(上接B29版)

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。

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	1,824,024,199.32	89.50
	其中:股票	1,824,024,199.32	89.50
2	固定收益投资	120,108,000.00	5.89
	其中:债券	120,108,000.00	5.89
	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	79,805,457.32	3.92
7	其他资产	14,076,953.10	0.69
	合计	2,038,014,609.74	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	166,637,686.28	8.27
B	采矿业	45,262,177.78	2.25
C	制造业	844,612,790.06	41.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,627,538.00	0.88
E	建筑业	97,060,582.11	4.82
F	批发和零售业	423,917,412.20	21.04
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	143,499,055.76	7.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	38,371,849.19	1.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,657,860.30	1.12
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	15,777,247.64	0.78
S	综合	8,600,000.00	0.43
	合计	1,824,024,199.32	90.55

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	000028	国药一致	3,653,161	188,868,423.70	9.38
2	000963	华东医药	2,817,951	168,795,264.90	8.38
3	300273	和佳股份	6,523,302	149,187,916.74	7.41
4	000998	隆平高科	8,063,810	142,729,437.00	7.09
5	002551	尚荣医疗	3,937,365	106,781,338.80	5.30
6	300055	万邦达	1,869,950	65,803,540.50	3.27
7	300257	开山股份	1,511,260	55,674,818.40	2.76
8	300113	顺网科技	1,579,699	46,917,060.30	2.33
9	300164	通源石油	3,313,483	45,262,177.78	2.25
10	300096	易联众	2,488,478	42,179,702.10	2.09

4.报告期末按债券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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,108,000.00	5.96
	其中:政策性金融债	120,108,000.00	5.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	120,108,000.00	5.96

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	130243	13国开43	700,000	70,035,000.00	3.48
2	140436	14农发36	300,000	30,027,000.00	1.49
3	140320	14进出20	200,000	20,046,000.00	1.00

注:报告期末,本基金仅持有上述3只债券。

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

报告期末,本基金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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末,本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

11.投资组合报告附注

(1)声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形。

①西安通源石油科技股份有限公司发布了《关于收到陕西证监局立案调查通知的公告》,因公司涉嫌违反证券法律法规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会陕西证监局决定对公司立案调查,本基金投资于“通源石油(300164)”的决策程序说明:基于通源石油基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“通源石油”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

②报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查;在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体未受到公开谴责、处罚。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	417,762.35
2	应收证券清算款	9,616,636.36
3	应收股利	-
4	应收利息	3,943,240.54
5	应收申购款	99,313.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	14,076,953.10

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十大股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守,诚实信用,谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益,基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效(2010年12月7日)起至2010年12月31日	0.40%	0.51%	-1.10%	1.38%	1.50%	-0.87%
2011年	-23.21%	1.06%	-23.70%	1.23%	0.49%	-0.17%
2012年	4.41%	1.02%	7.44%	1.22%	-3.03%	-0.20%
2013年	22.36%	1.21%	-7.05%	1.32%	29.41%	-0.11%
2014年上半年	-1.02%	1.32%	-6.62%	0.99%	5.60%	0.33%
2014年1月1日至2014年9月30日	9.75%	1.20%	5.12%	0.94%	4.63%	0.26%

2.自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实主题新动力股票基金份额累计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12月7日至2014年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,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第十一部分二、投资范围和五、投资限制(二)投资限制(3)的有关约定。

十三、费用概览

(一)基金费用的种类

1.与基金运作有关的费用

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提,计算方法如下:

$H=E\times1.5\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提,计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)与基金运作有关的其他费用

主要包括因基金的证券交易或结算而产生的费用,基金合同生效以后的信息披露费用,基金份额持有人大会费用,基金合同生效以后的会计师费和律师费等,该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

2.与基金销售有关的费用

(i)申购费

本基金申购费率按申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低,投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。本基金申购费率最高不超过申购金额的5%,具体如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M<100万元	1.5%
100万元≤M<200万元	1.0%
200万元≤M<500万元	0.6%
M≥500万元	单笔1000元

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、正册登记等各项费用,不列入基金资产。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购开放式基金业务,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%,但中国银行长城借记卡、招商银行借记卡持卡人申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行;机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%,优惠后费率如果低于0.6%,则按0.6%执行,基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时,按实际费率收取申购费。

(2)赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%,随持有期限的增加而递减,具体如下:

持有期限	赎回费率
<365天	0.50%
365天≤M<730天	0.25%
≥730天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(3)转换费

基金转换费由基金份额持有人承担,用于支付有关手续费和注册登记费。本基金转换费率按照如下方式收取:

①,通过代销机构办理基金转换业务(仅限一般赎回费率为零的模式)

(a)嘉实货币A,嘉实货币B,嘉实稳利债券,嘉实多元债券B,嘉实安心货币A,嘉实安心货币B转换为嘉实主题新动力股票时,收取转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

净转入金额=(BxC)/(1+F)+M

转入份额=净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D为转出基金的对应赎回费率;

E为转入基金适用的申购费率;

F为转入基金适用的申购费率;

M为嘉实货币A,嘉实货币B,嘉实稳利债券,嘉实多元债券B,嘉实安心货币A,嘉实安心货币B转换为嘉实主题新动力股票时,采用“赎回费+申购费率”算法;

(b)嘉实信用债券C,嘉实纯债债券C,嘉实稳固收益债券转换为嘉实主题新动力股票时,采用“赎回费+申购费率”算法;

净转入金额=BxCx(1-D)/(1+F)

转入份额=净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D为转出基金的对应赎回费率;

E为转入基金适用的申购费率;

F为转入基金适用的申购费率。

(c)嘉实主题新动力股票与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实创新混合、嘉实价值恢复股票、嘉实领先成长股票、嘉实理财先锋、嘉实化比化利、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实泰和混合、嘉实美好保健股票、嘉实新兴企业股票之间互转,以及转入嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实稳利债券A、嘉实多元债券A、嘉实稳固收益债券、嘉实保证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实中证400联接、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接、嘉实半益纯债定期债券时,仅收取转出基金的赎回费,计算公式如下:

净转入金额=BxC×(1-D)

转入份额=净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D为转出基金的对应赎回费率;

E为转入基金适用的申购费率。

(d)嘉实保证基本面120ETF联接、嘉实中证400联接、嘉实中证500ETF联接转入嘉实主题新动力股票时,采用“赎回费+固定补差费率”算法;

净转入金额=BxC×(1-D)/(1+G)

转换补差费用=BxC×(1-D)/(1+G)×G

转入份额=净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D为转出基金的对应赎回费率;

E为转入基金适用的申购费率;

G为对应的固定补差费率:1)当转出金额≥500万元时,固定补差费率为零;2)当转出金额<500万元,并且转出基金的持有期≥90天,则固定补差费率为零;3)当转出金额小于500万元,并且转出基金的持有期<90天,则固定补差费率为0.2%。

E为转入基金适用的申购费率。

(e)嘉实信用债券,嘉实多元债券A,嘉实信用债券A,嘉实纯债债券A转入嘉实主题新动力股票时,采用“赎回费+固定补差费率”算法;

净转入金额=BxC×(1-D)/(1+G)

转换补差费用=BxC×(1-D)/(1+G)×G

转入份额=净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D为转出基金的对应赎回费率;

E为转入基金适用的申购费率;

G为对应的固定补差费率:1)当转出金额≥500万元时,固定补差费率为零;2)当转出金额<500万元,并且转出基金的持有期≥90天,则固定补差费率为零;3)当转出金额小于500万元,并且转出基金的持有期<90天,则固定补差费率为0.5%。

E为转入基金适用的申购费率。

②,通过直销(直销柜台及网上直销)办理基金转换业务

a)对于“前端转前端”的模式,实施以下规则:

(i)嘉实货币A,嘉实货币B,嘉实稳利债券,嘉实多元债券B,嘉实安心货币A,嘉实安心货币B转换为嘉实主题新动力股票时,收取转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

净转入金额=(BxC)/(1+F)+M

转入份额=净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

E为转入基金适用的申购费率;

F为转入基金适用的申购费率;

M为嘉实货币A,嘉实货币B,嘉实安心货币A或嘉实安心货币B全部转出时账户当前累计未付收益。

(ii)嘉实信用债券C,嘉实纯债债券C,嘉实稳固收益债券转换为嘉实主题新动力股票时,采用“赎回费+申购费率”算法;

净转入金额=BxCx(1-D)/(1+F)

转入份额=净转入金额/E

其中,B为转出的基金份额;

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D为转出基金的对应赎回费率;

F为转入基金适用的申购费率。

b)对于“后端转后端”的模式,实施以下规则:

(i)在转出基金申赎回费,前区收取转出基金的赎回费;

(ii)转出基金适用的申购费率,后区收取转入基金的申购费;

转出基金时,如该次转出基金申赎回费用,收取赎回费归入基金财产的比例不得低于转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。

基金转换费由基金份额持有人承担,基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率,调整后的基金转换费率应及时公告。

注:1)自2011年1月7日起嘉实增长混合暂停转入业务;2014年3月12日起,嘉实货币单日单个基金账户累计申购(或转入,定投)不超过100万元;2014年3月12日起,嘉实安心货币单日单个基金账户累计申购(或转入,定投)不超过100万元,2014年4月23日起,嘉实超短债债券单日单个基金账户累计申购(或转入)不超过500万元,2014年9月4日起,嘉实研究精选股票单日单个基金账户累计申购(或转入)不超过200万元,2014年12月11日起,嘉实研究精选股票单日单个基金账户单笔定投不超过200万元,嘉实绝对收益策略定期混合,嘉实丰益纯债定期债券实施申购限额的公告,具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

注:2)2013年4月9日,本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金归集费模式并实施费率优惠的公告》,自2013年4月12日起,在本公司直销网上直销系统(含电话交易)开通旗下部分基金产品的后端收费模式(包括申购、定期定额投资、基金转换等业务),并对通过本公司基金网上直销系统(含电话交易)以基的后端收费进行费率优惠,本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式,具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

3.其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

(二)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(三)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商的情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(四)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1.在“重要提示”部分,明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2.在“三、基金管理人”部分,更新了基金管理人的相关信息。

3.在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分,增加邮储银行、同花顺、华安证券、宏信证券、熙恒基金、深圳腾元、扬州银行7家代销机构,并更新了直销机构、代销机构。

5.在“九、基金种类”部分,更新了基金种类的相关内容。

6.在“十一、基金的投资”部分,补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

7.在“十二、基金的业绩”部分,基金业绩更新至2014年三季度末。

8.在“二十五、其他应披露事项”部分,列示了本基金自2014年6月7日至2014年12月7日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2015年1月19日

(上接B30版)

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	900,251,247.98	89.20
	其中:股票	900,251,247.98	89.20
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	89,738,773.33	8.89
7	其他资产	19,231,364.10	1.91
8	合计	1,009,221,385.41	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2014年9月30日

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	64,209,599.98	6.62
B	采矿业	-	-
C	制造业	298,241,938.83	30.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	117,095,294.33	12.07
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	150,591,247.77	15.52
G	交通运输、仓储和邮政业	42,385,992.28	4.37
H	住宿和餐饮业	16,670,446.20	1.72
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,643,122.13	3.67
J	金融业	11,826,991.19	1.22
K	房地产业	86,201,828.99	8.88
L	租赁和商务服务业	20,772,785.53	2.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	24,728,702.40	2.55
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	12,503,150.99	1.29
S	综合	19,380,147.36	2.00
	合计	900,251,247.98	92.79

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

2014年9月30日

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	600635	大众公用	7,987,061	45,845,730.14	4.73
2	600316	洪都航空	1,349,216	36,536,769.28	3.77
3	000078	海王生物	3,732,112	36,126,844.16	3.72
4	000735	罗牛山	4,439,742	32,543,308.86	3.35
5	000544	中原环保	2,104,107	25,817,392.89	2.66
6	000701	厦门信达	2,045,972	24,960,858.40	2.57
7	600706	曲江文旅	1,717,271	24,728,702.40	2.55
8	002258	利尔化学	1,523,505	23,766,678.00	2.45
9	000996	中国中期	1,319,348	23,444,813.96	2.42
10	600683	京投银泰	3,899,882	23,204,297.90	2.39

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序的前五名债券投资明细

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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本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序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1410	IF1410	-41	-30,186,660.00	-658,980.00	套保交易盈亏
公允价值变动总额合计(元)					-658,980.00
股指期货投资本期收益(元)					-550,020.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-658,980.00

注:买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示,单位为手。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,本着谨慎原则,在风险可控的前提下,根据量化风险模型统计分析,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大,符合本基金的投资政策和投资目标。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1

厦门信达于2014年7月18日收到厦门证监局下发的《关于对厦门信达股份有限公司采取责令改正措施的决定》(2014]6号),就公司及子公司开展的架子牛、阴极铜购销业务中多确认销售收入;财务报表附注未披露部分固定资产无法办理产权证书的情况及其原因;子公司福建省信达光电科技有限公司收到“科技三项”财政补贴并于2014年第一季度将该财政补贴全额计入营业外收入等不规范等行为责令整改。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

11.2

本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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,543,622.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,929.36
5	应收申购款	15,667,812.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,231,364.10

11.4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持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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002258	利尔化学	23,766,678.00	2.45	重大事项停牌

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(截止至2014年9月30日)

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金成立日至2014年9月30日	23.10%	0.72%	9.53%	0.52%	13.57%	0.20%

1.1.1 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:①本基金合同生效日为2014年6月5日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

②根据《华商新量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合比例为:股票《包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票》投资比例为基金资产的0—95%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证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占基金资产的5%—100%,其中权证占基金资产净值的0%—3%,中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于10%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。

十三、基金的费用与税收

(一)基金运作费用

1.基金费用的种类

基金运作过程中,从基金财产中支付的费用包括:

①基金管理人的管理费,

②基金托管人的托管费,

③基金份额持有人大会费用,

④(基金合同)生效后与基金相关的信息披露费用,

⑤(基金合同)生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费,

⑥基金的证券交易费用,

⑦基金的银行汇划费用,

⑧基金的开户费用、账户维护费,

⑨按照国家有关规定和(基金合同)约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

①基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times1.5\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

②基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述“1、基金费用的种类中第(6)-(9)项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

①基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。

②基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。

③(基金合同)生效前的相关费用。

④其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(二)基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(三)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,我公司结合华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金的运行情况,对其原招募说明书进行了更新,主要更新的内容说明如下:

一、在“重要提示”部分更新了相关内容。

二、更新了“二、释义”部分相关信息。

三、更新了“三、基金管理人”的相关信息。

四、更新了“四、基金托管人”的相关信息。

五、更新了“五、基金托管人”的相关信息。

六、更新了“五、相关服务机构”中代销机构和会计事务所的相关信息。

七、在“九、基金的投资”中根据基金持有人大会的决议更改了投资范围等相关信息。根据本基金的实际运作情况,更新了最近一期投资组合报告的内容,并更新了最近一期基金业绩和同期业绩比较基准的表现。

八、在“二十一、其他应披露事项”中披露了本期已刊登的公告内容。

上述内容仅为摘要,须与本《招募说明书》(正文)所载之详细资料一并阅读。

华商基金管理有限公司
2014年1月19日

证券代码:000687 证券简称:恒天天鹅 公告编号:2015-006

恒天天鹅股份有限公司 2014年第三次临时股东大会决议公告

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,公告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、特别提示

本次会议召开期间没有增加、否决或变更提案。

二、会议召开的情况

1.会议召开时间

(1)现场会议召开时间:2015年1月16日(星期五)上午9:00

(2)网络投票时间:2015年1月15日至2015年1月16日

通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为2015年1月16日交易时间,即上午9:30—11:30,下午13:00—15:00;

通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的时间为2015年1月15日下午15:00至2015年1月16日下午15:00期间的任意时间。

2.现场会议召开地点:保定市新市区盛兴西路1369号公司会议室;

3.召开方式:本次会议采取现场投票与网络投票相结合的方式,公司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,公司股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

4.召集人:恒天天鹅股份有限公司董事会;

5.主持人:董事长王东兴先生;

6.会议的召开符合《公司法》《股票上市规则》及《公司章程》的规定,合法有效。

三、会议的出席情况

出席本次会议的股东及股东代理人共105名,代表有表决权股份369,386,303股,占上市公司总股份的48.7723%。其中,现场出席的股东及股东代理人为4名,代表有表决权股份364,058,469股,占上市公司总股份的48.0689%。

参与网络投票的股东为101名,代表股份5,327,834股,占上市公司总股份的0.7035%。

公司的董事、监事、高级管理人员、律师列席本次股东大会。

四、提案审议和表决情况

会议以采取现场投票与网络投票相结合的方式审议通过了以下议案:

(一)审议恒天天鹅股份有限公司关于董事人员调整的议案;(本议案采用累积投票方式)

总表决情况如下:

1、同意吕向阳先生为董事366,410,773股,占出席会议有表决权股份总数的99.1945%。(其中中小股东总表决情况:同意股份数2,360,916股。)

该议案获得通过。

2、同意吴光胜先生为董事366,293,570股,占出席会议有表决权股份总数的99.1627%。(其中中小股东总表决情况:同意股份数2,243,713股。)

该议案获得通过。

3、同意李晓丛先生为董事366,214,570股,占出席会议有表决权股份总数的99.1414%。(其中中小股东总表决情况:同意股份数2,164,713股。)

该议案获得通过。

(二)审议恒天天鹅股份有限公司修改《公司章程》的议案

总表决情况:

同意369,073,602股,占出席会议有表决权股份总数的99.9153%;反对5,101股,占出席会议有表决权股份总数的0.0014%;弃权