

**(上接B42版)**

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层  
 法定代表人：何如  
 联系人：陈洁  
 联系电话：(0755) 82130633  
 传真：(0755) 82133302  
 客服电话：95536  
 公司网站：http://www.guosen.com.cn  
 (28) 东莞证券有限责任公司  
 住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号  
 法定代表人：陈广汉  
 联系人：陈伟强  
 联系电话：(0769) 22119341  
 传真：(0769) 22116999  
 客服电话：(0769) 9661130  
 公司网站：http://www.dgjq.com  
 (29) 东海证券有限责任公司  
 住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼  
 法定代表人：朱科敏  
 联系人：陈超  
 联系电话：(0519) 88157761  
 传真：(0519) 88157761  
 客服电话：4008888888、95531  
 公司网站：http://www.longone.com.cn  
 (30) 中信证券股份有限公司  
 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座  
 法定代表人：王东明  
 统一客服电话：95558  
 公司网站地址：http://www.citic.com  
 (31) 中信证券（山东）有限责任公司  
 住所：青岛市城阳区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层  
 法定代表人：陈佳辰  
 客户服务专线：95548  
 传真：(0532) 85022605  
 (32) 信达证券股份有限公司  
 住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
 法定代表人：高冠江  
 客户服务电话：400-800-8899  
 客服电话传真：400-6080978  
 公司网站：http://www.cindasc.com  
 (33) 长城证券股份有限公司  
 住所：深圳市福田区深南大道6088号特区报业大厦14、16、17层  
 法定代表人：黄耀华  
 客户服务电话：4006668888  
 基金业务传真：0755-83515567  
 公司网站：http://www.cgws.com  
 (34) 华泰证券股份有限公司  
 住所：上海市浦东新区江苏路750号  
 法定代表人：李晖  
 客户服务电话：400-109-9918  
 基金业务传真：021-64873009  
 公司网站：http://www.htsec.com.cn  
 (35) 国都证券股份有限公司  
 地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层  
 法定代表人：李锡军  
 客户服务电话：4008188118  
 基金业务传真：(010)-84183311  
 公司网站：http://www.guodas.com  
 (36) 联讯证券股份有限公司  
 住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路55号  
 法定代表人：李海川  
 客户服务电话：95564  
 基金业务传真：010-64088834  
 公司网站：http://www.lxjq.com.cn  
 (37) 广州证券股份有限公司  
 住所：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼  
 法定代表人：刘震  
 客户服务电话：(020) 961303  
 基金业务传真：(020) 88836654  
 公司网站：http://www.gzs.com.cn  
 其他代销机构  
 (1) 天相投资顾问有限公司  
 住所：北京市西城区金融大街9号富凯大厦B座  
 法定代表人：林文彬  
 联系电话：(010) 66045608  
 传真：(010) 66045522  
 公司网站：http://www.txsec.com  
 (2) 上海天天基金销售有限公司  
 住所：上海市浦东新区世纪大道1600号2楼  
 法定代表人：其实  
 客户服务电话：400-1818-188  
 基金业务传真：(021) 64883308  
 公司网站：http://www.1234567.com.cn  
 (3) 和讯信息科技有限公司  
 住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
 法定代表人：王莉  
 客户服务电话：40920022  
 基金业务传真：(021) 20838879  
 公司网站：http://licaike.hexun.com  
 (4) 上海好买基金销售有限公司  
 注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4楼409室  
 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室  
 法定代表人：杨文斌  
 客服电话：400-700-9665  
 传真：(021) 68596916  
 网站：http://www.ehowbuy.com  
 (5) 杭州数米基金销售有限公司  
 注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道海曙路2号  
 办公地址：浙江省杭州市西湖区江南大道588号12楼  
 法定代表人：陈柏青  
 客户服务电话：400-776-7223  
 传真：(0571) 26698533  
 数米基金网：http://www.fund123.cn  
 (6) 浙江花旗银行股份有限公司  
 住所：浙江省杭州市上城区平海路10号元茂大厦903  
 法定代表人：廖耀平  
 客户服务电话：4008-773-772  
 传真：(0571) 86900423  
 公司网站：http://www.5ifund.com  
 基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。  
 二、注册登记机构  
 名称：中国证券登记结算有限责任公司  
 住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层  
 法定代表人：陈贵  
 办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层  
 联系电话：010-58598837  
 传真：010-58598907  
 联系人：任海荣  
 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师  
 名称：通力律师事务所  
 住所（办公地址）：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
 负责人：韩炯  
 经办律师：吕红、安冬  
 电话：021-31358664  
 传真：021-31358600  
 联系人：安冬  
 四、审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师  
 名称：安永华明会计师事务所  
 办公地址：北京市朝阳区东三环北路1号东方广场东塔楼财经楼16层  
 执行事务合伙人：葛明  
 电话：010-58153000  
 传真：010-58188298  
 经办注册会计师：徐杰、蒋燕华  
 联系人：蒋燕华

**第四部分 基金的名称**  
**第五部分 基金的投资目标**  
 本基金通过定量与定性相结合精选股票，以追求长期收益与实际长期资本增值。  
**第六部分 基金的投资范围**  
 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。  
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投

资范围。  
 本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的60%—95%；债券投资比例为基金资产的5%—40%；权证投资比例为基金资产净值的0%—3%；资产支持证券投资比例为基金资产净值的0%—20%；本基金保留不低于基金资产净值的5%的现金和到期可于一年内到期的政府债券。  
**第八部分 基金的投资策略及投资组合管理**  
 一、投资策略  
 1. 大类资产配置策略  
 本基金以定量与定性研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、PPI和利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定整体市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。  
 投资决策委员会定期或根据需要进行召开会议，审议有关资产配置策略的分析结论，确定未来一段时间内的资产配置策略，确定投资组合中股票与债券等资产类别的配置比例。基金经理在资产配置策略的指导下进行投资。  
 2. 股票选择策略  
 本基金采用自上而下的方法，用静态与动态预期数据相结合的方式考察股票的价值、成长风格特征。选择那些价值被低估并且具有确定持续增长潜力的股票。  
 本基金采用市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/账面价值）、市销率（市值/营业收入）等指标考察股票的价值是否被低估。  
 本基金采用复合营业收入（Sale）增长率、盈利（EPS）增长率、息税前利润（EBIT）增长率、净资产收益率（ROE）以及现金流增长率等指标综合评价上市公司成长性。  
 本基金认为成长性较强的股票通常具有高市盈率，但高市盈率又往往意味着对该股票的高估值。因为市盈率相同的公司成长性差异可能很大，仅靠相对低估值或成长性无法帮助投资者筛选出价值合理、兼具成长性特征的股票。因此，本基金还采用FIGAR筛选法精选股票，以避免过于依赖估值与成长风格筛选这一缺陷，从而由价值与成长特征现象（DASP, Decline At A Reasonable Price）和成长泡沫破灭（GASP, Growth At A Stagnant Price）现象来综合判断股票是否值得投资。  
 PEG（市盈率增长比）= 市盈率/相对增长率之比）是本基金筛选GARP风格特征股票的重要指标。PEG为不成增长性公司的市盈率提供了可比性，暗示了获得每一个百分点增长率所付出的投资成本。本基金还考察了PEGV（市盈率增长比及估值比），具体而言，即市盈率相对预期盈利增长和现金流股息之和的比率。相对市盈率增长比率而言，PEGV更为均衡和稳定。同样逻辑，PBV（市净率增长比）和PSV（市销率增长比）等则是比PEG更稳定的指标。  
 (2) 定性筛选  
 本基金认为不能单纯依靠财务数据确定股票的合理价格区间，还需要综合考虑诸如财务数据质量、公司治理水平、管理能力与技术创新能力等方面，从而给以相应的溢价折价水平，并最终确定合理价格区间。本基金重点考察以下定性指标：  
 ● 公司的盈利能力与增长是否有机，并具有持续性；  
 ● 公司的股东、债权人、管理层之间的制衡机制、管理团队激励机制是否有效，投资者关系是否良好；  
 ● 公司所处行业竞争程度、进入壁垒、公司自有技术、专利水平、是否具有持续的创新力；  
 ● 公司的行业地位、发展前景、是否具有并购价值等等。  
 综上所述，本基金根据上述定量指标确定相应的估值水平，鉴于相对估值法可能存在的某些局限性，本基金还采用了相对估值模型，比如DCF、DDM+EVGA模型，进行估值再检验，并据此上述定性指标给出相应的折价水平，最终确定股票合理价格区间，并动态跟踪上述指标的变动进行价格区间的调整。  
 除此之外，本基金更注重通过研究团队的上市公司实地调研获得最新、最为准确的信息，及时跟踪和调整各级别股票，并最终确定具体的投资组合。

3. 投资组合策略  
 本基金在资产配置中考虑确定性模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行投资。主要运用的投资策略为：正股价值驱动型的杠杆投资策略、组合套利策略以及复制性组合投资策略等。  
**4. 债券投资策略**  
 本基金将采取久期策略、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杠策略和个券选择策略等投资策略。发现、识别并利用市场中的定价错误。这些投资策略是在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上作出的。  
 二、投资决策程序  
 为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻与实施，本基金遵循以下投资决策依据及其有效的决策程序：  
 1. 投资决策依据  
 (1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；  
 (2) 宏观经济及国内外的经济环境；  
 (3) 投资品种；  
 (4) 海外及国内货币政策、利率走势；  
 (5) 海外及国内证券市场政策；  
 (6) 行业及行业发展状况；  
 (7) 上市公司状况；  
 (8) 市场的走势。  
 2. 决策机制与程序  
 本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。  
 投资决策委员会是本基金的最高投资决策机构，其主要职责是根据基金投资目标和市场的判断决定本基金的总体投资策略、审批基金经理提出的资产配置方案等重大投资决策、并对基金经理投资决策定期召开会议，在紧急情况下可召开临时会议。  
 具体的基金投资决策程序如下：  
 (1) 研究策划  
 研究员通过自身研究及借助外部研究机构有关宏观分析、市场分析、行业分析、公司分析、个股分析及数据挖掘等各类报告，提出本基金投资备选品种的挖掘和更新方案，经投资研究联席会议讨论并最终决定本基金投资备选品种。为本基金的投资管理提供决策依据。  
 (2) 资产配置  
 投资决策委员会定期召开会议，并依据基金管理部、研究部的报告确定基金资产配置的比例；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议作出决策。  
 (3) 构建投资组合  
 基金经理根据对股票市场和债券市场的判断构建基金组合，并报投资决策委员会备案。  
 (4) 组合的监控和调整  
 研究员部跟踪基金经理投资组合进行跟踪。研究员应保持对个股和个股的定期跟踪，并及时向基金经理反馈个股和个股的最新信息，以利于基金经理作出相应的调整。  
 (5) 投资组合下达  
 基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至交易室。  
 (6) 指令执行及反馈  
 交易员依据投资指令进行操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。交易完成后，由交易员完成交易日志和跟踪反馈，交易日志存档备案。  
 (7) 风险控制  
 风险管理委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，监察稽核部监督投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制。基金经理依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险。  
 (8) 业绩评价  
 基金经理与相关研究员定期将对基金的业绩进行归因分析，找出基金投资管理的长处和不足，为日后的管理提供客观的依据。

**第九部分 基金业绩比较基准**  
 本基金的业绩比较基准为：80%×沪深300指数+20%×中证国债指数  
 如果该业绩比较基准计算方法编制法被修改或更改指数名称，或有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权以此新基准进行跟踪。业绩比较基准的调整须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定公告上公告，并在更新的招募说明书中列示。  
**第十部分 基金的风险收益特征**  
 本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。  
**第十一部分 基金的投资组合报告**  
 基金管理人的董事会及董事承诺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。  
 基金托管人招商银行股份有限公司承诺，复核了本投资组合报告，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源自兴业全球基金组合报告2015年第3季度报告，所载数据截至2015年9月30日，本报告中所有列示的数据未经审计。  
 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	1,479,866,933.47	72.15
	其中:股票	1,479,866,933.47	72.15
2	固定收益投资	108,817,363.00	5.31
	其中:债券	108,817,363.00	5.31
3	货币支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
6	银行存拆及清算备付金合计	334,793,707.21	16.32
7	基金合同资产	127,552,850.81	6.32
8	合计	2,051,030,854.49	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	227,240,195.87	11.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	772,675,644.45	39.12
D	电力、热力、燃气及生产供应业	83,166,248.70	4.21
E	建筑业	47,459,506.60	2.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	47,459,506.60	2.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,527,311.10	11.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	32,908,000.00	1.67
L	租赁和商务服务业	-	-

证券代码:601599 证券简称:鹿港科技 公告编号:2015-078  
**江苏鹿港科技股份有限公司**  
**关于非公开发行股票摊薄即期收益的风险提示性公告**

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
 国务院办公室于2015年12月25日发布了《国务院办公厅关于进一步盘活资本市场中小投资者合法权益保护工作的意见》(国办发【2015】110号，以下简称“《意见》”)，《意见》在“公司首次公开发行股票、上市公司募集资金使用及并购重组摊薄即期回报的，应当承诺并兑现填补回报的具体措施”。江苏鹿港科技股份有限公司(以下简称“公司”)就《意见》中有关非公开发行股票事项(以下简称“本次发行”)对即期回报摊薄的影响进行了认真分析，并就本次发行对公司主要财务指标的影响(一)财务指标计算主要假设  
 1. 假设宏观经济环境、发生业务情况没有发生重大不利变化；  
 2. 公司经营环境未发生重大不利变化；  
 3. 公司2015年度发行前后的财务指标是基于2014年度审计报告的数据。同时，考虑到公司业绩受到宏观经济、行业周期、前期增长光影视有限公司(以下简称“世纪光视”)、浙江天意影视有限公司(以下简称“天意影视”)业绩波动以及业务发展战略等因素影响，2015年公司整体收益情况较难预测，假设2015年收益情况有以下三种情形：  
 (1) 假设2015年度归属于母公司的净利润与2014年度审计报告的数据持平，即2015年归属于母公司所有者的净利润仍为5,939.75万元；  
 (2) 假设2015年度归属于母公司的净利润较2014年度审计报告的数据增长10%，即2015年归属于母公司所有者的净利润为6,533.73万元；  
 (3) 假设2015年度归属于母公司的净利润较2014年度审计报告的数据增长20%，即2015年归属于母公司所有者的净利润为7,127.20万元；  
 4. 本次非公开发行预计于2015年末完成，该完成时间仅为估计；  
 5. 本次非公开发行股票募集资金总额预计不超过10亿元人民币(含发行费用)，募集资金为上限10亿元，暂不考虑发行费用；  
 6. 本次非公开发行股票数量不超过10,582,016股，假设非公开发行股票数量为10,582,016股发行；  
 7. 本次测算未考虑本次非公开发行股票对公司生产经营、财务状况(如财务费用、投资收益)的影响；  
 8. 在预测发行后公司的净资产时，未考虑除募集资金、净利润和利润分配之外的其他因素对净资产的影响；  
 9. 上述假设及对公司非公开发行股票摊薄即期回报对公司主要财务指标的影响，不代表公司对2015年经营业绩及趋势的判断，亦不构成盈利预测。投资者不应据此进行投资决策，投资者据此进行投资决策造成损失的，公司不承担赔偿责任。  
 (二)对投资者主要财务指标的影响  
 基于上述假设和公司已经发生的现实分红等因素，公司测算了本次非公开发行股票对公司的每股收益和净资产收益率等主要财务指标的影响，具体如下：

项目	2014年度/2014.12.31		2015年度/2015.12.31	
	本次发行前	本次发行后	本次发行前	本次发行后
总股本(亿股)	37,742.7123	37,742.7123	48,324.7229	-
2014年度现金分红(亿元)	2,699.42	-	-	-
本次发行募集资金总额(亿元)	-	-	100,000.00	-

假设情形1:假设2015年度归属于母公司的净利润与2014年度审计报告的数据持平,即2015年归属于母公司的净利润仍为5,939.75万元

归属于母公司的净利润(万元)	5,939.75	5,939.75
基本每股收益(元/股)	0.16	0.16
稀释每股收益(元/股)	0.16	0.16
每股净资产(元/股)	3.82	3.91
加权平均净资产收益率	5.73%	4.08%

假设情形2:假设2015年度归属于母公司的净利润较2014年度审计报告的数据增长10%,即2015年归属于母公司的净利润为6,533.73万元

归属于母公司的净利润(万元)	5,939.75	6,533.73
基本每股收益(元/股)	0.16	0.17
稀释每股收益(元/股)	0.16	0.17
每股净资产(元/股)	3.82	3.92
加权平均净资产收益率	5.73%	4.48%

假设情形3:假设2015年度归属于母公司的净利润较2014年度审计报告的数据增长20%,即2015年归属于母公司的净利润为7,127.20万元

归属于母公司的净利润(万元)	5,939.75	7,127.20
基本每股收益(元/股)	0.16	0.19
稀释每股收益(元/股)	0.16	0.19
每股净资产(元/股)	3.82	3.94
加权平均净资产收益率	5.73%	4.87%

注:1. 本次发行前基本每股收益=当期归属于母公司的净利润÷发行前总股本；  
 2. 本次发行后基本每股收益=当期归属于母公司的净利润÷(发行前总股本+本次新增发行股份×发行月份次月至年末的月份数÷12)；  
 3. 每股净资产=期末归属于母公司的净资产÷总股本；  
 4. 本次发行前加权平均净资产收益率=当期归属于母公司的净利润÷(期初归属于母公司的净资产+当期归属于母公司的净利润÷2-本期现金分红×分红月份次月至年末的月份数÷12)；  
 5. 本次发行后加权平均净资产收益率=当期归属于母公司的净利润÷(期初归属于母公司的净资产+当期归属于母公司的净利润÷2-本期现金分红×分红月份次月至年末的月份数÷12-本次发行募集资金总额×发行月份次月至年末的月份数÷12)；  
 6. 本次非公开发行募集资金用于投资互联网影视项目建设和偿还银行贷款，符合公司发展要求，公司的总股本和净资产将有所增加，由于募集资金产生收益需要一定的时间，公司净利润和股东回报仍主要依赖公司现有业务。在公司总股本和净资产均增加的情况下，未来每股收益和加权平均净资产收益率等财务指标在短期内可能出现一定幅度的下降，特此提醒投资者关注本次非公开发行可能摊薄即期收益的风险。  
 三、公司应对本次非公开发行股票摊薄即期回报采取的措施  
 为降低本次非公开发行股票摊薄公司即期收益的影响，公司拟通过提升公司整体实力，提高募集资金使用效率和加强募集资金使用管理，优化投资回报机制等措施，从而提高提升公司盈利水平，增强销售收入，增强未来收益，实现可持续发展，以填补回报。相关措施的具体内容如下：  
 1. 提升公司整体实力  
 2014年，公司通过收购世纪光视影视产业，并形成了毛纺织和影视两大体系。  
 为进一步增强公司影视业务制作及盈利能力，引入新的影视行业上下游资源，保证互联网影视项目的顺利实施。2015年7月，公司与浙江天意影视有限公司(以下简称“天意影视”)股东及实际控制人签订正式协议，购买天意影视收购及增资形式天意影视51%股权。  
 为了保障投资项目实施能够顺利核算，经公司第三届董事会第十次会议批准，公司出资1亿元人民币投资设立鹿港互联网(北京)有限公司(以下简称“鹿港影视”)。2015年7月，鹿港影视于北京注册成立，注册资本1亿元人民币。  
 公司未来将通过毛纺织业务和影视业务进一步提升公司整体实力，具体措施如下：  
 (1) 毛纺织业务  
 ①继续以销售龙头的指导思想，提高营销管理水平 and 开发力度。  
 A. 根据客户的不同需求，进一步细分市场和客户；  
 B. 加强国内外市场的开拓，以重点大客户为公司新增业务的主要增长点，同时开发有较大增长潜力和高附加值的客户；  
 ②进一步优化产品结构，做精做细全品类产品，坚持持续营销，提高产品的附加值。  
 ③继续做强新产品开发，提高产品技术、新材料的改进。通过技术创新、技术合作等方式开发高端产品，争取在竞争中占据有利位置，学习国际先进经验，合理设计工艺，规范生产流程，确保生产成本。除原有的精纺纱线、半精纺纱线、呢绒面料等产品外，增加粗纺纱、花式纱、粗纺面料、针织面料等新产品开发和销售。  
 ④进一步加强成本控制，提高生产效率。一方面，强化生产管理，做好节降降耗，控制水、电、燃料、机配件的消耗；另一方面，加强人力资源管理，规范生产和管理流程，提高全员劳动效率。  
 ⑤继续强化目标责任制考核力度，改革考核方式，层层压实落实各项指标考核，并将各项指标考核到

M	科学研究和技术服务业	-	-
N <td>水利、环境和公共设施管理业</td> <td>-</td> <td>-</td>	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O <td>批发和零售业</td> <td>-</td> <td>-</td>	批发和零售业	-	-
P <td>教育</td> <td>-</td> <td>-</td>	教育	-	-
Q <td>卫生和社公事业</td> <td>-</td> <td>-</td>	卫生和社公事业	-	-
R <td>文化、体育和娱乐业</td> <td>92,389,982.75</td> <td>4.68</td>	文化、体育和娱乐业	92,389,982.75	4.68
S <td>综合</td> <td>-</td> <td>-</td>	综合	-	-
合计		1,479,866,933.47	74.92

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	300054	康强股份	7,549,400	108,939,140.70	5.52
2	300063	天龙集团	2,555,759	90,729,444.50	4.59
3	300271	华宇软件	1,879,000	66,235,067.25	3.35
4	300210	森远股份	4,588,781	65,619,568.30	3.32
5	300336	新化股份	2,606,239	65,260,234.56	3.30
6	300113	顺络科技	1,294,035	55,992,239.30	2.81
7	002280	联华医药	1,526,340	53,818,748.40	2.72
8	002234	民和股份	5,206,126	51,332,402.36	2.60
9	000858	五粮液	2,346,549	50,849,716.83	2.57
10	300297	蓝盾股份	2,007,599	47,881,236.15	2.42

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	018001	国开1301	1,014,350	102,358,058.50	5.18
2	018002	国开1302	59,070	6,459,304.50	0.33

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贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	1,014,350	102,358,058.50	5.18
2	018002	国开1302	59,070	6,459,304.50	0.33

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。  
 10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
 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。  
 (3) 本期国债逆回购投资情况  
 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  
 股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。  
 3. 本期国债逆回购投资情况  
 国债逆回购不属于本基金的投资范围，故此项不适用。  
 本基金本报告期末未持有国债逆回购。  
 (4) 报告期末本基金持有的国债逆回购投资余额和占比  
 国债逆回购不属于本基金的投资范围，故此项不适用。  
 11. 投资组合报告附注  
 (1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在规定期限内前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
 (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。  
 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,040,950.08
2	应收证券清算款	26,815,165.98
3	应收利息	4,698,724.24
4	应收申购款	93,634,010.25
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	127,552,850.81

(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	000858	五粮液	50,849,716.83	2.57	筹划重大事项

(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。  
**第十二部分 基金的投资**  
 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。投资者有风险，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。  
 本基金自2010年9月22日起，基金合同截止于2015年9月30日。

阶段	净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年第3季度	-12.73%	3.20%	-22.64%	2.67%	9.91%
2015年半年度	58.76%	1.80%	21.97%	1.81%	36.79%
2015年前三季度	26.48%	1.32%	11.92%	1.47%	14.56%
2014年度	38.33%	1.06%	42		