泰达宏利基金管理有限公司新增旗下部分基金在上海长量基金销售投资顾问有限公司销售并参加其费率优惠活动的公告

根据泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与上海长量基金销售投资顾问有限公司（以下简称“长量基金”）签订的基金销售协议，自2015年11月29日起，投资者可以通过长量基金网上交易系统办理下列基金的开户、申购、定投、转换、赎回等业务。

序号	新增销售机构适用基金名称	基金代码
1	泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金A类	001141
	泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金B类	001142
2	泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金	001418
3	泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金	162215
	泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金之优先类基金份额（聚利A）	150034
	泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金之进取类基金份额（聚利B）	150035

同时，自销售之日起，投资者通过长量基金（www.erichfund.com）申购（含已开通定期定额投资）前端收费模式下的上述基金，可享受申购费率（含分级费率）最低2折优惠。若折扣后申购费率低于0.3%，则按0.3%执行；若原申购费率（含分级费率）等于或低于0.3%，或者为固定费用的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。具体优惠期限以长量基金的公告为准。敬请投资者留意长量基金的有关公告。

有关详情请咨询长量基金客户服务热线400-820-2899、访问长量基金网站www.erichfund.com，也可致电本公司客户服务热线400-698-8888，010-66555662，或登录本公司网站www.mfcteda.com了解有关情况。

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。投资者投资于本公司旗下基金前应认真阅读各基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司
2015年11月27日

泰达宏利基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告

根据泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与上海陆金所资产管理有限公司（以下简称“陆金所资管”）签订的基金销售协议，自2015年11月30日起，投资者可以通过陆金所资管网上交易系统办理旗下部分基金的开户、申购、赎回业务。同时，本公司与陆金所资管协商一致，决定自2015年11月30日起，旗下部分基金参加陆金所资管的费率优惠活动。

一、适用基金

序号	适用基金名称	基金代码
1	泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）	162207
2	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	162216

二、优惠活动

投资者通过陆金所资管申购前端收费模式下的上述基金，其申购费率（含分级费率）享有4折优惠。若折扣后申购费率低于0.6%，则按0.6%执行；若原申购费率（含分级费率）等于或低于0.6%，或者为固定费用的，则按原费率执行，不再享有费率优惠。具体各基金原申购费率参见该基金最新更新的招募说明书及相关公告。

三、咨询方式

有关详情请咨询陆金所资管客户服务热线400-821-9031、访问陆金所资管网站www.lufunds.com，也可致电本公司客户服务热线400-698-8888、010-66555662，或登录本公司网站www.mfcteda.com了解有关情况。

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。投资者投资于本公司旗下基金前应认真阅读各基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司
2015年11月27日

泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告

公告送出日期：2015年11月27日

1 公告基本信息

基金名称	泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利中小盘混合
基金主代码	162214
基金管理人名称	泰达宏利基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	李泉霖
离任基金经理姓名	邓艺颖

注：-

2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	邓艺颖
离任原因	工作安排
离任日期	2015-11-26
是否转任本公司其他工作岗位	否
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	否

注：-

3 其他需要说明的事项

上述基金经理变更事项已按规定向中国证券投资基金业协会办理变更手续，并报中国证券监督管理委员会北京监管局备案。

泰达宏利基金管理有限公司
2015年11月27日

证券代码：002153　证券简称：石基信息　编号：2015-63

北京中长石基信息技术股份有限公司关于全资子公司收购eFuture Information Technology Inc.股权的公告

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、交易概述

1、经北京中长石基信息技术股份有限公司（以下简称“公司”或“石基信息”）2015年第四次总裁办公会决议审议通过，公司之全资子公司石基（香港）有限公司（以下简称“石基（香港）”）拟通过美国全国证券交易商协会自动报价系统（National Association of Securities Dealers Automated Quotations）（简称“纳斯达克”或“NASDAQ”）以二级市场价格购买eFuture Information Technology Inc.（以下简称“eFuture公司”）（股票代码：EFUT）不低于30%股权且本次股权收购拟持有三年以上。截止本公告发出日，公司以合计16,750,509.61美元（包含交易佣金及费用）购买eFuture公司2,453,966股普通股股票，占eFuture公司截止2015年9月30日的总股本4,858,651股的50.51%，平均每股eFuture公司股票购买价格约为6.826美元；本次交易完成后，公司将持有eFuture公司不低于30%的股权，且该交易不构成重大资产重组及关联交易；

2、根据《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》的规定：“.....以下情形不适用风险投资规范的范围：.....（三）以战略投资为目的，购买其他上市公司股份超过总股本的10%，且拟持有三年以上的证券投资；”经公司管理层一致决定，石基（香港）本次购买eFuture公司不低于30%股权属于公司战略性投资，拟购买的股权比例将超过30%且拟持有三年以上，因此公司本次交易不属于风险投资事项。

3、根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《中小企业板信息披露业务备忘录》及公司章程，公司子公司本次交易无需经公司董事会及股东大会审议。

4、公司本次交易为通过美国纳斯达克以二级市场价格公开购买eFuture公司股权，因此本次交易不涉及交易对手方、交易协议等相关事项。

二、交易标的的基本情况

（一）出资方式

本次石基（香港）以自有资金共计16,750,509.61美元在美国纳斯达克市场购买eFuture公司50.51%股权。

（二）标的公司基本情况及相关内容

1、标的公司基本情况

eFuture Information Technology Inc.（英属开曼群岛富基信息技术有限公司）于2006年在美国纳斯达克上市，股票代码：EFUT，该公司持有北京富基融通科技有限公司（以下简称“北京富基融通”）100%股权，且eFuture公司经营活动通过北京富基融通公司实现；目前北京富基融通为上市主体eFuture公司实际控制的经营实体。

2、标的公司全资子公司基本情况

名称：北京富基融通科技有限公司
注册号：110000410157246
公司类型：有限责任公司
法定代表人：颜艳春
注册资本：230万美元
注册地址：北京市海淀区中关村南大街8号甲8号乙8号威地科技大厦805室
成立日期：2000年1月12日
经营范围：计算机软硬件技术开发、技术转让、技术咨询、技术服务，计算机技术培训，数据处理，计算机系统集成，计算机、软件及辅助设备、电子产品、仪器仪表、机械设备的批发，货物进出口、技术进出口、代理进出口。

3、eFuture公司主要财务数据：

单位：人民币元

项目	2014.12.31（经审计）	2015.9.30（未经审计）
总资产	264,086,015	267,463,862
净资产	130,431,387	136,786,434

单位：人民币元

项目	2014年度（经审计）	2014年1-9月（未经审计）	2015年1-9月（未经审计）	2014年7-9月（未经审计）	2015年7-9月（未经审计）
营业收入	219,453,707	87,905,169	92,555,149	34,000,094	36,149,665
营业成本	126,111,190	52,285,377	54,702,990	18,719,354	19,756,651
营业利润	93,342,517	35,619,792	37,852,159	15,280,740	16,393,014
净利润	7,387,156	-11,339,335	-15,211,121	-1,798,999	-3,895,202

三、交易的目的、存在的风险和对公司的影响

1、本次交易的目的及对公司的影响

eFuture公司是中国快速增长的消费品及零售行业软件和解决方案提供商、移动互联网业务的推动者，其为中国及国际1000多家消费品牌和零售企业（包括多家世界500强客户和近40家中国百强零售商）提供全渠道解决方案、移动社交购物和本地服务。凭借业内的品牌影响力和与客户紧密的战略合作关系，目前eFuture公司的客户群体已经包括中国宝洁、百事、欧莱雅、GUCCI等在内的全球企业及苏宁电器、华润万家等大型商超。

基于公司目前正处于向旅游消费信息化服务平台供应商转型的关键时期，公司仍然紧密围绕公司既定的战略方向不变，结合目前公司发展的步伐及整体战略布局，公司将通过本次收购eFuture公司股权加速实现公司在大消费行业的平台化构建，使公司更好地建立传统酒店行业与零售行业的平台化服务，助力公司为中国旅游消费行业提供整体信息化解决方案。

本次交易仅为公司子公司通过美国纳斯达克市场购买eFuture公司50.51%股权，本次交易对公司2015年度财务状况及经营成果不构成重大影响。

2、本次投资存在的风险

公司本次收购涉及境外收购，公司子公司石基（香港）尚需严格遵守美国纳斯达克交易规则进行信息披露，同时本次交易仍受美国证券交易委员会监管，公司将严格按照美国证券市场规定及中国证券监督管理委员会、深圳证券交易所规定以及公司内部决策审批及时履行信息披露义务，及时公布交易进展情况，敬请投资者注意投资风险。

四、备查文件

1、2015年第四次总裁办公会决议；
2、深交所要求的其他文件。

特此公告。

北京中长石基信息技术股份有限公司
董事会
2015年11月26日

证券代码：600084　证券简称：中葡股份　公告编号：2015-071

中信国安葡萄酒业股份有限公司2015年第五次临时股东大会决议公告

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。

重要内容提示：

●本次会议是否有否决议案：无

一、会议召开和出席情况

(一)股东大会召开的时间：2015年11月26日

(二)股东大会召开的地点：乌鲁木齐市红山路39号4楼会议室

(三)出席会议的普通股股东和恢复表决权的优先股股东及其持有股份情况：

1、出席会议的股东和代理人人数	35
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数（股）	632,521,583
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例（%）	56.28

表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定，大会主持情况等。

本次股东大会的表决方式符合《公司法》及《公司章程》的规定。本次会议由公司董事会召集，副董事长苏斌先生主持。公司部分董事、监事、公司董事会秘书、公司聘请的见证律师出席了会议，公司其他高级管理人员列席了会议。

(四)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况

1、公司在任董事12人，出席3人，其他董事因公务出差未能参会；

2、公司在任监事3人，出席1人，其他监事因公务出差未能参议；

3、公司董事会秘书侯伟；总经理苏斌、总会计师范宝、副总经理刘卫军、副总经理王东等高级管理人员列席了本次会议。

二、议案审议情况

(一)非累积投票议案

1、议案名称：关于变更部分募集资金用途的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	632,519,583	99.99	2,000	0.01	0	0.00

(二)关于议案表决的有关情况说明

以上议案均经出席会议股东或股东代表所持有效表决权股份总数的二分之一以上通过。

三、律师见证情况

1、本次股东大会鉴证的律师事务所：新疆天阳律师事务所

律师：李大明、常娜娜

2、律师鉴证结论意见：

新疆天阳律师事务所李大明律师和常娜娜律师对本次股东大会的召集、召开程序、出席会议人员的资格、议案的表决程序等事项进行了见证并出具了法律意见书。认为：公司二〇一五年第五次临时股东大会的召集召开程序、出席本次股东大会的人员资格、本次股东大会议案的表决方式、表决程序及表决结果，符合《公司法》、《证券法》、《上市公司股东大会规则》等法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的有关规定，合法有效。

四、备查文件目录

1、经与会董事和记录人签字确认并加盖董事会印章的股东大会决议；

2、经鉴证的律师事务所主任签字并加盖公章的法律意见书；

中信国安葡萄酒业股份有限公司
2015年11月26日

股票代码：600266　股票简称：北京城建　编号：2015-60

关于北京城建二期股权投资基金合伙企业(有限合伙)设立完成的公告

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。

2015年10月13日，公司召开第六届董事会第五次会议，审议通过了《关于发起设立北京城建二期股权投资基金合伙企业（有限合伙）的议案》，具体内容详见公司刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）的2015-58号公告。

目前北京城建二期股权投资基金合伙企业（有限合伙）（简称"二期基金"）已设立完成，二期基金24.428亿元已全部出资到位，并投资于公司的全资子公司北京城建兴业置地有限公司（简称"兴业置地"）开发的北京市大兴区瀛海镇项目。

二期基金基本情况：

1、二期基金的规模及构成

二期基金规模24.428亿元，构成如下：

由北京城建（上海）股权投资管理有限公司（简称"投管公司"）作为普通合伙人（简称"GP"），出资2440万元，占基金份额的1%；

由天津银行出资17.1亿元，申万宏源证券有限公司（简称"申万宏源"）担任优先级有限合伙人（简称"优先级LP"），占基金份额的70%；

由公司作为次级有限合伙人（简称"次级LP"）出资7.084亿元，占基金份额的29%。

2、二期基金存续期

存续期为1+1年，投管公司（或兴业置地）将根据实际情况，决定1年后终止并清算，或延长1年期限。

3、二期基金投资方式

二期基金采用委托贷款方式对兴业置地投资，用于北京市大兴区瀛海镇项目。

4、二期基金的基金管理人及管理费

合伙企业不设立投资决策委员会，由投管公司担任基金管理人（即执行事务合伙人），履行项目管理职责。

管理费为全体合伙人实际出资额的0.5%/年。二期基金按季度获得委贷银行转来的利息收入后3个工作日内，向投管公司支付管理费。

5、优先级LP的投资收益率

优先级LP的投资收益率为7.15%/年（含24.428亿元的委托贷款手续费、托管费、通道费等全部费用），由二期基金按季度向优先级LP支付投资收益。

6、收益分配和本金偿还

合伙企业存续期间，合伙企业应将季度利息收入作为投资收益及时进行分配。季度收益分配前，应当扣除合伙企业运营费用、支付GP管理费，按照7.15%的年投资回报率分别向各合伙人分配上一季度的投资收益（其中优先级LP的投资收益含委托贷款手续费、托管费、通道费等全部费用），分配顺序为优先级LP、GP、次级LP。

在投资周期届满或者投资提前终止时，二期基金将收回的投资本金及投资收益，在扣除各项费用后的剩余部分，全部列入合伙企业的清算资产。各合伙人按照上述分配顺序收回投资本金及应付未付的投资收益。在优先级LP、次级LP及GP按照约定取回各自的投资本金及实现收益后，合伙企业资产的剩余清算资产归次级LP所有。

7、风险分析

二期基金采用债权方式投资，不涉及兴业置地的经营管理权；公司相对控股的投管公司担任二期基金的管理人，而且二期基金不设立投资决策委员，投管公司按照合伙协议约定履行相应的项目管理职责。总体上，公司能绝对控制大兴区瀛海镇项目，无失控风险。

特此公告。

北京城建投资发展股份有限公司董事会
2015年11月26日

（上接B46版）

经办注册会计师：薛竟、黄靖婷

（五）其他服务机构及委托办理业务的有关情况

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

四、基金的名称

浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

以追求长期资本增值为目的，通过投资于被市场低估的具有价值属性或可预期的具有持续成长属性的股票，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速增长的成果，进而实现基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合范围为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，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%。投资于权证的比例范围占基金资产净值的0%—3%。本基金投资于资产支持证券以及衍生工具的比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品或者衍生工具，将依据有关法律法规进行投资管理。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如果法律法规对上述比例要求有变更的，本基金投资范围将及时做出相应调整，以调整变更后的比例为准。

本基金将通过定性与定量的方法筛选出基本面健康的、具有价值属性或成长属性或两种属性兼具的股票作为本基金的核心投资目标，本基金将有百分之八十以上的股票基金资产投资于这些股票。

八、基金的投资策略

（一）投资策略依据

本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资策略，在投资策略上充分体现“价值”、“成长”和“精选”的主导思想。

“价值”是指甄别公司的核心价值，从公司治理、公司战略、比较优势等方面来把握公司核心竞争优势，通过自下而上的研究，以基本面研究为核心，力求卓有远见地挖掘出具有核心竞争力的被市场忽视的价值低估型公司。价值因素主要表现在相对市场股价比较高的自由现金流，比较高的每股收益和净资产，并能给上市公司股东带来实际收益的增长，而非粗放的规模增长。

“成长”主要表现在可持续性、可预见性的增长。寻找成长型公司重点在于对公司成长性的客观评价和比较上，不仅仅需要关注成长的数量，同时还要关注成长的质量以及这种较高质量的成长的预期可持续性，通过深度研究，精选个股投资。

“精选”是指借鉴国外先进的公司财务研究模型FFM，一方面通过关注上市公司现金流的形成，排除噪音数据，进行上市公司“被低估的价值”的判断；另一方面通过对上市公司过往财务数据的分析判断修正以及对其未来变化的预测，通过严格的逐项分析流程，实现对上市公司“可持续的、可预见的成长”的判断。在基本面分析的基础上，结合深入的实地调研和估值研究，对于符合本基金理念的标的股票进行精选投资。

（二）资产配置策略

本基金采用“自上而下”的投资方法，基于对国内外宏观经济、金融市场、产业景气等运行状况及政策的分析，对行业判断进行修正，结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况，进行资产配置及组合的构建。同时，在基金运作过程中，根据上述因素的变化，对组合进行战略和战术性配置。具体表现在：在基金运作过程中，本基金管理人将以科学的风险评估方法衡量各类别资产的风险收益特征并加以分析比较，通过设定可承担的风险水平，随着市场风险的变化以及各类别资产的风险收益特征及其相对变化趋势，及时调整股票资产与债券资产之间的比例，实现定期调整与主动调整相结合的动态管理。根据调整力度和调整的周期，分为战略资产配置和战术资产配置。

1、战略资产配置

战略资产配置是主要的、时间较长的资产配置方案。战略资产配置是在综合考虑宏观经济背景和资本市场状况及相关影响因素的情况下，对股票资产、债券资产和货币资产的风险收益特征进行分析预测，在绝对服从《基金合同》的基础上，确定未来一段时间的战略资产配置方案。这个战略资产配置方案，由投资决策委员会集体讨论表决决定。

每年年初及新基金发行时，公司投资决策委员会制定具体基金当年或新基金的战略资产配置目标。只有在发生重大情况变化导致各类别资产的风险收益特征发生显著变化时，经投资决策委员会重新集体讨论才能改变战略资产配置目标。基金在投资过程中，整体股票仓位必须符合战略资产配置目标，一般不会有大幅的变化。

2、战术资产配置

战术资产配置是次要的、时间较短的资产配置方案。它是在战略资产配置方案的框架下，对大类资产比例的一种小幅调整。市场在极端情况下可能会有剧烈的波动，为了应对这种波动，主动进行细微的仓位调整，也即是战术资产配置。另一种情况，市场整体波动幅度有限，但市场结构分化严重时，相应资产的风险和收益特征也会有较大变动，此时进行组合的优化调整，也会相应进行战术性资产配置。

战术性资产配置方案不能改变整个基金资产的战略资产配置目标。在实际投资过程中，战术性的资产配置调整是由投资决策委员会授权基金经理在确定的范围内进行，每个季度的投资决策委员会会议决定对基金经理的战术性资产配置授权范围。

（三）股票投资策略

1、行业配置策略

本基金在投资过程中，力求基金资产行业配置的适度均衡。适度均衡是指基金资产尽量分散开来，而不是集中于少数一个或几个行业，以避免过度集中的风险；同时，力求使基金资产对市场上的重点行业有一定的覆盖面，但这种覆盖又不是机械意义上的参考业绩比较基准中行业比例的覆盖，而是在全面研究的基础上，有取有舍，有轻有重。

对相对较侧重配置的行业，我们主要从如下几个方面评估：

（1）基于全球视野下的产业周期的分析和判断

本基金着眼于全球视野，以对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点，再结合对国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析，从而判别国内各行业产业链传导的内在机制，并从中找出处于景气中的行业。

（2）基于行业生命周期的分析

本基金将重点投资处于成长期、稳定期和成熟期的行业。本基金也关注那些虽然大类行业属于衰退性行业但某些细分行业处于成长期的行业，另外对国家扶持和经济转型中产生的行业成长机会也将予以重点关注。

（3）基于行业内产业竞争结构的分析

本基金重点通过波特的竞争理论考察各行业的竞争结构：①成本控制能力；②现有竞争状况；③产品定价能力；④新进入者的威胁；⑤替代品的威胁等。本基金重点投资那些产业竞争结构较健康的行业。

在基金投资过程中，行业配置方案建立在整个投研团队的研究支持基础之上，投资决策委员会负责制定行业配置方案，基金经理负责执行行业配置方案，并进行相应的反馈。

2、个股精选策略

本基金坚持“自下而上”的精选个股策略。通过深入挖掘具有明显估值优势、持续成长能力强且质量出色的企业来构建股票投资组合。

本基金主要通过定量分析和定性分析相结合的方式精选个股。定量方面，首先依据市净率、市盈率、股息收益率等指标来考察个股的价值属性；依据营业收入增长率、营业利润增长率、税后利润增长率等指标来考察个股的成长属性。然后通过公司择有的数量化的公司财务研究模型FFM中的PEG、MV/Normalized NCF、EV/EBITDA等主要估值指标来考察和筛选出内在价值较高的股票。定性方面主要考虑：公司具有核心竞争优势，在行业内处于领先地位；公司所处的行业发展前景良好，主营业务具有持续成长的能力；公司具有良好的治理结构和财务健康度等。最后结合定量和定性研究以及实地调研筛选出基本面健康的、最具有估值吸引力的的股票作为本基金的核心投资目标，进行重点投资。

（四）债券投资策略

在资本市场国际化的背景下，通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。

债券类品种的投资追求在严格控制风险基础上获取稳健回报的原则。

1、本基金采用目标久期管理方法作为本基金债券类证券投资的核心策略。通过宏观经济分析平台把握市场利率水平的运行态势，作为组合久期选择的主要依据。

2、结合收益率曲线变化的预测，采取期限结构配置策略，通过分析和情景测试，确定长、中、短期三种债券的投资比例。

3、收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收、以及信用风险等因素基础上，进行类属的配置，优化组合收益。

4、在运用上述策略方法基础上，通过分析个券的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素，选择风险收益配比最合理的个券作为投资对象，并形成组合。本基金还将采取积极主动的策略，针对市场定价错误和回购套利机会等，在确定存在超额收益的情况下，积极把握市场机会。

5、根据基金申购、赎回等情况，对投资组合进行流动性管理，确保基金资产的变现能力。

（五）权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合以及在合同许可投资比例范围内的投资于价值出现较为显著的低估的权证品种。

（六）其它创新或者衍生产品的投资策略

本基金将根据公募基金的特点和要求，结合创新或者衍生产品的特征，在进行充分风险控制和充分遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略进行该类产品的投资。

本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，根据证券市场实际情况对上述投资策略进行非实质性的调整，此类变更不需经过基金份额持有人大会通过。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为沪深300指数×75%＋中证全债指数×25%。

本基金采用沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要因为：（1）沪深300指数是上海和深圳证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有较强的独立性、代表性和良好的市场流动性；（2）沪深300指数是一只符合国际标准的优良指数，该指数体现出与市场整体表现较高的相关度，且指数历史表现强于市场平均收益水平、风险调整后收益也较好，具有良好的投资价值；（3）沪深300指数编制方法的透明度较高；且具有较高的市场认同度和未来广泛使用的前景，使基金之间更易于比较。

本基金采用中证全债指数作为债券投资部分的业绩比较基准主要因为中证全债指数编制方法的透明度较高，是一个全面反映国债市场的综合性权威债券指数。在已有基金的债券部分业绩比较基准中享有较高的市场占有率，选择其作为债券部分业绩比较基准易于与其他基金的比较。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受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指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。

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。

本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日（财务数据未经审计）。

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	2,457,479,755.88	93.45
?	其中：股票	2,457,479,755.88	93.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	151,192,683.22	5.75
8	其他资产	20,950,742.58	0.80
9	合计	2,629,623,181.68	100.00

（一）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	5,191.70	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	991,222,418.27	38.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,685,933.12	0.37
E	建筑业	59,895,514.83	2.30
F	批发和零售业	97,839,426.65	3.75
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	848,377,073.38	32.55
J	金融业	560,535.40	0.02
K	房地产业	209,370,931.25	8.03
L	租赁和商务服务业	82,846.28	0.00
M	科学研究和技术服务业	32,031,309.10	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,648,236.64	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	42,614,953.24	1.64
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	164,145,386.02	6.30
S	综合	-	-
	合计	2,457,479,755.88	94.29

（二）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	000782	美达股份	12,242,292	204,813,545.16	7.86
2	300287	飞利信	13,916,440	202,345,037.60	7.76
3	300096	易联众	5,099,911	201,701,480.05	7.74
4	600687	刚泰控股	10,043,815	134,285,806.55	5.15
5	300226	上海钢联	2,478,822	131,228,836.68	5.04
6	000673	当代东方	5,023,707	102,985,993.50	3.95
7	300207	欣旺达	4,008,168	100,124,036.64	3.84
8	300212	易华录	2,273,277	77,518,745.70	2.97
9	002008	大族激光	3,433,091	66,876,612.68	2.57
10	600399	抚顺特钢	7,904,500	66,793,025.00	2.56

（三）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。

（四）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

本基金本报告期末未持有债券。

（五）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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（六）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。

（七）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。

（八）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

（九）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

（十）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,849,566.03
2	应收证券清算款	16,320,326.85
3	应收股利	-
4	应收利息	36,287.02
5	应收申购款	1,744,562.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,950,742.58

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。

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	300096	易联众	201,701,480.05	7.74	临时停牌
2	000673	当代东方	102,985,993.50	3.95	临时停牌

十二、基金业绩

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。

（一）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
2008/04/16-2008/12/31	-42.30%	2.12%	-37.87%	2.27%	-4.43%	-0.15%
2009/01/01-2009/12/31	65.34%	1.53%	68.18%	1.54%	-2.84%	-0.01%
2010/01/01-2010/12/31	1.05%	1.38%	-8.38%	1.18%	9.43%	0.20%
2011/01/01-2011/12/31	-25.21%	1.30%	-18.23%	0.97%	-6.98%	0.33%
2012/01/01-2012/12/31	4.85%	1.27%	6.86%	0.96%	-2.01%	0.31%
2013/01/01-2013/12/31	27.65%	1.73%	-5.15%	1.05%	32.80%	0.68%
2014/01/01-2014/12/31	49.43%	1.56%	39.13%	0.91%	10.30%	0.65%
2015/01/01-2015/09/30	13.60%	2.92%	-5.36%	2.02%	18.96%	0.90%
2008/04/