华商主题精选股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

基金管理人:华商基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计。

本报告期自2013年1月1日至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华商主题精选股票
基金主代码	630011
交易代码	630011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月31日
基金管理人	华商基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	690,604,790.73份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效管理投资风险的前提下,追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"为主、"自下为上"为辅的投资视角,在实际投资过程中充分体现"主题投资"这个核心理念。深入分析挖掘社会经济发展进程中各类投资主题得以产生和持续的内在驱动因素,重点投资于具有可持续发展前景的投资主题中的优质上市公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于其它类型的基金产品,属于较高风险、较高收益的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华商基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周亚红	田青
	联系电话	010-58573600	010-67595096
	电子邮箱	zhouyh@hsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4007008880	010-67595096
传真		010-58573520	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年5月31日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	54,536,175.37	-15,631,717.39
本期利润	150,527,871.76	-6,356,983.66
加权平均基金份额本期利润	0.4525	-0.0262
本期基金份额净值增长率	63.42%	-2.40%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0959	-0.0774
期末基金资产净值	1,101,566,724.70	177,840,542.57
期末基金份额净值	1.595	0.976

注:1.本基金的基金合同于2012年5月31日生效,截至2012年12月31日,本基金运作未满1年。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

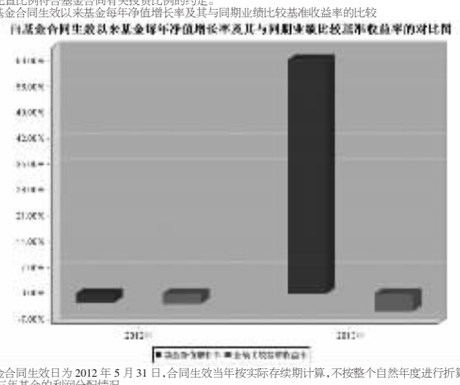
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.13%	1.47%	-2.25%	0.84%	2.12%	0.63%
过去六个月	29.67%	1.45%	4.85%	0.97%	24.82%	0.48%
过去一年	63.42%	1.53%	-4.73%	1.04%	68.15%	0.49%
自基金合同生效起至今	59.50%	1.39%	-7.36%	0.99%	66.86%	0.40%

3.2.2 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

注:①本基金合同生效日为2012年5月31日。

②根据《华商主题精选股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金主要投资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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、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,但须符合中国证监会的相关规定。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60%-95%;债券投资比例为基金资产的0%-35%;权证投资比例为基金资产净值的0%-3%;并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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。本基金在建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2012年5月31日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2012年5月31日)起至本报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华商基金管理有限公司由华龙证券有限责任公司、中国华电集团财务有限公司、济钢集团有限公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字[2005]160号文批准设立,于2005年12月20日成立,注册资本金为1亿元人民币。

华商基金管理有限公司自2012年5月31日华商主题精选股票型证券投资基金正式成立之日起,成为该基金的管理人。

目前本公司旗下管理十六只基金产品,分别为华商领先企业混合型证券投资基金(基金代码:630001)、华商盛世成长股票型证券投资基金(基金代码:630002)、华商收益增强债券型证券投资基金(基金代码:A类630003,B类630103)、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:630005)、华商产业升级股票型证券投资基金(基金代码:630006)、华商稳健双利债券型证券投资基金(基金代码:A类630007,B类630107)、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:630008)、华商稳定增利债券型证券投资基金(基金代码:A类630009,C类630109)、华商价值精选股票型证券投资基金(基金代码:630010)、华商主题精选股票型证券投资基金(基金代码:630011)、华商中证500指数分级证券投资基金(基金代码:母基金:166301,A类150110,B类150111)、华商现金增利货币市场型基金(基金代码:A类630012,B类630112)、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金(基金代码:630016)、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:630015)、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:000279)、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:000390)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁永强	基金经理,公司量化投资部总经理,投资决策委员会委员	2012年5月31日	-	11	男,经济学博士,中国籍,具有基金从业资格。2002年7月至2004年7月就职于华龙证券有限公司投资银行部,历任研究员、高级研究员;2004年7月至2005年12月担任华商基金管理有限公司筹备组成员;2007年5月15日至2008年9月23日担任华商领先企业混合型开放式证券投资基金基金经理助理,2008年9月23日至2012年4月24日担任华商盛世成长股票型证券投资基金基金经理,2009年11月24日至今担任华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①"任职日期"和"离职日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等,建立健全投资授权制度,确保各投资组合公平获得研究资源,享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,公司制定了《异常交易管理办法》,对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度,未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年资本市场基于转型的新旧产业间的分化演绎得十分充分,符合转型方向的行业比如文化传媒、科技等板块表现十分优异,创业板指数涨幅巨大,而大部分周期行业则少有机会,上证指数和沪深300等指数比较差。由于本基金的主要配置集中在反映转型的新兴产业和文化传媒行业,其中文化传媒行业表现尤其出色,因此在2013年取得了较好的投资业绩,大幅优于业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.595元,份额累计净值为1.595元。本年度基金份额净值增长率为63.42%,同期基金业绩比较基准的收益率为-4.73%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率68.15个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前,国内经济的转型与国际产业结构的调整交织在一起,诸多行业的发展略滞后甚至同步于国际发展的步伐。就全球来讲,新的工业革命本质上是构建起了以低碳为主要特征的能源网和以大数据化为主要特征的信息网,基于能源利用模式和信息沟通方式的大变革刚刚开始,各个行业所基于的外部环境在快速发生变化,利用这两大新网改造甚至改变人类的生活方式和企业的盈利模式,未来资本市场的发展基本上会顺应这个趋势。

基于此,实体产业可以大体上分为这两张网的支持行业和应用行业,支持行业最大的趋向一定是以低碳作为主要特征的,因此新能源、新材料、节能环保、新计算等等都可能成为未来重点发展的方向;应用行业最重要的特征就是大数据思维,通过大数据的占有、传输和分析去改变我们的吃穿住行玩乐和生产模式,让人的消费感受更好,让人的劳动更加轻松。比如居住的智能化和节能化,出行的电动化和智能化,娱乐更加自我化和游戏化,人工的机器替代等等。

社会资源的配置必然是轮动而不是一次性的,五到十年后经济的产业结构是现在资源进行不断调配的标杆,因此,基于未来产业结构缺乏到当前的产业或主题轮动就是社会配置的基础,也是投资对社会发展支持的核心所在。基于此,主题轮动将成为未来很长一段时间的市场特征。

针对这些新的产业方向和市场特征,2014年本基金配置的重点主要包括以下方面:

基于新股发行常来的包括新股本身、新股替代和新股受益三类机会;基于使用成本的降低而带来更大应用空间的产业机会,包括光伏、LED、储能等;基于优质军工资产证券化带来的军工行业的整体性机会;环保问题带来的水、空气净化行业机会,以及环保压力带来的某些传统行业的产业集中度提升的机会;基于4G网络扩张带来的应用机会比如视频传输等等;而基于新型城镇化的需求刺激机会比如文化消费、教育医疗、养老等,将是市场的长期方向。

围绕这些方向,本基金将精选优质个股进行基本配置。在基本配置完成的基础上,本基金将寻求主题轮动的机会,对一些大的主题进行阶段性的重点配置,以期能为投资者获取较好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列7.4 报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性,公司成立估值委员会和风险内控小组。公司总经理任估值委员会负责人,委员包括投资总监、基金运营部经理、基金会计主管、研究发展部经理(若负责人认为必要,可适当增减委员会委员),主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算,并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人,成员包括监察稽核部和基金事务相关人员(若负责人认为必要,可适当增减小组成员),主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算,并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人,成员包括监察稽核部和基金事务相关人员(若负责人认为必要,可适当增减小组成员),主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

在严格遵循公平、合理原则下,公司制订了健全、有效的估值政策流程:

1.基金运营部基金会计应实时监控股票停牌情况,对于连续5个交易日不存在活跃市场的股票及时提示研究发展部并发出预警;

2.由研究发展部估值小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值,若确定用估值方法计算公允价值,则在参考证券业协会的意见或第三方意见后确定估值方法,并确定估值所用的行业指数和指数日收益率;

3.由估值委员会计算该投资品种的公允价值,并将计算结果提交风险内控小组;

4.风险内控小组审核该投资品种估值方法的适用性和公允性,出具审核意见并提交公司管理层;

5.公司管理层审批后,该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性,风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行审核,并建立风险控控标准。在考虑投资策略的情况下,公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形,已确定的估值政策和程序应当持续适用。

风险内控小组和估值委员会应互相协助定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后应及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议,风险内控小组审核并提交公司管理层,待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资品种时,应由风险内控小组对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时,风险内控小组应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性,通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未进行利润分配。

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华龙证券有限责任公司	253,819.94	13.51%	188,844.53	28.11%
关联方名称	上年度可比期间 2012年5月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
华龙证券有限责任公司	502,474.19	89.61%	70,097.64	54.62%

注:1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年5月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,057,409.10	2,051,117.56
其中:支付销售机构的客户维护费	2,447,068.89	266,015.43

注:1.支付基金管理人华商基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

2.其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年5月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,176,234.84	341,852.96

注:1.支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

2.其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内基金管理人没有运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年5月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	142,023,456.68	364,432.92	21,538,338.91	165,804.16

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600187	国中水务	2013年6月25日	2014年6月23日	非公开发行流通受限	3.24	4.15	1,750,000	5,670,000.00	7,262,500.00	-

注:1.基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

2.本基金于2013年6月25日参与认购黑龙江国中水务股份有限公司(简称"国中水务")公开发行股票网下申购,以每股8.10元的价格申签700,000股。国中水务于2013年10月9日实施2012年度权益分派方案,向全体股东每10股转增15股。本基金新增1,050,000股。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601012	隆基股份	2013年12月17日	重大事项	15.41	2014年1月13日	14.78	3,001,650	39,077,541.62	46,255,426.50	-
002665	首航节能	2013年10月24日	重大资产重组	26.77	2014年3月18日	29.45	879,844	21,523,328.15	23,553,423.88	-
300012	华测检测	2013年11月15日	重大资产重组	16.15	2014年1月23日	17.77	933,186	12,630,984.19	15,070,953.90	-
600485	中创信测	2013年12月17日	重大资产重组	20.51	2014年1月13日	21.50	677,900	16,092,399.88	13,903,729.00	-

注:本基金截至2013年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额,因此没有作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额,因此没有作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为877,731,523.85元,属于第二层级的余额为106,046,033.28元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级138,176,961.02元,第二层级18,653,560.00元,无第三层级)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(v)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	983,777,557.13	85.55
	其中:股票	983,777,557.13	85.55
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	143,158,018.69	12.45
6	其他各项资产	23,013,417.84	2.00
7	合计	1,149,948,993.66	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	844,454,167.11	76.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,329,376.50	2.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	95,200,172.44	8.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,070,953.90	1.37
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	6,722,887.18	0.61
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	983,777,557.13	89.31

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002249	大洋电机	8,024,128	84,012,620.16	7.63
2	000536	华映科技	3,107,009	83,858,172.91	7.61
3	002371	七星电子	3,804,054	81,825,201.54	7.43
4	000661	长春高新	663,879	72,163,647.30	6.55
5	002292	奥飞动漫	2,055,744	67,140,599.04	6.10
6	002010	传化股份	5,545,936	55,071,144.48	5.00
7	601012	隆基股份	3,001,650	46,255,426.50	4.20
8	300288	朗玛信息	929,755	45,929,897.00	4.17
9	300272	开能环保	3,341,391	41,466,662.31	3.76
10	002577	雷柏科技	2,085,005	34,715,333.25	3.15

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000536	华映科技	83,375,422.94	46.88
2	000661	长春高新	68,656,080.42	38.61
3	002249	大洋电机	66,260,409.03	37.26
4	601012	隆基股份	56,973,379.88	32.04
5	002371	七星电子	56,770,021.76	31.92
6	002010	传化股份	54,996,068.25	30.92
7	300288	朗玛信息	43,522,238.05	24.47
8	002292	奥飞动漫	42,358,180.16	23.82
9	300272	开能环保	39,335,760.69	22.12
10	600315	上海家化	33,573,099.00	18.88
11	600783	鲁信创投	33,248,212.66	18.70
12	002118	紫鑫药业	32,362,198.99	18.20
13	600410	华胜天成	31,930,320.36	17.95
14	000547	闽福发A	28,895,569.04	16.25
15	002577	雷柏科技	28,330,516.04	15.93
16	600187	国中水务	28,177,730.87	15.84
17	002665	首航节能	24,891,597.92	14.00
18	600485	中创信测	23,754,080.11	13.36
19	000666	经纬纺机	23,234,560.22	13.06
20	600563	法拉电子	22,270,056.33	12.52
21	600718	东软集团	21,517,488.51	12.10
22	300091	金通灵	20,912,364.24	11.76
23	000590	紫光古汉	20,633,694.12	11.60
24	000776	广发证券	20,086,722.27	11.29
25	300166	东方国信	18,714,563.03	10.52
26	002281	光迅科技	17,242,704.04	9.70
27	300079	数码视讯	16,818,141.54	9.46
28	000917	电广传媒	16,674,891.36	9.38
29	300007	汉威电子	15,180,794.60	8.54
30	600837	海通证券	13,546,651.18	7.62
31	300229	拓尔思	12,607,275.07	7.09
32	002368	太极股份	12,604,395.40	7.09
33	000541	佛山照明	11,831,143.70	6.65
34	300136	信维通信	11,020,174.63	6.20
35	300324	旋极信息	10,343,012.75	5.82
36	600763	通策医疗	10,195,846.70	5.73
37	300142	沃森生物	10,099,043.45	5.68
38	002383	合众思壮	9,983,319.68	5.61
39	300101	振华科技	9,631,616.61	5.42
40	000716	南方食品	9,548,296.43	5.37
41	300198	纳川股份	9,411,227.42	5.29
42	300352	北信源	9,303,040.35	5.23
43	002466	天齐锂业	9,197,580.09	5.17
44	300140	启源装备	9,181,121.86	5.16
45	300347	泰格医药	8,365,738.41	4.70
46	300012	华测检测	8,252,792.95	4.64
47	600787	中储股份	8,119,013.06	4.57
48	000592	中福实业	8,060,177.00	4.53
49	000750	国海证券	7,561,527.49	4.25
50	002690	美亚光电	7,271,187.77	4.09
51	002623	亚玛顿	7,049,890.22	3.96
52	000915	山大华特	6,680,908.22	3.76
53	600391	成发科技	6,630,738.94	3.73
54	600536	中国软件	6,471,690.92	3.64
55	300114	中航电测	6,437,732.03	3.62
56	300059	东方财富	6,383,462.26	3.59
57	300327	中颖电子	6,304,379.11	3.54
58	002237	恒邦股份	6,121,690.65	3.44
59	300223	北京君正	5,793,283.00	3.26
60	300075	数字政通	5,734,158.87	3.22
61	600570	恒生电子	5,635,973.60	3.17
62	002340	格林美	5,581,745.89	3.14
63	000997	新大陆	5,374,315.74	3.02
64	300027	华谊兄弟	5,318,813.48	2.99
65	600100	同方股份	5,133,527.75	2.89
66	600562	国睿科技	4,689,255.13	2.64
67	002456	欧菲光	4,588,331.62	2.58
68	300188	美亚柏科	4,354,252.89	2.45
69	002524	光正集团	4,238,446.20	2.38
70	300022	吉峰农机	4,167,743.22	2.34
71	300177	中海达	4,151,127.00	2.33
72	300313	天山生物	3,631,425.75	2.04
73	000562	宏源证券	3,565,351.62	2.00

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600783	鲁信创投	42,666,498.18	23.99
2	002118	紫鑫药业	39,087,671.93	21.98
3	600410	华胜天成	29,438,831.06	16.55
4	600718	东软集团	24,648,947.56	13.86
5	000661	长春高新	22,859,372.67	12.85
6	000666	经纬纺机	22,486,177.91	12.64
7	601012	隆基股份	20,999,672.39	11.81
8	000917	电广传媒	19,511,330.26	10.97
9	300079	数码视讯	19,395,569.59	10.91
10	000776	广发证券	19,349,807.30	10.88
11	002281	光迅科技	18,327,094.95	10.31
12	000536	华映科技	16,952,411.61	9.53