诺安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:诺安基金管理有限公司
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 27 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 21 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其更新。

本年度报告摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安主题精选股票
基金主代码	320012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年 9 月 15 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
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	1,026,116,288.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选主题,稳健投资,力图在不同的市场环境下均可突破局限,在长期内获得超过比较基准的超额收益。
投资策略	本基金将实施积极主动的投资策略,具体由资产配置策略,股票投资策略,债券投资策略,权证投资策略四部分组成。 1.资产配置策略方面,本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,积极进行短期资产灵活配置,力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。 2.股票投资策略方面,本基金的股票投资策略由构建备选主题库、筛选主题、精选个股和构建组合四个步骤组成。 3.债券投资策略方面,本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。 4.权证投资策略方面,本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具,我们将结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。
业绩比较基准	75%沪深 300 指数+25%中证全债指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品种。

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		诺安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	田青
	联系电话	0755-83026688	010-67595096
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-8998	010-67595096
传真		0755-83026677	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	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

§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	2011年
本期已实现收益	109,354,983.09	-143,568,926.71	-117,265,289.36
本期利润	191,723,762.58	95,341,194.21	-349,462,103.63
加权平均基金份额本期利润	0.1507	0.0608	-0.2008
本期基金份额净值增长率	17.76%	7.32%	-20.96%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0394	-0.1503	-0.2084
期末基金资产净值	1,026,767,108.35	1,283,935,740.53	1,353,343,563.01
期末基金份额净值	1.001	0.850	0.792

注:① 上述基金业绩指标不包括持有人申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。

② 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。

③ 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

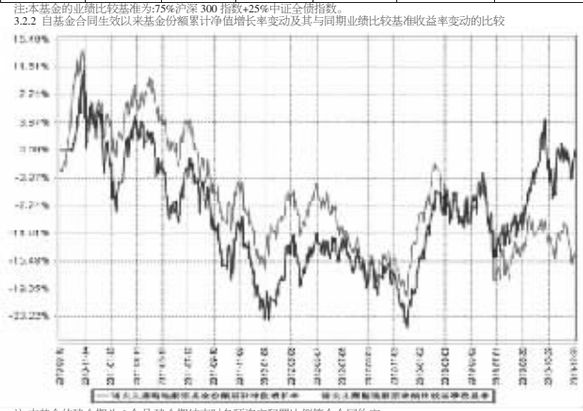
3.2 基金净值表现

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	2.77%	1.30%	-2.97%	0.85%	5.74%	0.45%
过去六个月	17.63%	1.15%	3.68%	0.97%	13.95%	0.18%
过去一年	17.76%	1.18%	-5.64%	1.05%	23.40%	0.13%
过去三年	-0.10%	1.11%	-17.19%	0.99%	17.09%	0.12%
自基金合同生效起至今	0.10%	1.15%	-14.12%	1.02%	14.22%	0.13%

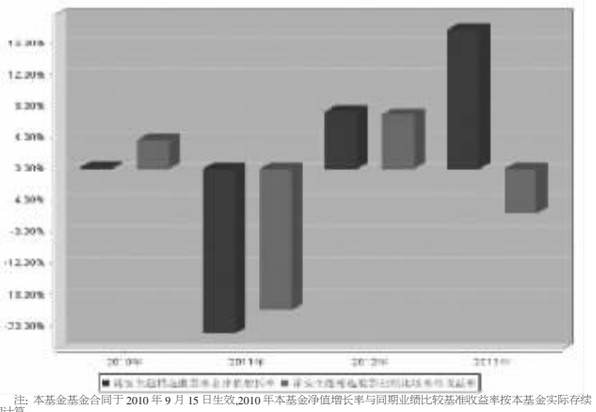
注:本基金的业绩比较基准为:75%沪深 300 指数+25%中证全债指数。

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:本基金的建仓期为 6 个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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: 本基金基金合同于 2010 年 9 月 15 日生效,2010 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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

截至 2013 年 12 月,本基金管理人共管理 29 只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鹄保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金及诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金。

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		
杨谷	副总经理、投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理、诺安多策略股票型证券投资基金基金经理	2010年 9 月 15 日	-	16	经济学硕士,CFA,具有基金从业资格。曾任职于平安证券公司综合研究所、西北证券公司资产管理部;2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监。曾于 2006 年 11 月至 2007 年 11 月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2006 年 2 月起任诺安股票证券投资基金基金经理,2010 年 9 月起任诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理,2013 年 4 月起任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安主题精选股票型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安主题精选股票型证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立会公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序,公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手间价、成交确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。此外,公司对连续四个季度期间内,公司管理的不同投资组合在日内、3 日内、5 日内的同向交易的交易价差进行了分析,未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内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

沪深 300 指数在 2013 年下跌了 7.65%,本基金上涨了 17.76%,强于本基金的比较基准-5.64%的涨幅,也强于同业股票型基金的平均涨幅。2013 年上半年,成长股和消费股表现突出,金融地产以及其他周期性的股票则处于熊市之中,在这一背景下,本基金 1 季度在食品、医药以及银行股上获得一定的收益,在环保主题以及军工主题上也阶段性的参与了;2 季度则减持了金融股,继续持有消费医药股票,但是本基金上半年在成长股上投资比例过少,影响了基金收益;3 季度开始,本基金把握住了乳业的投资机会和商业企业互联网转型的机会,下半年获得了 17.6%的收益。本基金 2013 年收益的主要来源还是在消费服务和科技创新两个长期看好的主题上面。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 1.001 元。本报告期基金份额净值增长率为 17.76%,同期业绩比较基准收益率为-5.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

利率高企和金融体系的资产膨胀影响了经济的复苏,经济数据从 2013 年下半年开始一直在低位反复,在这种背景下,蓝筹股一直难以走出反转行情。相反,消费服务和科技创新领域则黑马频出,其中有高估的品种,出现了调整,但是,同时,新的题材和新的品种又被发掘出来。这种特征预计在 2014 年还会延续。这两个主题依然是本基金长期看好的主题,本基金会继续在这两个主题中挖掘有潜力的个股。

同时,本基金也会关注价值股的机会。消费服务和科技创新两个领域个股活跃,但是很多乐观情绪也已经反映在了股价之中。相比之下,价值股则在价值的起沉中挣扎。一旦价值股能嫁接互联网的经营思路或者经营模式,其价值就有可能被市场重新关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务控会部、监察稽核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师胡小骏、王明静于 2014 年 3 月 24 日出具了德师报(审)字(14)第 P0329 号“无保留意见的审计报告”。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:诺安主题精选股票型证券投资基金

报告截止日: 2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年 12 月 31 日	上年度末 2012年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	90,287,243.62	85,204,862.37
结算备付金	3,207,652.10	1,157,219.99
存出保证金	476,480.31	859,433.94
交易性金融资产	973,949,649.20	1,202,762,002.26
其中:股票投资	763,757,214.60	989,555,377.58
基金投资	-	-
债券投资	210,192,434.60	213,206,624.68
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	10,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	495,707.98	871,435.91
应收股利	-	-
应收申购款	27,030,083.07	111,711.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,105,446,816.28	1,290,966,665.89
负债和所有者权益	本期末 2013年 12 月 31 日	上年度末 2012年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	40,000,000.00	-
应付证券清算款	32,465,302.80	2,557,850.39
应付赎回款	2,235,034.35	484,003.42
应付管理人报酬	1,340,488.30	1,536,121.34
应付托管费	223,414.71	256,020.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,178,259.74	1,496,773.76
应交税费	-	-
应付利息	94,900.14	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	142,307.89	700,156.21
负债合计	78,679,707.93	7,030,925.36
所有者权益:		
实收基金	1,026,116,288.20	1,510,991,688.88
未分配利润	650,820.15	-227,055,948.35
所有者权益合计	1,026,767,108.35	1,283,935,740.53
负债和所有者权益总计	1,105,446,816.28	1,290,966,665.89

注:报告截止日 2013 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.001 元,基金份额总额 1,026,116,288.20 份。

7.2 利润表

会计主体:诺安主题精选股票型证券投资基金

本报告期: 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

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 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	226,487,091.97	126,786,495.25
1.利息收入	2,309,016.21	2,397,838.75
其中:存款利息收入	1,039,606.57	1,050,995.07
债券利息收入	872,499.31	735,141.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	396,910.33	611,702.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益 (损失以“-”填列)	141,355,474.89	-114,745,393.12
其中:股票投资收益	117,981,402.73	-129,727,434.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,978,332.19	978,400.87
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	9,395,739.97	14,003,640.43
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	82,368,779.49	238,910,120.92
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	453,821.38	223,928.70
减:二、费用	34,763,329.39	31,445,301.04
1.管理人报酬	17,677,028.72	19,605,027.02
2.托管费	2,946,171.52	3,267,504.53
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	13,616,481.91	8,024,095.89
5.利息支出	105,638.67	110,058.78
其中:卖出回购金融资产支出	105,638.67	110,058.78
6.其他费用	418,008.57	438,614.82
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	191,723,762.58	95,341,194.21
减:所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	191,723,762.58	95,341,194.21

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安主题精选股票型证券投资基金

本报告期:2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,510,991,688.88	-227,055,948.35	1,283,935,740.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	191,723,762.58	191,723,762.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-484,875,400.68	35,983,005.92	-448,892,394.76
其中:1.基金申购款	377,424,871.75	-17,350,489.67	360,074,382.08
2.基金赎回款	-862,300,272.43	53,333,495.59	-808,966,776.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,026,116,288.20	650,820.15	1,026,767,108.35
项目	上年度可比期间 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,709,666,258.31	-356,322,695.30	1,353,343,563.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	95,341,194.21	95,341,194.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-198,674,569.43	33,925,552.74	-164,749,016.69
其中:1.基金申购款	158,793,193.77	-22,886,918.70	135,906,275.07
2.基金赎回款	-357,467,763.20	56,812,471.44	-300,655,291.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,510,991,688.88	-227,055,948.35	1,283,935,740.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

奥成文 薛有为 薛有为

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	托管人、代销机构

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内及其上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内不存在应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 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 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,677,028.72	19,605,027.02
其中:支付销售机构的客户维护费	5,856,133.84	6,406,355.24

注:本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 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,基金托管人于次月首日起 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、休息日等,支付日期顺延。

7.4.4.2.2 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 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,946,171.52	3,267,504.53

注:本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 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,基金托管人于次月首日起 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、休息日等,支付日期顺延。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.4.4.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.4.5 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 1 月 1 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	90,287,243.62	967,027.48	85,204,862.37	1,012,277.73

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按适用利率或约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2013 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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

7.4.12.1.1 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
000045	深纺织A	2013年3月25日	2014年3月26日	非公开发行流通受限	5.83	7.51	1,100,000	6,413,000.00	8,261,000.00	-

注:截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

7.4.5.2 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
300010	立思辰	2013年12月5日	重大资产重组	11.88	2014年3月5日	13.07	3,513,376	35,519,188.65	41,738,906.88	-
000558	莱茵置业	2013年12月26日	重大事项	3.44	2014年1月2日	3.63	2,425,689	8,294,288.82	8,344,370.16	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.6 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

(1)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,其账面价值接近于公允价值。

(2)以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

②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的金融工具中属于第一层级的余额为 915,605,372.16 元,属于第二层级的余额为 58,344,277.04 元,无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日:第一层级 1,195,455,402.26 元,第二层 7,306,600.00 元,无属于第三层级的余额)。

③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、或属于非公开发行等情况,本基金分别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二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2.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	763,757,214.60	69.09
	其中:股票	763,757,214.60	69.09
2	固定收益投资	210,192,434.60	19.01
	其中:债券	210,192,434.60	19.01
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	0.90
	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	93,494,895.72	8.46
6	其他各项资产	28,002,271.36	2.53
7	合计	1,105,446,816.28	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	566,594,180.68	55.18
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	50,330,923.22	4.90
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	58,171,649.30	5.67
J	金融业	56,335,500.00	5.49
K	房地产业	13,544,284.48	1.32
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	10,707,060.00	1.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,883,622.92	0.57
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,189,994.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	763,757,214.60	74.38

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	600309	万华化学	2,900,000	60,030,000.00	5.85
2	601318	中国平安	1,350,000	56,335,500.00	5.49
3	000895	双汇发展	972,368	45,779,085.44	4.46
4	300010	立思辰	3,513,376	41,738,906.88	4.07
5	600703	三安光电	1,541,421	38,211,826.59	3.72
6	600429	三元股份	4,300,000	35,088,000.00	3.42
7	600196	复星医药	1,650,000	32,323,500.00	3.15
8	002470	金正大	1,174,187	25,010,183.10	2.44
9	600887	伊利股份	600,000	23,448,000.00	2.28
10	600511	国药股份	1,174,938	22,171,080.06	2.16

提示: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 www.lionfund.com.cn 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	600016	民生银行	75,826,306.10	5.91
2	600196	复星医药	61,402,919.93	4.78
3	600309	万华化学	58,688,487.45	4.57
4	600597	光明乳业	55,620,707.78	4.33
5	600511	国药股份	53,117,883.12	4.14
6	300010	立思辰	52,159,314.16	4.06
7	000982	中银绒业	51,314,903.40	4.00
8	601318	中国平安	50,553,878.70	3.94
9	002024	苏宁云商	50,036,367.50	3.90
10	000002	万 科A	49,318,271.03	3.84
11	600518	康美药业	43,579,034.44	3.39
12	600705	中航投资	42,805,373.91	3.33
13	600429	三元股份	42,439,844.91	3.31
14	600276	恒瑞医药	42,313,225.85	3.30
15	600312	平高电气	38,862,818.93	3.03
16	002368	太极股份	37,804,672.76	2