有资金

二、本次购买厂房对公司的影响

公司拟将此次竞拍取得的厂房和土地作为公司储备用地，未来视行业发展和企业实际经营情况适时规划用于主业矿用安全产品的项目建设，从而有助于扩大公司产能，提升公司的综合竞争力，符合公司长远规划。同时，该厂房邻近公司乐清生产基地，有利于人力资源、配套设施的共享，有利于统一管理，节约管理成本。

综合来看，此次竞拍将对公司的持续性发展起到正面推动作用，为公司乐清生产基地未来发展的持续性提供空间保障，符合公司的发展战略和全体股东的利益。

三、风险提示

1、本次竞拍取得厂房和土地后，将增加公司固定资产、无形资产及相应的折旧、摊销，对公司日常现金流产生影响。

2、公司2014年10月10日为本次竞拍支付500万元竞拍保证金已转为本次受让价款，公司须在2014年11月10日前支付完毕2997万元余款后方可最终获得上述厂房与土地使用权。根据本次竞拍有关规则，买受人逾期未支付拍卖款，法院可以裁定重新拍卖。重新拍卖时，原买受人不得参加竞买。重新拍卖的价款低于原拍卖价款造成的差价、费用损失，由原买受人承担。法院可以直接从其预交的保证金中扣除。扣除后保证金剩余的，应当退还原买受人；保证金数额不足的，可以责令原买受人补交，拒不补交的，法院强制执行。

公司将根据后续进展情况及时的履行信息披露，敬请投资者注意投资风险。

特此公告！

电光防爆科技股份有限公司

董事会

2014年10月14日

（上接B50版）

（四）审计上海金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-6123 8888

传真：021-6123 8800

经办注册会计师：薛竞 单峰

**四、基金名称**

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

**五、基金的类型**

股票型开放式证券投资基金

**六、基金的投资目标**

本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时结合主动投资方法，在严格控制跟踪偏离风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过 8%。

**七、基金的投资范围**

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他证券品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-15%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证占基金资产净值的比例不高于 3%。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金除投资于目标指数的成份股票，包括沪深 300 指数的成份股和备选成份股以外，还可适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发），以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

**八、基金的投资策略**

本基金为增强型指数基金，以沪深 300 指数作为标的指数。通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的偏离风险，在指数化投资的基础上进行适度优化调整和一级市场股票投资，追求超越业绩比较基准的收益水平。

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产长期增长的稳定收益为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人在债券（国债为主）、股票、现金等各类资产之间仅进行适度的主动配置。通过运用深入的基本面分析及先进的数量技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-15%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的比例不高于 3%。

在实际运作过程中，由于受市场价格波动、股票交易的零股限制、基金申购赎回情况等因素的影响，基金的资产配置比例可能会在规定比例上下小幅波动，基金经理小组及风险管理小组将对此进行实时的监控和调整。

2、股票投资策略

本基金以指数化投资为主，以最小化跟踪误差为组合的投资控制目标，本基金所跟踪的目标指数为沪深 300 指数。

本产品在指数化投资的基础上辅以有限度的增强操作（优化调整）及一级市场股票投资。具体而言，基金将基本依据目标指数的成份股构成权重，并借助数量化投资分析技术构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后，基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进行调整，使指数优化组合与目标指数的跟踪误差控制在限定的范围内。在正常市场情况下，本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过 8%。此外，本基金将利用所持有股票市值参与一级市场股票投资，以在不增加额外风险的前提下提高收益水平，争取获得超过指数的回报。

●控制跟踪误差

跟踪误差（TE）是指一段时间内，投资组合收益率与比较基准收益率的总体偏离程度的标准差。

本基金将“年化跟踪误差”作为投资风险控制的主要指标，年化跟踪误差允许的最大值为 8%。跟踪误差的主要控制方法是：

1、组合构成偏差控制

组合跟踪误差的主要来源是资产配置和行业配置差异，因此本基金在投资管理过程中严格控制基金组合与业绩比较基准的资产配置和行业配置的偏差。当资产配置差异或行业配置差异超出允许的上限时，及时对组合进行再平衡，将上述偏差控制在允许的范围内。

2、跟踪误差量化控制

在本基金的投资管理过程中，每日通过回测分析计算基金组合以及股票组合的跟踪误差及其构成。当跟踪误差超过允许的最大值时，将根据误差贡献分析调整贡献度较大的偏离因素，如非股票类资产权重、非指数成分股权重和偏离较大的行业等，务必将目标组合的跟踪误差控制在允许的范围内。

●分层抽样

本基金的股票投资部份的投资采用分层抽样法，分层抽样即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，本基金将沪深 300 指数成份股票按行业划分，以不同行业类别在指数中所占的权重来决定该行业在本基金实际投资组合中的投资权重，然后分别从每个行业中按照股票风险特征值（包括与行业相关性、beta 值、股票市值、PE、PB 等）选出最能代表该行业的样本股，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。通过对最优化算法模型的应用（市值作为主要考虑的因素），计算出追踪组合内各样本股的最优权重，力求组合表现与指数相一致，即跟踪误差最小，同时保证较小的调整频率和跟踪成本。本基金通过分层抽样法力争实现对沪深 300 指数的跟踪，

●增强操作

本基金的增强操作即对投资组合进行优化，进行优化的根本依据是国内股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性，指数化基础上的增强投资将通过仓位调整、调整权重和股票替代来实现。

①仓位调整

在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时，基金的股票投资仓位可进行下调，股票投资仓位最低可下调到占基金资产净值的 85%以适度规避市场系统性风险。

②组合优化

本基金在对沪深 300 指数各行业和个股进行深入研究的基础上，对投资组合优化调整，根据市值和行业板块的相对价值决定行业和个股相对于基准指标的配置比例。可能对一些预计收益超过平均水平的行业或个股增加投资的比例，而对一些预计收益低于平均水平的行业或个股调低投资比例。

●流动性优化

本基金对投资组合品种的流动性评价指标包括：股票的流通市值和股票近半年的累积换手率、本基金要求投资组合品种的流动性达到投资决策委员会不定期设定的要求。本基金将提高具备要求流动性特征股票的投资权重

●基本面优化

本基金主要基于对上市公司的基本面分析对指数化投资组合进行优化，提高具备要求基本面特征股票的投资权重，主要考虑以下因素：

公司基本面及竞争优势。

股票相对价值。

个股的市场机会和趋势。

股票的流动性。

③股票替代

●一级市场股票投资

本基金通过适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发）以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

●非成份股的投资。

在控制跟踪误差风险的前提下，对于经过深入研究具备投资价值的非指数成分股，本基金也可适度进行二级市场投资，作为增强收益的方式之一。在保持行业配置不变的前提下，用投资价值突出的非成分股替代同行业的成分股，获取超额收益。

非成份股投资选择指标：

a)预期未来两年盈利增长超过行业平均；

b)近三年平均 ROE 大于行业平均；

c)综合考虑盈利情况，结合估值 PE,PB 等指标，估值有一定安全边际。

对于停牌或由于规避关联交易等原因无法进行投资的指数成分股，本基金通过行业分析、市值规模分析、相关性分析，可以选择特征相似的非成分股进行替代。

3、债券投资策略

本基金将在对宏观经济和资本市场进行研究的基础上，对利率结构、市场利率走势进行分析和预测，综合考虑中债国债指数各成份券种及金融债的收益率水平、流动性的好坏等因素，进行优化选择构建本基金的债券投资组合。

本基金以富兰克林邓普顿集团固定收益类资产投资研究平台及本基金管理人的投资研究平台为依托，采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。

1）利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要的因素，利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析，采用定性分析与定量分析相结合的方法，形成对未来利率走势的判断，并依此调整组合久期和资产配置比例。

2）久期控制策略

在对利率变化方向和趋势判断基础上确定恰当的久期目标，合理控制利率风险。当预期利率整体上升时降低组合久期；当预期利率整体下降时提高债券组合久期。

3）期限结构配置

当确定本基金债券组合的久期后，本基金主要采用收益率曲线分析策略决定组合期限结构配置。收益率曲线分析策略是根据收益率曲线的非平行移动调整资产组合，即通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化，寻求在一段时间内获得因收益率曲线形状变化而导致债券价格变化所产生的超额收益的策略。主要有三种配置方式可以选择：子弹策略是将组合各债券到期期限高度集中于收益率曲线上的某一点；哑铃策略是将到期期限集中于曲线的两端；而梯形策略则是各期限到期的债券所占的比重基本一致。

4）类属资产配置策略

不同类型的债券在收益性、流动性和信用风险上存在差异，有必要将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿三者的最佳平衡点。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

5）债券品种选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。为控制基金债券投资的信用风险，本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的内部信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

债券投资的基本面分析重点是国家宏观经济状况、货币政策、利率变动前景及信用状况。技术分析主要是债券供求状况、收益变动、交易量等。本基金可投资的债券品种包括国债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债及其他货币市场工具等。

国债品种信用风险小、重点分析国债品种的利率风险、流动性风险，并且关注投资者结构，根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合。

在选择金融债、企业债、公司债品种时，重点分析债券的市场风险和信用风险，信用风险主要考察发行人及担保人的资信品质、财务状况、历史违约情况、担保情况等。

本基金将可在严格控制组合投资风险的前提下投资于资产支持证券。主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券各个分支的风险与收益状况进行评估，根据基金投资组合管理的目标选择合适的分支进行投资。

**九、基金的投资决策流程**

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立了完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：为基金管理人的最高投资决策机构，由投资决策委员会主席主持，对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资策略、战略资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究分析部对标的指数成份股和备选成份股，以及其他投资标的进行独立研究，并依据研究成果建立基金股票池。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究分析部的研究支持下，拟定投资计划。

（4）基金经理根据投资决策委员会会议的决议进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须从基金股票池中选择投资标的，并严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（5）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

（6）投资风险管理部门采用量化模型分析基金投资组合对业绩比较基准的偏离，并提供基金经理进行组合调整时参考。

（7）风险管理和业绩分析会议：由投资决策委员会主席主持，研究主管和风险管理经理参加。风险管理经理向会议提交最新的投资风险和业绩评估报告，会议讨论基金投资合规控制和风险管理事项并形成决议，同时依据绩效分析的结果提出组合调整建议。

（8）基金经理根据风险管理和业绩分析会议决议或建议，对投资组合进行调整，以确保遵守各项合规控制和风险管理要求。

**十、基金的业绩比较基准**

本基金以沪深 300 指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为：95% × 沪深 300 指数 + 5% × 银行同业存款利率。

如果沪深 300 指数停止编制或发布，或沪深 300 指数供应商终止授权本基金使用其作为标的指数，或沪深 300 指数供应商发生重大事件威胁到其提供和授权沪深 300 指数的能力，或由于证券市场重大变化或沪深 300 指数编制方法重大调整导致其不适合继续作为本基金的标的指数，或法律法规及基金合同规定的其他可情形，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的标的指数和业绩比较基准，并在变更前至少提前 10 个工作日在指定媒体上公告。

中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

**十一、基金的风险收益特征**

本基金是股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。本基金的净值波动与股票市场的整体波动高度相关。本基金将在控制与业绩比较基准偏离风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。

**十二、基金的投资组合报告**

本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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人—中国农业银行根据本基金合同规定，于 2014 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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代表其未来表现。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。

本投资组合报告所载数据截止 2014 年 6 月 30 日，本报告财务资料未经审计。

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 | 469,623,888.20 | 94.01 |
| | 其中：股票 | 469,623,888.20 | 94.01 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 29,495,108.48 | 5.90 |
| 7 | 其他资产 | 440,385.93 | 0.09 |
| 8 | 合计 | 499,559,382.61 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）积极投资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 | 357,799.20 | 0.07 |
| B | 采矿业 | 755,127.50 | 0.15 |
| C | 制造业 | 42,315,316.61 | 8.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,497,265.28 | 0.70 |
| E | 建筑业 | 4,904,286.93 | 0.99 |
| F | 批发和零售业 | 3,450,923.29 | 0.69 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,442,642.44 | 0.69 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,164,892.03 | 0.64 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,886,066.26 | 0.38 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 221,100.00 | 0.04 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,054,314.40 | 0.41 |
| 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 | 1,926,338.00 | 0.39 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 67,976,071.94 | 13.66 |

（2）指数投资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 | 775,428.68 | 0.16 |
| B | 采矿业 | 25,310,099.73 | 5.09 |
| C | 制造业 | 130,778,072.80 | 26.28 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,688,693.61 | 2.15 |
| E | 建筑业 | 9,998,867.38 | 2.01 |
| F | 批发和零售业 | 10,590,305.71 | 2.13 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,014,972.72 | 1.61 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 12,561,344.85 | 2.52 |
| J | 金融业 | 155,557,567.00 | 31.26 |
| K | 房地产业 | 24,237,188.49 | 4.87 |
| L | 租赁和商务服务业 | 5,312,604.86 | 1.07 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 411,398.58 | 0.08 |
| 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 | 3,146,124.83 | 0.63 |
| S | 综合 | 4,265,147.02 | 0.86 |
| | 合计 | 401,647,816.26 | 80.72 |

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（1）指数投资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 | 601166 | 兴业银行 | 2,328,746 | 23,357,322.38 | 4.69 |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 2,335,825 | 21,139,216.25 | 4.25 |
| 3 | 600015 | 华夏银行 | 1,840,479 | 15,091,927.80 | 3.03 |
| 4 | 601328 | 交通银行 | 3,218,915 | 12,489,390.20 | 2.51 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 290,135 | 11,413,910.90 | 2.29 |
| 6 | 601818 | 光大银行 | 4,123,915 | 10,474,744.10 | 2.11 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 989,132 | 10,128,711.68 | 2.04 |
| 8 | 601336 | 新华保险 | 386,420 | 8,165,054.60 | 1.64 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 700,808 | 8,031,259.68 | 1.61 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 439,805 | 7,824,130.95 | 1.57 |

（2）积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 600559 | 老白干酒 | 178,781 | 3,749,037.57 | 0.75 |
| 2 | 002221 | 东华能源 | 174,081 | 1,947,966.39 | 0.39 |
| 3 | 600305 | 恒顺醋业 | 82,570 | 1,234,421.50 | 0.25 |
| 4 | 002020 | 京新药业 | 62,505 | 1,125,090.00 | 0.23 |
| 5 | 002245 | 澳洋顺昌 | 116,157 | 1,082,583.24 | 0.22 |

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

截至报告期末本基金未持有任何资产支持证券。

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

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

（1）本基金本期投资的前十名证券中，报告期内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证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况说明如下：

中国平安保险（集团）股份有限公司挖股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于 2013 年 9 月 24 日收到《中国证券监督管理委员会行政处