（上接B49版）

注：其他项中为本基金持有的私募债，明细如下：

代码	名称	数量	票面利率（%）	期限（年）
125178	13徐水务	100,000	9.5	3年，附债券存续期内的第2年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权
125139	13惠农债	50,000	9	3年，附债券存续期内的第2年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权
125169	13淮软01	50,000	10	3年，附债券存续期内的第2年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权

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	041360005	13鲁商CP001	200,000	20,138,000.00	10.25
2	122276	13魏桥01	200,000	19,926,000.00	10.14
3	041369020	13方正CP001	200,000	19,844,000.00	10.10
4	111060	10佳城投	150,000	15,059,700.00	7.67
5	041373001	13黔桂发电CP001	100,000	10,080,000.00	5.13

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

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.2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。

8.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

9. 投资组合报告附注

9.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

9.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

9.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,368.08
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,178,945.17
5	应收申购款	11,317.26
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,192,630.51

9.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110020	南山转债	1,366,950.00	0.70
2	110023	民生转债	482,650.00	0.25
3	110015	石化转债	381,440.00	0.19

9.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

十二、基金的业绩

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。基金业绩数据截至2013年12月31日。

1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

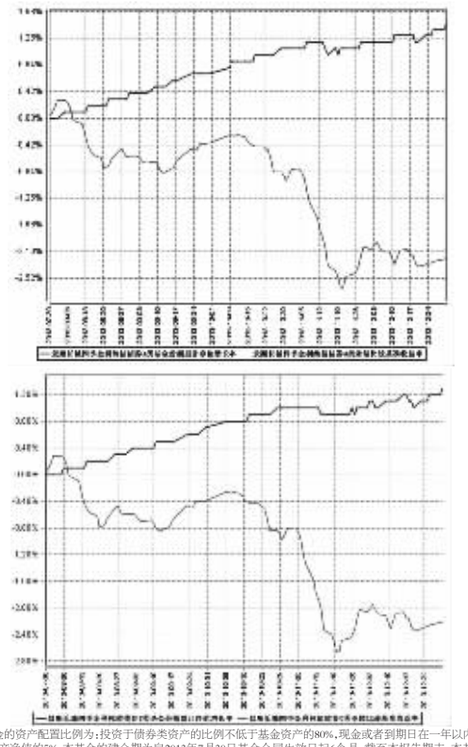
景顺长城四季金利纯债债券A类

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
2013年7月30日 至 2013年12月31日	1.50%	0.04%	−2.21%	0.09%	3.71%	−0.05%

景顺长城四季金利纯债债券C类

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
2013年7月30日 至 2013年12月31日	1.30%	0.05%	−2.21%	0.09%	3.51%	−0.04%

2. 自基金合同生效以来基金累计份额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：本基金的资产配置比例为：投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%，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%。本基金的建仓期为自2013年7月30日基金合同生效日起6个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2013年7月30日）起至本报告期末不满一年。

十三、基金费用概览

一、与基金运作有关的费用

（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、本基金C 类基金份额计提的销售服务费；

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、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、证券账户开户费用；

10、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。

（二）、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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.6%÷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，基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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，基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日C 类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H 为C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第4－10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。

二 、与基金销售有关的费用

1、基金认购费用

本基金A 类基金份额在投资者认购时收取认购费，C 类基金份额在认购时不收取认购费。投资者在认购A 类基金份额时需交纳的认购费费率按认购金额递减，投资者认购需全额缴纳认购费用。认购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用，投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的认购费率。

拟实施特定申购费率的养老金客户范围包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括：

1、全国社会保障基金；

2、可以投资基金的地方社会保障基金；

3、企业年金单一计划以及集合计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司也拟将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人的直销中心认购本基金A 类基金份额的养老金客户认购费率见下表：

认购金额（M）	A类份额认购费率
M＜50万	0.24%
50万≤M＜200万	0.12%
200万≤M＜500万	0.032%
M≥500万	1000元/笔

其他投资者认购本基金A 类基金份额认购费率见下表：

认购金额（M）	A类份额认购费率
M＜50万	0.60%
50万≤M＜200万	0.30%
200万≤M＜500万	0.08%
M≥500万	1000元/笔

（2）计算公式

①认购A 类基金份额时，认购份数的计算方法如下：

当认购费用适用比例费率时：

净认购金额＝认购金额／（1＋认购费率）

认购费用＝认购金额－净认购金额

认购份额＝（净认购金额＋认购期间利息）／基金份额初始面值

当认购费用适用固定金额时：

认购费用＝固定金额

净认购金额＝认购金额－认购费用

认购份额＝（净认购金额＋认购期间利息）／基金份额初始面值

②认购C 类基金份额时，认购份数的计算方法如下：

认购份额＝（认购金额＋认购期间利息）／基金份额初始面值

基金认购采取金额认购的方式，认购金额计算结果按照四舍五入的方法，保留小数点后两位，认购份额计算结果按尾数舍去的方法，保留小数点后两位，舍去部分所代表的资产归基金所有。

2、基金申购费用

（1）申购费

本基金基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。在申购时收取的申购费称为前端申购费。

投资者在申购A 类基金份额时需交纳的申购费费率按申购金额递减。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

通过基金管理人的直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（M）	A类份额申购费率
M＜50万	0.32%
50万≤M＜200万	0.16%
200万≤M＜500万	0.04%
M≥500万	1000元/笔

其他投资者申购本基金A类基金份额的申购费率见下表：

申购金额（M）	A类份额申购费率
M＜50万	0.80%
50万≤M＜200万	0.40%
200万≤M＜500万	0.10%
M≥500万	1000元/笔

投资者如申购C 类基金份额，则申购费为0。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、登记等各项费用，不列入基金财产。

（2）计算公式

A 类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日A 类基金份额净值为基准计算，申购份额的计算结果按尾数舍去的方法，保留小数点后两位，舍去部分所代表的资产归基金所有。

本基金的A 类基金份额申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

当申购费用适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额－净申购金额

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

当申购费用适用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额－申购费用

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

C 类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额，以申请当日C类基金份额净值为基准计算，计算结果按尾数舍去的方法，保留小数点后两位，舍去部分所代表的资产归基金所有。

本基金的C 类基金份额申购时不收取申购费用，申购金额即为净申购金额。

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

3、基金赎回费用

（1）赎回费率

A 类及C 类基金份额均收取赎回费，赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

赎回费率具体如下表所示：

A类份额赎回费		C类份额赎回费	
60天以内	0.30%	30天以内	0.30%
60天以上（含）	0	30天以上（含）	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于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。

（2）计算公式

A 类及C 类基金份额赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金A 类及C 类基金份额的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额＝赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额＝赎回金额－赎回费用

4、基金转换费用

（1）转换费率

本基金的转换费用由赎回费和申购补差费组成，转出时收取赎回费，转入时收取申购补差费。其中赎回费的收取标准遵循本招募说明书的约定，申购补差费的收取标准为：申购补差费＝ MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】。

（2）计算公式

本基金A类及C类基金份额的转换交易均包括了基金转出和基金转入，其中：

①基金转出时赎回费的计算：

由股票基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时：

转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益（全额转出时）

赎回费用＝转出总额×转出基金赎回费率

转出净额＝转出总额－赎回费用

②基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额＝转出净额－申购补差费

其中，申购补差费＝ MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】

转入份额＝净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

三、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。

四、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

1、 在“第二部分、释义”部分，更新了基金法及相关法规的修订信息；

2、在“第三部分、基金管理人”部分，更新了基金管理人基本情况、主要人员情况、基金经理和投资决策委员会委员等的相关信息；

3、在“第四部分、基金托管人”部分，更新了托管人相关情况信息；

4、在“第五部分、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构的相关信息；

5、在“第七部分、基金备案”部分，增加了基金合同生效的相关信息；

6、在“第八部分、基金份额的申购、赎回、转换及其他登记业务”部分，更新了申购、赎回及转换的开始日及业务办理时间、申购的数额限制、赎回后的最低保有份额限制，增加了基金转换的相关规则，并更新了基金定期定额投资计划相关的信息；

7、在“第九部分、基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告，数据截至2013年12月31日；

8、更新了“第十部分、基金的业绩”，数据截至2013年12月31日；

9、在“第十四部分、基金的费用与税收”部分，增加了基金销售有关费用的相关信息；

10、在“第二十一部分、对基金份额持有人的服务”部分，更新了对基金份额持有人服务的相关信息；

11、在“第二十二部分、其它应披露事项”部分，更新了近期发布的与本基金有关的公告目录，目录更新至2014年 1月30日。

景顺长城基金管理有限公司

二○一四年三月十五日

（上接B50版）

因此，本基金将通过分析公司管理模式创新、技术创新等内部创新情况，以及公司产品和服务的创新速度和力度，判断上市公司是否具备足够的创新能力，从中挖掘出能够在变革环境中保持长期优势地位的上市公司。

③财务指标分析

本基金认为，各类财务指标是分析上市公司最直接和最重要的方法之一，因此，本基金将通过财务指标分析，验证通过上述步骤筛选出的上市公司的竞争地位。具体而言，本基金将通过公司净资产收益率、每股营业收入等指标与行业平均水平的比较，分析上市公司在行业中所处的地位；通过主营业务利润率、收入现金比率等指标，分析上市公司相对上下游的议价能力；通过分析上市公司每股收益增长率、每股经营性现金流增长率等指标，分析上市公司发展战略、创新行动的实施效果。

此外，根据反映行业特性的关键指标的不同，本基金在财务指标分析过程中，还将通过比较分析方法，重点关注关键指标居于行业前二分之一的上市公司，以及趋势分析的方法，重点关注关键指标改善趋势明显的上市公司，作为对上述优选结果的补充。

④估值水平分析和流动性筛选

本基金对于经过上述标准筛选出来的上市公司，进一步考察股票的估值水平和流动性，以构建股票组合。本基金将结合绝对估值和相对估值方法，分析投资的安全边际，并通过估值水平的历史纵向比较和与同行业、全市场横向比较，筛选出具有估值吸引力的上市公司；此外，为了保持投资组合的流动性，本基金还将对拟投资股票的流通市值规模和交易活跃程度进行分析，筛选出具有足够流动性的投资标的。

2）受益于外需增长行业中的个股选择策略

本基金在严格遵守基金合同约定的资产配置比例的基础上，将通过投资于受益于外需增长行业中的优质上市公司，以增加组合超额收益、分散组合风险。其中，本基金将从拥有自主知识产权、掌握核心生产技术、在国际上具备品牌认可度、拥有成本优势等角度，重点选择能够提供高附加值产品和服务、具有比较优势的产品和服务，从而保证足够的利润空间，并且估值合理、流动性充分的优质上市公司，力争实现基金资产的长期稳定增值。

3.债券投资

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

①）债券投资组合策略

本基金的投资组合策略采用自上而下进行分析，从宏观经济和货币政策等方面分析，判断未来的利率走势，从而确定债券资产的配置策略；同时，在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合管理手段进行债券日常管理。

1）久期管理

本基金通过宏观经济及政策形势分析，对未来利率走势进行判断，在充分保证流动性的前提下，确定债券组合久期以及可以调整的范围。

2）收益率曲线形变预测

收益率曲线形状的变化将直接影响本基金债券组合的收益情况。本基金将根据宏观面、货币政策面等综合因素，对收益率曲线变化进行预测，在保证债券流动性的前提下，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合。

②）个券选择策略

在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

1）信用等级高、流动性好；

2）资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；

3）在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；

4）公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。

4.其他金融工具

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础，结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等。

（二）投资管理程序

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。本基金的投资管理程序如下：

1.研究员提供研究报告，以研究驱动投资

本基金严格实行研究支持投资决策机制，加强研究对投资决策的支持工作，防止投资决策的随意性。研究员在熟悉基金投资目标和投资策略的基础上，对其分工的行业和上市公司进行综合研究、深度分析，广泛参考和利用外部研究成果，拜访政府机构、行业协会等，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，调查上市公司和相关的供应商、终端销售商，考察上市公司真实经营状况，并向投资决策委员会和基金经理定期或不定期撰写提供宏观经济分析报告、证券市场行情报告、行业分析报告和上市公司及发债主体研究报告等。

2.投资决策委员会审议并决定基金投资重大事项

投资决策委员会将定期分析投资研究团队所提供的研究报告，在充分讨论宏观经济、股票和债券市场的基础上，根据基金合同规定的投资目标、投资范围和投资策略，依据基金管理人的投资管理制度，确定基金的总体投资计划，包括基金在股票、债券及现金等大类资产的投资比例等重大事项。

3.基金经理构建具体的投资组合

基金经理根据投资决策委员会的资产投资比例等决议，参考研究团队的研究成果，根据基金合同，依据专业经验进行分析判断，在授权范围内构建具体的投资组合，进行组合的日常管理。

4.交易部独立执行投资交易指令

基金管理人设置独立的交易部，由基金经理根据投资方案的要求和授权以及市场的运行特点，作出投资操作的相关决定，向交易部发出投资指令。交易部接到基金经理的投资指令后，根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查，确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行，对交易情况及时反馈，对投资指令进行监督；如果市场和个股交易出现异常情况，及时提示基金经理。

5.基金绩效评估

基金经理对投资管理策略进行评估，出具自我评估报告。金融工程小组就投资管理进行持续评估，定期提出评估报告，如发现原有的投资分析和投资决策同市场情况有较大的偏离，立即向主管领导和投资决策委员会报告。投资决策委员会根据基金经理和金融工程小组的评估报告，对于基金业绩进行评估。基金经理根据投资决策委员会的意见对投资组合进行调整。

6.基金风险监控

监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，包括投资集中度、投资组合比例、投资限制、投资权限等交易情况，风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估，并提出风险防范措施。

7.投资管理程序的调整

基金管理人在保证基金份额持有人利益的前提下，有权根据投资需要和环境变化，对投资管理的职责分工和程序进行调整，并在招募说明书或其更新中予以公告。

九、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

本基金是股票型基金，基于本基金产品特征，股票投资对象和指数的市场代表性，采用沪深 300 指数和上证国债指数加权组成的复合型指数作为本基金的业绩比较基准，能够真实反映本基金的风险收益特征，同时也能较恰当衡量本基金的投资业绩。

在本基金的运作过程中，如果法律法规变化或者出现更有代表性、更权威、更为市场普遍接受的业绩比较基准，则基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会核准后公告，对业绩比较基准进行变更。

十、风险收益特征

本基金属于主动投资的股票型证券投资基金，通常预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中的高风险收益品种。

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本投资组合报告截至时间为 2013 年 12 月 31 日，本报告中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	321,021,298.49	83.54
	其中：股票	321,021,298.49	83.54
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	29,700,000.00	7.73
	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	23,309,269.67	6.07
7	其他资产	10,239,090.35	2.66
8	合计	384,269,658.51	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	4,854,995.04	1.30
B	采矿业	–	–
C	制造业	229,737,848.15	61.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	17,926,583.40	4.81
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	19,925,645.04	5.34
J	金融业	30,322,550.54	8.13
K	房地产业	18,253,676.32	4.89
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	–	–
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	321,021,298.49	86.08

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	300090	盛运股份	533,162	18,495,389.78	4.96
2	300149	量子高科	1,058,654	18,314,714.20	4.91
3	601766	中国南车	3,256,300	16,314,063.00	4.37
4	300151	昌红科技	726,113	12,329,398.74	3.31
5	002518	科士达	643,850	12,168,765.00	3.26
6	002429	兆驰股份	899,844	12,147,894.00	3.26
7	300030	阳普医疗	668,427	11,770,999.47	3.16
8	000652	泰达股份	2,527,299	11,625,575.40	3.12
9	002292	奥飞动漫	352,958	11,527,608.28	3.09
10	300142	沃森生物	288,021	11,229,938.79	3.01

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。

7.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。

8.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

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

①）本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

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）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.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没有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。

②）报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

③）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	808,238.72
2	应收证券清算款	9,413,094.47
3	应收股利	–
4	应收利息	12,576.02
5	应收申购款	5,181.14
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,239,090.35

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	300149	量子高科	18,314,714.20	4.91	临时停牌
2	002518	科士达	12,168,765.00	3.26	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。

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。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2013年度	7.75%	1.52%	−5.30%	1.11%	13.05%	0.41%
2012年度	2.28%	1.31%	7.04%	1.02%	−4.76%	0.29%
2011年度（自2011年1月28日至2011年12月31日）	−25.60%	1.01%	−17.58%	1.01%	−8.02%	0.00%
自基金合同生效起至今（2013年12月31日）	−18.00%	1.30%	−16.46%	1.05%	−1.54%	0.25%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

十三、基金的费用

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作相关费用列示

①）基金管理人的管理费；

②）基金托管人的托管费；

③）基金财产划拨支付的银行费用；

④）基金合同生效后的基金信息披露费用；

⑤）基金份额持有人大会费用；

⑥）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

⑦）基金的证券交易费用；

⑧）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、与基金运作相关费用计提方法、计提标准和支付方式

①）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，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。

②）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，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。

③）除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（二）与基金销售相关费用

1、申购费用

本基金申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金的申购费率如下：

单笔申购金额 M	申购费率
M<50 万	1.50%
50万≤M<100 万	1.00%
100万≤M<500 万	0.50%
M≥500 万	每笔 1000 元

投资人同日或异日多次申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例配售方式对有效申购金额进行部分确认时，投资人申购费率按照申购申请确认金额所对应的费率计算，申购申请确认金额不受申购最低限额的限制。

2、赎回费用

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金的赎回费率为赎回金额的 0.5%。不低于赎回费总额的 25%应归入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《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，对 2013 年 8 月 29 日公布的《民生加银内需增长股票型证券投资基金招募说明书（2013 年第 2 号）》进行了更新。本更新招募说明书所载内容截止日为 2014 年 1 月 28 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 12 月 31 日，主要修改内容如下：

1、在“三、基金管理人”部分，更新了“（一）基金管理人概况”、“（二）主要人员情况”中的相关信息。

2、在“四、基金托管人”部分，更新了“（一）基金托管人情况”中的相关信息。

3、在“五、相关服务机构”中，对“（一）销售机构及联系人”、“（二）基金注册登记机构”信息进行了更新。

4、在“八、基金份额的申购、赎回”，对“（五）申购和赎回的金额”的相关信息进行了更新。

5、在“九、基金的投资”中，对“（十三）基金投资组合报告”内容进行了更新。

6、在“十、基金业绩”中，对基金业绩进行了更新。

7、在“二十二、其他应披露事项”中，更新了本次更新内容期间的历次公告。

民生加银基金管理有限公司

2014 年 3 月 15 日

证券代码：002248　　证券简称：华东数控　　公告编号：2014-009

威海华东数控股份有限公司第三届董事会第二十九次会议决议公告

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，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、董事会会议召开情况

威海华东数控股份有限公司（以下简称"公司"）第三届董事会第二十九次会议（以下称"本次会议"）通知于2014年3月10日以电子邮件、传真方式发出，于2014年3月14日9:00时在公司三楼会议室召开（威海经济技术开发区环山路698号）。会议由董事长汤世贤主持，应出席董事9人，实际出席董事9人，本次会议符合有关法律、法规及《公司章程》的有关规定，会议程序合法有效。公司监事及高管人员列席了本次会议。

二、董事会会议审议情况

1、审议通过《关于2013年度计提资产减值准备的议案》；

表决结果：9票同意，0票反对，0票弃权，同意票数占出席本次会议有表决权票数的100%。

《关于2013年度计提资产减值准备的公告》（公告编号：2014-011） 全文详见巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）和《中国证券报》、《证券时报》。

独立董事、董事会审计委员会均发表了同意的意见，《独立董事关于计提资产减值准备的独立意见》、《董事会审计委员会关于计提减值准备的合理性说明》全文详见巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）

三、备查文件

1、威海华东数控股份有限公司第三届董事会第二十九次会议决议；

2、独立董事关于计提资产减值准备的独立意见；

3、董事会审计委员会关于计提减值准备的合理性说明。

特此公告。

威海华东数控股份有限公司

董事会

二○一四年三月十五日

证券代码：002248　　证券简称：华东数控　　公告编号：2014-010

威海华东数控股份有限公司第三届监事会第二十六次会议决议公告

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