金元惠理宝石动力混合型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

基金管理人:金元惠理基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月二十七日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月20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

基金名称	金元惠理宝石动力混合型证券投资基金
基金简称	金元惠理宝石动力混合
基金主代码	620001
交易代码	620001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月15日
基金管理人	金元惠理基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	402,440,719.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资具有稳健基础的中国优质企业,追求本基金资产的稳定收益与长期资本增值。
投资策略	在不同的市场阶段,本基金将分别从宏观经济情景、各类资产收益风险预期等方面进行深入分析,在股票与债券资产之间进行策略性资产配置,以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化基金资产组合。本基金股票投资策略由采用自上而下的资产配置计划与自下而上的选股计划组成。本基金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。本公司将充分考虑证券资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。
业绩比较基准	中信标普300指数×50%+中信国债指数×50%
风险收益特征	本基金为一只稳健增长型的混合型基金,其风险收益特征从长期平均及预期来看,低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场型基金,属于中等预期收益、中等预期风险的证券投资基金品种。

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		金元惠理基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌有法	赵会军
	联系电话	021-68881801	010-66105799
	电子邮箱	service@jyvpfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95588
传真		021-68881875	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦3608	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		任开宇	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jyvpfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
注册登记机构	金元惠理基金管理有限公司	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦36楼3608

§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	43,457,472.94	-36,710,984.32	-76,993,792.58
本期利润	20,061,335.08	6,985,399.50	-141,603,529.60
加权平均基金份额本期利润	0.0461	0.0143	-0.2593
本期加权平均净值利润率	5.44%	1.84%	-28.79%
本期基金份额净值增长率	4.99%	1.84%	-25.02%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	-69,723,444.18	-99,487,342.87	-115,402,978.08
期末可供分配基金份额利润	-0.1733	-0.2133	-0.2268
期末基金资产净值	332,717,275.69	367,298,075.27	393,450,289.63
期末基金份额净值	0.8267	0.7874	0.7732
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	-12.58%	-19.91%	-21.36%

注:1: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。

2: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的孰低数(为期末余额,不是当期发生数);

3:表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日。

4:所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。

3.2 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	-6.62%	1.00%	-2.16%	0.58%	-4.46%	0.42%
过去六个月	-0.53%	0.98%	-3.32%	0.64%	2.79%	0.34%
过去一年	4.99%	1.00%	-1.75%	0.69%	6.74%	0.31%
过去三年	-19.83%	0.88%	-7.98%	0.65%	-11.85%	0.23%
过去五年	-15.21%	0.76%	26.00%	0.76%	-41.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	-12.59%	0.70%	-14.24%	0.93%	1.65%	-0.23%

注:(1)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;

(2)本基金选择中信标普300指数作为股票投资部分的业绩基准,选择中信标普国债指数作为债券投资部分的业绩基准,复合业绩比较基准为:中信标普300指数收益率×50%+中信标普国债指数收益率×50%。

(3)本基金自2010年10月1日起,已由保本型基金转型为混合型基金;

3.2.2 自基金转型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

金元惠理宝石动力混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2007年8月15日至2013年12月31日)

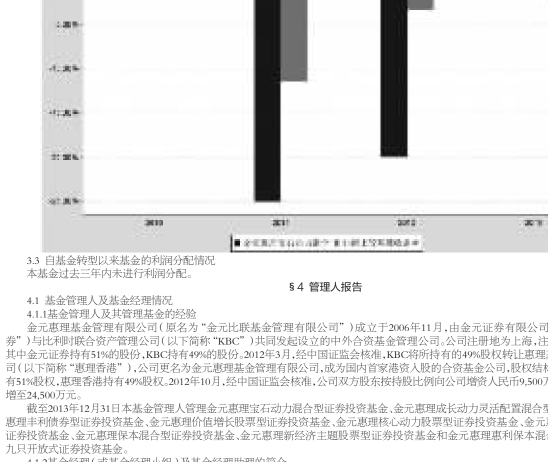
注:(1)本基金从2010年10月1日起正式转型为混合型证券投资基金;

(2)本基金转型后业绩比较基准为:中信标普300指数*50% + 中信国债指数*50%;

(3)本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的40%-60%;债券为35%-55%;现金比例在5%以上;本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金转型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

金元惠理宝石动力混合型证券投资基金
自基金转型以来每年净值增长率图



3.3 自基金转型以来基金的利润分配情况

本基金过去三年内未进行利润分配。

§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

金元惠理基金管理有限公司(原名为"金元比联基金管理有限公司")成立于2006年11月,由金元证券有限公司(以下简称"金元证券")与比利时联合资产管理公司(以下简称"KBC")共同发起设立的中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本1.5亿人民币,其中金元证券持有51%的股份,KBC持有49%的股份。2012年3月,经中国证监会核准,KBC将所持有的49%股权转让惠理基金管理香港有限公司(以下简称"惠理香港"),公司更名为金元惠理基金管理有限公司,成为国内首家港资入股的合资基金公司,股权结构变更为:金元证券持有51%股权,惠理香港持有49%股权。2012年10月,经中国证监会核准,公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元,公司注册资本增至24,500万元。

截至2013年12月31日本基金管理人管理金元惠理宝石动力混合型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、金元惠理价值增长股票型证券投资基金、金元惠理核心动力股票型证券投资基金、金元惠理消费主题股票型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金和金元惠理惠利保本混合型证券投资基金共九只开放式证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
晏斌	本基金基金经理	2013-01-18	-	10	金元惠理消费主题股票型证券投资基金、金元惠理价值增长股票型证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、金元惠理宝石动力混合型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元惠理核心动力股票型证券投资基金基金经理,香港中文大学工商管理硕士,曾任招商基金管理有限公司行业研究员,上海惠理投资管理咨询有限公司副基金经理等,2012年12月加入本公司任投资副总监。10年证券、基金等金融行业从业经历,具有基金从业资格。
侯斌	本基金基金经理	2011-12-22	-	11	金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元惠理宝石动力混合型证券投资基金基金经理,上海财经大学经济学学士。曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员,2010年6月加入本公司,历任高级行业研究员,金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理和金元惠理核心动力股票型证券投资基金基金经理助理,金元惠理核心动力股票型证券投资基金基金经理。11年基金等金融行业从业经历,具有基金从业资格。
谷伟	本基金基金经理	2012-02-14	2013-04-12	5	上海交通大学管理学博士。曾任浙江红蜻蜓集团有限公司董事长秘书,德勤咨询(上海)有限公司高级咨询顾问,泰信基金管理有限公司基金经理助理,2011年12月加入本公司,历任金元惠理宝石动力混合型证券投资基金基金经理、金元惠理丰利债券型证券投资基金和金元惠理保本混合型证券投资基金基金经理,5年证券、基金等金融行业从业经历,具有基金从业资格。

注:1.此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日,若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日;

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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《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》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、《金元惠理宝石动力混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起了《金元惠理基金管理有限公司公平交易管理制度》,涵盖了各投资组合、投资市场、投资标的的公平交易制度规范,贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程,并通过分析评估、监控、稽核的方式保证制度流程的有效执行。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等,重视交易执行环节的公平交易措施,启用投资交易系统中的公平交易模块,以确保公平对待各投资组合。在报告期内,本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本报告期,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《异常交易监控与报告制度》的规定,对交易进行了监控,未发现异常交易行为。

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

2013年,主要增持机械设备、交通运输、家用电器、交运设备、公用事业、信息服务,主要减持建筑建材、医药生物、商业贸易、农林牧渔、食品饮料、房地产、金融服务。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期份额净值增长率为4.99%,同期业绩比较基准增长率为-1.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年,中国的债务风险依然没有得到充分的暴露和化解,而美国和欧洲国家的债务危机风险系数已经大为降低;预期欧美发达经济体经济温和复苏,而欧洲的通缩风险继续恶化,中国的外贸形势更趋严峻,中国的"三驾马车"唯一可能发力的依然是投资,但利率有走向更高的趋势,投资的边际收益越来越低。放眼全球,新兴产业成为各国竞赛的焦点。

2013年,在化解产能过剩矛盾、推动企业兼并重组、促进企业自主创新和技术改造升级、推进产业转移等政策措施推动下,工业结构调整的步伐加快。2014年,在创新驱动战略引领下,高技术制造业和战略性新兴产业技术的交叉融合将不断加速,特别是新一代信息技术的推广应用将促进高端装备制造、新能源、新材料等技术与信息技术的深度融合,推动高技术制造业和新兴产业快速发展。重点关注新一代信息技术的推广应用和新经济结构调整驱动能源结构调整带来的新能源需求增长的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013年度,本基金管理人仍把规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益作为工作的基点,进一步完善内部控制制度和流程体系,推动各项法规、内控体系和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、定期检查、报表揭示、专项检查、人员询问等方法,独立地开展公司的监察稽核工作,并就在监察稽核过程中发现的问题,及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。本期内,重点开展的监察稽核工作包括:

1、依据相关法律、法规和公司实际运作情况,修订和完善公司各项内部管理制度,特别是对公司各部门的业务操作流程进行了梳理和修订,为保障基金份额持有人的利益,保障公司的规范运作提供制度保障。

2、开展对公司各项业务的日常监察稽核工作,查找公司各项业务中的风险漏洞,保证公司各项业务的合规运作,重点加强了对于各业务环节的专项稽核。

3、加强对公司营销、投研等各项业务过程中的法律、合规及投资风险的防范与控制,在合法合规的基础上,充分保障基金份额持有人的利益。

4、开展反洗钱、反商业贿赂等各项工作,并通过开展法规培训等形式,提高员工的合规意识和风险责任意识。

通过以上工作的开展,在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易,基金运作整体合法合规。在今后的工作中,本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由主管运营的副总经理、基金事务部、投资部、交易部、监察稽核部部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;
② 确保估值方法符合现行法规;
③ 批准证券估值的步骤和方法;
④ 对异常情况做出决策。

主管运营的副总经理是估值工作小组的组长,主管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

4.7.1.2 基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后,基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告,至少每月一次。

基金事务部职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;
② 每日证券估值;
③ 检查价格波动并进行一般确性评估;
④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;
⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;
⑥ 对估值调整和人工估值进行记录;
⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

4.7.1.3 投资部的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;
② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;
③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告;
④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.7.1.4 交易部的职责分工

① 对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应;
② 通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;
③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告。

4.7.1.5监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;
③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;
④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险;
⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯;
⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7.2参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

§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

本报告期内,本基金托管人在对金元惠理宝石动力混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽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

本报告期内,本基金托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对金元惠理宝石动力混合型证券投资基金的管理人——金元惠理基金管理有限公司在金元惠理宝石动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内金元惠理宝石动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对金元惠理基金管理有限公司编制和披露的金元惠理宝石动力混合型证券投资基金2013年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部
2014年3月20日

§6 审计报告

安永华明(2014)审字第60657709_B01号

金元惠理宝石动力混合型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的金元惠理宝石动力混合型证券投资基金财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表、2013年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人金元惠理基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了金元惠理宝石动力混合型证券投资基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师 严盛炜 方侃
北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
2014-03-24

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:金元惠理宝石动力混合型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	1,552,052.99	802,199.61
结算备付金		980,890.09	2,119,247.13
存出保证金		125,555.74	708,333.38
交易性金融资产	7.4.7.2	332,212,490.56	395,047,910.77
其中:股票投资	7.4.7.2	180,883,305.06	208,966,410.77
基金投资		-	-
债券投资	7.4.7.2	151,329,185.50	186,081,500.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	24,480,156.72	-
应收证券清算款		-	2,251,217.73
应收利息	7.4.7.5	4,314,338.99	2,216,776.61
应收股利		-	-
应收申购款		1,683.34	5,441.17
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		363,667,168.43	403,151,126.40
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		29,700,000.00	31,700,000.00
应付证券清算款		-	2,004,590.70
应付赎回款		306,991.10	143,946.90
应付管理人报酬		442,344.68	448,646.38
应付托管费		73,724.13	74,774.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.6	299,959.20	315,991.87
应交税费		-	-
应付利息		56,854.02	15,051.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	70,019.61	1,150,049.65
负债合计		30,949,892.74	35,853,051.13
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.8	402,440,719.87	466,486,239.29
未分配利润	7.4.7.9	-69,723,444.18	-99,188,164.02
所有者权益合计		332,717,275.69	367,298,075.27
负债和所有者权益总计		363,667,168.43	403,151,126.40

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.8267元,基金份额总额402,440,719.87份。

7.2 利润表

会计主体:金元惠理宝石动力混合型证券投资基金

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	附注号	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		29,808,604.45	16,485,393.77
1.利息收入		9,029,003.71	7,383,676.98
其中:存款利息收入	7.4.7.10	58,633.69	89,566.91
债券利息收入		8,821,508.74	6,898,368.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		148,861.28	395,741.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		44,147,641.13	-34,614,454.49
其中:股票投资收益	7.4.7.11	43,614,662.80	-35,343,837.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-166,290.64	-1,534,112.62
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	699,268.97	2,263,495.23
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.15	-23,396,137.86	43,696,383.82
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	28,097.47	19,787.46
减:二、费用		9,747,269.37	9,499,994.27
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	5,536,811.79	5,709,403.13
2.托管费	7.4.10.2.2	922,802.03	951,567.19
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.17	2,010,646.52	2,284,805.29
5.利息支出		896,018.12	176,651.67
其中:卖出回购金融资产支出		896,018.12	176,651.67
6.其他费用	7.4.7.18	380,990.91	377,566.99
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		20,061,335.08	6,985,399.50
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		20,061,335.08	6,985,399.50

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金元惠理宝石动力混合型证券投资基金

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)	466,486,239.29	-99,188,164.02	367,298,075.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,061,335.08	20,061,335.08
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)	-64,045,519.42	9,403,384.76	-54,642,134.66
其中:1.基金申购款	2,149,679.87	-335,504.83	1,814,175.04
2.基金赎回款	-66,195,199.29	9,738,889.59	-56,456,309.70
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)	402,440,719.87	-69,723,444.18	332,717,275.69

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)	508,853,267.71	-115,402,978.08	393,450,289.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,985,399.50	6,985,399.50
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)	-42,367,028.42	9,229,414.56	-33,137,613.86
其中:1.基金申购款	4,294,025.66	-924,612.82	3,369,412.84
2.基金赎回款	-46,661,054.08	10,154,027.38	-36,507,026.70
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)	466,486,239.29	-99,188,164.02	367,298,075.27

报告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:

基金管理公司负责人:张嘉宾,主管会计工作负责人:符刃,会计机构负责人:季泽

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

金元惠理宝石动力混合型证券投资基金 (原名为金元比联宝石动力混合型证券投资基金,以下简称"本基金"),由金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金转型而成。金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金于2010年8月16日保本期到期,由于不符合保本基金存续条件,按照《金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金基金合同》约定,该基金由保本混合型基金转型为非保本混合型基金,相应调整基金投资目标、投资策略、业绩比较基准和费率等,同时修订基金合同,并更名为"金元比联宝石动力混合型证券投资基金"。本基金于2010年10月1日起始运作。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元惠理基金管理有限公司(原名为金元比联基金管理有限公司),基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经金元比联第二届董事会第七次会议及第二届股东会第五次会议审议通过,并由中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]276号文核准,金元比联基金管理有限公司已于2012年3月15日完成相关工商变更登记手续,并且变更公司名称为"金元惠理基金管理有限公司"。随后,报请中国证监会同意,将金元比联宝石动力混合型证券投资基金更名为金元惠理宝石动力混合型证券投资基金,并于2012年5月2日公告。

本基金主要投资具有稳健基础的中国优质企业,追求本基金资产的稳定收益与长期资本增值。本基金投资范围限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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金采用行业配置指导下的个股精选策略。本基金业绩比较基准为:中信标普300指数×50%+中信国债指数×50%。

7.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.5税项

(1)印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

(2)营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

7.4.6关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金元惠理基金管理有限公司(原名为"金元比联基金管理有限公司")	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
惠理基金管理香港有限公司	基金管理人的股东
上海金元惠理资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.7本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1股票交易

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		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
金元证券股份有限公司	123,275,472.79	9.48%	141,628,135.98	9.37%

7.4.7.1.2权证交易

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。

7.4.7.1.3债券交易

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		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
金元证券股份有限公司	1,899.87	0.00%	103,244,522.13	83.12%

7.4.7.1.4债券回购交易

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		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
金元证券股份有限公司	489,400,000.00	34.53%	882,800,000.00	28.70%

7.4.7.1.5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
金元证券股份有限公司	112,229.09	9.54%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1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
金元证券股份有限公司	121,999.79	9.52%	37,486.42	11.98%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

7.4.7.2关联方报酬

7.4.7.2.1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	5,536,811.79	5,709,403.13
其中:支付销售机构的客户维护费	1,337,915.07	1,375,575.65

注:a.基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。

计算方法如下:H=E×1.50%/当年天数,

H为每日应支付的基金管理费,

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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2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、公休假等,支付日期顺延。

b.根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.7.2.2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	922,802.03	951,567.19

注:a.基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数,

H为每日应支付的基金托管费,

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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2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。

7.4.7.3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均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

7.4.7.4各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.7.4.2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均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.7.5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
中国工商银行股份有限公司	1,552,052.99	35,063.72	802,199.61	58,254.17

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,2013年度获得的利息收入为人民币21,235.34元(2012年度获得的利息收入为人民币31,276.36元),2013年末结算备付金余额为人民币980,890.09元(2012年末结算备付金余额为人民币2,119,247.13元)。

7.4.7.6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直接购入关联方承销的证券。

7.4.8利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
000625	长安汽车	2013-12-31	重大事项停牌	11.45	2014-01-03	11.72	1,258,556	15,187,796.89	14,410,466.20	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额共计29,700,000.00元,其中回购金融资产款18,500,000.00元于2014年1月3日到期,回购金融资产款11,200,000.00元于2014年1月6日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	180,883,305.06	49.74
	其中:股票	180,883,305.06	49.74
2	固定收益投资	151,329,185.50	41.61
	其中:债券	151,329,185.50	41.61
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	24,480,156.72	6.73
	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	2,532,943.08	0.70
6	其他各项资产	4,441,578.07	1.22
7	合计	363,667,168.43	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	130,608,634.31	39.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,295,200.00	2.19
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,932,469.68	7.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	8,924,094.75	2.68
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,122,906.32	2.44
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	180,883,305.06	54.37

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000916	华北高速	7,388,168	25,932,469.68	7.79
2	002342	巨力索具	4,481,574	25,903,497.72	7.79
3	002309	中利科技	1,498,138	25,018,904.60	7.52
4	002571	德力股份	1,718,328	18,231,460.08	5.48
5	000625	长安汽车	1,258,556	14,410,466.20	4.33
6	600887	伊利股份	368,100	14,385,348.00	4.32
7	600151	航天机电	1,602,500	13,717,400.00	4.12
8	601766	中国南车	2,121,319	10,627,808.19	3.19
9	600030	中信证券	699,929	8,924,094.75	2.68
10	002241	歌尔声学	236,994	8,313,749.52	2.50
11	300070	碧水源	198,168	8,122,906.32	2.44
12	601117	中国化学	911,900	7,295,200.00	2.19

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	000916	华北高速	61,425,726.43	16.72
2	002342	巨力索具	42,699,836.24	11.63
3	002638	勤上光电	32,684,593.68	8.90
4	600151	航天机电	29,523,686.43	8.04
5	000012	南玻A	24,787,759.00	6.75
6	002571	德力股份	23,378,273.38	6.36
7	002309	中利科技	21,764,850.36	5.93
8	601117	中国化学	21,310,227.00	5.80
9	000671	阳光城	20,775,980.47	5.66
10	600000	浦发银行	18,965,750.00	5.16
11	000625	长安汽车	18,786,040.40	5.11
12	600775	南京熊猫	18,268,545.97	4.97
13	600030	中信证券	17,622,655.43	4.80
14	601318	中国平安	16,957,524.98	4.62
15	601766	中国南车	16,858,586.60	4.59
16	600458	时代新材	15,781,466.44	4.30
17	000401	冀东水泥	15,225,336.81	4.15
18	600887	伊利股份	14,561,510.81	3.96
19	601633	长城汽车	13,707,445.08	3.73
20	600585	海螺水泥	13,466,795.74	3.67
21	002005	德豪润达	13,056,878.20	3.55
22	002551	尚荣医疗	12,883,421.10	3.51
23	000661	长春高新	11,960,946.16	3.26
24	601299	中国北车	10,740,190.00	2.92
25	600584	长电科技	9,724,223.11	2.65
26	600016	民生银行	9,465,700.00	2.58
27	300070	碧水源	9,273,904.02	2.52
28	000581	威孚高科	8,666,620.14	2.36
29	000651	格力电器	8,396,023.00	2.29
30	600118	中国卫星	7,951,181.14	2.16

注:本项的"买入金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关费用。

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	000916	华北高速	38,973,621.00	10.61
2	002638	勤上光电	28,632,692.26	7.80
3	000671	阳光城	27,073,854.02	7.37
4	000661	长春高新	25,580,368.83	6.96
5	002344	海宁皮城	23,414,165.86	6.37
6	600775	南京熊猫	21,630,326.35	5.89
7	002310	东方园林	21,376,956.69	5.82
8	000012	南玻A	19,423,361.52	5.29
9	601633	长城汽车	19,290,745.35	5.25
10	002241	歌尔声学	18,256,685.38	4.97
11	600458	时代新材	17,820,103.70	4.85
12	000596	古井贡酒	17,722,189.40	4.83
13	002477	雏鹰农牧	17,669,315.19	4.81
14	002635	安洁科技	17,534,463.60	4.77
15	600585	海螺水泥	17,328,902.86	4.72
16	000401	冀东水泥	16,616,950.43	4.52
17	600000	浦发银行	16,569,002.12	4.51
18	002081	金螳螂	16,537,061.85	4.50
19	601318	中国平安	16,480,005.19	4.49
20	601117	中国化学	16,406,531.13	4.47
21	600519	贵州茅台	16,387,578.01	4.46
22	002551	尚荣医疗	15,639,675.91	4.26
23	600362	江西铜业	14,585,715.28	3.97
24	600809	山西汾酒	13,148,074.24	3.58
25	000060	中金岭南	12,344,242.71	3.36
26	600151	航天机电	11,852,552.44	3.23
27	002005	德豪润达	11,763,561.23	3.20
28	002342	巨力索具	11,390,588.88	3.10
29	600031	三一重工	10,836,340.00	2.95
30	601299	中国北车	10,670,316.57	2.91
31	000581	威孚高科	9,985,256.49	2.72
32	600276	恒瑞医药	9,860,597.88	2.68
33	600584	长电科技	9,568,904.16	2.61
34	600016	民生银行	8,613,935.79	2.35
35	000651	格力电器	8,258,455.92	2.25
36	600030	中信证券	7,374,000.00	2.01

注:本项的"卖出金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关费用。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	623,753,525.22
卖出股票的收入(成交)总额	677,275,752.44

注:本项的"买入股票的成本"、"卖出股票的收入"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,466,800.00	5.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	121,857,385.50	36.62
5	企业短期融资券	10,005,000.00	3.01
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	151,329,185.50	45.48

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	124207	13巴城投	300,000	27,780,000.00	8.35
2	122856	11株高科	200,000	20,320,000.00	6.11
3	020062	13贴债04	200,000	19,466,800.00	5.85
4	1380120	13巴城投债	200,000	19,124,000.00	5.75
5	122652	12杨农债	124,510	12,451,000.00	3.74

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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投资股指期货。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.2 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投资国债期货。

8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1报告期内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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 报告期内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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	125,555.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,314,338.99
5	应收申购款	1,683.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,441,578.07

8.11.4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。

8.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000625	长安汽车	14,410,466.20	4.33	重大事项停牌

8.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
22,968	17,521.80	1,748,014.56	0.43%	400,692,705.31	99.57%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	-	-

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0;

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

9.3 发起式基金发起资金持有份额情况

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年8月15日)基金份额总额	4,989,265,191.90
本报告期期初基金份额总额	466,486,239.29
本报告期基金总申购份额	2,149,679.87
减:本报告期基金总赎回份额	66,195,199.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	402,440,719.87

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,未召开基金份额持有人大会,无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内,基金管理人于2013年1月19日发布公告,晏斌先生任职本基金基金经理,与侯斌女士和谷伟先生共同管理本基金;

2、本报告期内,基金管理人于2013年4月3日发布公告,谷伟先生离任本基金基金经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,未发生改聘会计师事务所的情况。本报告期内,应向安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)支付报酬人民币70,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽核或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	1	217,865,684.05	16.75%	198,345.10	16.85%	-
光大证券股份有限公司	1	204,710,233.76	15.73%	183,909.39	15.63%	-
长江证券股份有限公司	1	191,814,333.56	14.74%	174,628.19	14.84%	-
中国银河证券股份有限公司	1	188,327,103.80	14.48%	169,093.41	14.37%	-
海通证券股份有限公司	1	159,357,123.28	12.25%	145,078.73	12.33%	-
金元证券股份有限公司	1	123,275,472.79	9.48%	112,229.09	9.54%	-
中国国际金融有限公司	2	71,080,696.27	5.46%	63,149.34	5.37%	-
中信证券股份有限公司	1	70,319,270.23	5.40%	62,958.25	5.35%	-
申银万国证券股份有限公司	1	39,636,289.74	3.05%	36,084.50	3.07%	-
民生证券有限责任公司	1	32,847,698.18	2.52%	29,904.36	2.54%	-
招商证券股份有限公司	1	1,795,372.00	0.14%	1,634.46	0.14%	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

注:1:专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字<1998>29号)和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序:

A.选择标准。

a.公司具有较强的研究实力,能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应,有较广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

b.公司资信状况较好,无重大不良记录。

c.公司经营规范,能满足基金运作的合法、合规需求。

d.能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务;可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务,无被持有人投诉的记录。

B.选择流程。

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比,并根据评比的结果选择交易单元。

2:截至本报告期末2013年12月31日止,本基金新租用平安证券有限责任公司一个上海交易单元,一个深圳交易单元。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,116,744.08	3.01%	40,000,000.00	2.82%	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	700,000.00	0.05%	-	-
长江证券股份有限公司	11,757,331.12	11.36%	265,800,000.00	18.75%	-	-
中国银河证券股份有限公司	5,755,995.53	5.56%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	16,295,996.42	15.74%	333,900,000.00	23.56%	-	-
金元证券股份有限公司	1,899.87	0.00%	489,400,000.00	34.53%	-	-
中国国际金融有限公司	9,339,969.72	9.02%	4,000,000.00	0.28%	-	-
中信证券股份有限公司	51,598,782.97	49.84%	128,400,000.00	9.06%	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	154,600,000.00	10.91%	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	600,000.00	0.04%	-	-
招商证券股份有限公司	5,669,037.58	5.48%	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

金元惠理基金管理有限公司
二〇一四年三月二十七日