基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年8月25日

华富中小板指数增强型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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。本半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8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富中小板指数增强
基金主代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月9日
基金管理人	华富基金管理有限公司
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	61,870,338.21份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金,以被动跟踪标的指数为主,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础之上,力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	作为指数增强型基金,本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上,采用适度的主动投资辅助提高收益,降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法,按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合,并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股,在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	田青
	联系电话	021-68886996	010-67595096
	电子邮箱	manzh@hffund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

2.4信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-412,426.09
本期利润	-1,747,036.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0292
本期基金份额净值增长率	-4.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0216
期末基金资产净值	63,204,530.69
期末基金份额净值	1.022

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)以上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(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3)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,表中的"期末"均指报告期最后一日,即6月30日。

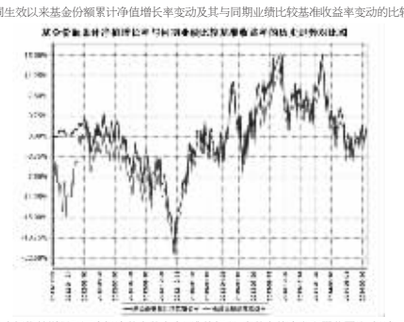
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	2.40%	0.95%	2.80%	0.96%	-0.40%	-0.01%
过去三个月	2.20%	1.02%	4.02%	0.98%	-1.82%	0.04%
过去六个月	-4.66%	1.21%	-3.12%	1.19%	-1.54%	0.02%
过去一年	5.69%	1.28%	7.36%	1.26%	-1.67%	0.02%
自基金合同生效起至今	2.20%	1.22%	1.80%	1.32%	0.40%	-0.10%

注:业绩比较基准收益率=中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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:根据《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为2011年12月9日到2012年6月9日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

§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

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立,注册资本1.2亿元,公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司。截止2014年6月30日,本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富恒鑫债券型证券投资基金、华富恒富分级债券型证券投资基金和华富恒财分级债券型证券投资基金十四只基金。

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		
朱蓓	华富中小板指数增强型基金基金经理、华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理	2012年12月19日	-	七年	上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历,曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理,2009年11月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员、产品设计经理。

注:任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上,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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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超过该证券当日成交量的5%的情形。

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

5、6月宏观数据显示经济略有反弹,消费、投资和出口增速均小幅改善,工业增加值增速微升,显示宏观略回暖。与此同时,工业企业主营业务收入和财政税收收入增速双双回落,反映经济反弹的基础并不牢固。上半年沪深300指数下跌7.08%,表现较好的三个行业分别为信息服务、信息设备、机械设备,表现最差的三个行业为采掘、农林牧渔、食品饮料。

作为中小板指数增强型基金,本基金的仓位和结构会严格按照基金合同的要求进行配置,将跟踪误差控制在基金合同要求的范围内,同时力争实现超越比较基准的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年12月9日正式成立。截止2014年6月30日,本基金份额净值为1.0220元,累计份额净值为1.0220元。报告期,本基金份额净值增长率为-4.66%,同期业绩比较基准收益率为-3.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济面临的主要压力来自于房地产市场景气度下行,由此引发的房地产投资增速下行的过程仍将继续,而制造业投资也带来了较大的不确定性。或是由于"稳增长"政策措施近期已经开始发生作用,基建投资在很大程度上正在对冲房地产和制造业投资的下行风险,这使得固定资产投资虽然仍在下滑,但是下滑的幅度在明显收窄。

展望下半年,我们对即将到来的下半年经济持有相对乐观的态度,增速将大概率在区间运行模式下拐头上行。传统监筹的机会来自于"转型"和"流动性改善",转型的方式来自于"改革"和"创新"两大类机会,而流动性改善则来自于优先股、T+0、股票期权、A股纳入MSCI、养老金入市等方面的催化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定,成立了估值委员会,并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理,成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本期利润为-1,747,036.09元,期末可供分配利润为1,334,192.48元。本报告期内未进行利润分配。

§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,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,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 托管人对本半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半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:华富中小板指数增强型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	5,335,411.57	5,149,931.10
结算备付金		32,447.91	340,603.63
存出保证金		18,188.40	40,169.11
交易性金融资产	6.4.7.2	54,107,758.93	52,585,742.10
其中:股票投资		54,107,758.93	52,585,742.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,600,000.00	2,300,000.00
应收证券清算款		1,071,791.86	501,843.34
应收利息	6.4.7.5	918.01	1,100.10
应收股利		-	-
应收申购款		6,733.50	16,330.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	142,531.25	-
资产总计		66,315,781.43	60,935,719.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,497,689.56	2,513,514.49
应付赎回款		23,149.94	32,638.55
应付管理人报酬		51,031.40	47,201.37
应付托管费		7,654.70	7,080.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	27,914.06	47,343.12
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	503,811.08	657,303.15
负债合计		3,111,250.74	3,305,080.90
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	61,870,338.21	53,754,870.48
未分配利润	6.4.7.10	1,334,192.48	3,875,768.01
所有者权益合计		63,204,530.69	57,630,638.49
负债和所有者权益总计		66,315,781.43	60,935,719.39

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.022元,基金份额总额61,870,338.21份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:华富中小板指数增强型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-889,572.23	3,471,854.44
1.利息收入		46,283.89	32,093.23
其中:存款利息收入	6.4.7.11	19,434.84	15,327.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		26,849.05	16,765.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		345,650.87	2,659,412.40
其中:股票投资收益	6.4.7.12	46,926.82	2,422,009.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	298,724.05	237,402.62
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	-1,334,610.00	718,648.24
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	53,103.01	61,700.57
减:二、费用		857,463.86	645,025.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	307,465.16	254,776.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,119.78	38,216.41
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	109,404.04	153,353.69
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	394,474.88	198,679.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-1,747,036.09	2,826,829.11
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-1,747,036.09	2,826,829.11

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富中小板指数增强型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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)	53,754,870.48	3,875,768.01	57,630,638.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,747,036.09	-1,747,036.09
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)	8,115,467.73	-794,539.44	7,320,928.29
其中:1.基金申购款	48,694,195.73	3,071,198.03	51,765,393.76
2.基金赎回款	-40,578,728.00	-3,865,737.47	-44,444,465.47
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)	61,870,338.21	1,334,192.48	63,204,530.69
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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)	66,597,505.54	-5,212,372.31	61,385,133.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,826,829.11	2,826,829.11
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)	2,482,514.13	105,328.41	2,587,842.54
其中:1.基金申购款	61,093,032.38	1,129,315.71	62,222,348.09
2.基金赎回款	-58,610,518.25	-1,023,987.30	-59,634,505.55
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)	69,080,019.67	-2,280,214.79	66,799,804.88

注:后附报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____章宏韬_____ _____姚怀然_____ _____陈大毅____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富中小板指数增强型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照《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》及相关规定和《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》发起,经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1352号文批准募集设立。本基金自2011年11月15日起公开向社会发行,至2011年12月6日募集结束。经天健正信会计师事务所验资并出具天健正信验(2011)综字第020175号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本次募集的净认购金额为674,431,379.69元人民币,有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计140,260.54元人民币,折成基金份额,归投资人所有。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为华富基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司;有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2011年12月9日生效,该日的基金份额为674,571,640.23份基金单位。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014半年度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2014年6月30日的财务状况以及2014半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策问题的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国税总局、证监会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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项如下:

以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征收营业税。

对基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征收企业所得税;对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20.00%的个人所得税。

根据财政部、国税总局、证监会发布之《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》,从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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

基金买卖股票,经国务院批准,从2008年4月24日起证券(股票)交易印花税税率由3%调整为1%。经国务院批准,从2008年9月19日起,对证券交易印花税政策进行调整,由双边征收改为向卖方单边征收,税率保持1%。

基金作为流通股股东,在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司("华安证券")	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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
华安证券	73,546,501.67	100.00%	100,790,530.01	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华安证券	180,500,000.00	100.00%	57,100,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元发生的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30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
华安证券	65,518.23	100.00%	27,914.06	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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
华安证券	89,245.59	100.00%	54,375.02	100.00%

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的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	307,465.16	254,776.17
其中:支付销售机构的客户维护费	141,902.79	66,768.80

注:基金管理费按前一日基金资产净值1.0%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法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)。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,119.78	38,216.41

注:基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法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)。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	5,335,411.57	17,371.96	6,598,585.31	14,858.43

注:本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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流通受限证券。

6.4.9.2 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
002570	贝因美	2014年6月19日	重大事项	14.36	-	-	44,216	833,327.15	634,941.76	-
002252	上海莱士	2014年6月13日	重大资产重组	63.30	-	-	9,706	281,275.50	614,389.80	-
002340	格林美	2014年6月26日	筹划收购股权事项	11.19	2014年7月24日	11.77	39,846	426,449.33	445,876.74	-
002167	东方锆业	2014年1月3日	重大资产重组	11.39	2014年7月1日	11.10	22,988	274,540.11	261,833.32	-
002151	北斗星通	2014年5月19日	筹划发行股份购买资产	24.80	2014年8月15日	27.28	7,909	232,715.30	196,143.20	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§7 投资组合报告

7.1 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	54,107,758.93	81.59
	其中:股票	54,107,758.93	81.59
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	5,600,000.00	8.44
	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	5,367,859.48	8.09
7	其他各项资产	1,240,163.02	1.87
8	合计	66,315,781.43	100.00

注:本表列示的其他各项资产详见7.12.3 期末其他各项资产构成。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	941,591.49	1.49
B	采矿业	395,370.36	0.63
C	制造业	36,216,058.41	57.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,330,320.37	3.69
F	批发和零售业	2,675,096.86	4.23
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	4,229,259.38	6.69
J	金融业	1,343,264.75	2.13
K	房地产业	614,001.46	0.97
L	租赁和商务服务业	593,029.50	0.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	319,956.00	0.51
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	49,657,948.58	78.57

7.2.2 期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	1,511,408.01	2.39
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	-	-
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	-	-
J	金融业	2,099,542.34	3.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	838,860.00	1.33
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	4,449,810.35	7.04

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	002254	泰和新材	366,859	3,099,958.55	4.90
2	002064	华峰氨纶	279,523	2,392,716.88	3.79
3	002024	苏宁云商	276,807	1,815,853.92	2.87
4	002415	海康威视	82,212	1,392,671.28	2.20
5	002594	比亚迪	27,989	1,329,197.61	2.10
6	002241	歌尔声学	47,653	1,270,428.98	2.01
7	002230	科大讯飞	44,655	1,187,823.00	1.88
8	002353	杰瑞股份	28,272	1,137,948.00	1.80
9	002450	康得新	48,662	1,107,060.50	1.75
10	002202	金风科技	113,080	1,073,129.20	1.70

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600109	国金证券	74,382	1,477,970.34	2.34
2	600372	中航电子	52,003	1,178,908.01	1.87
3	601318	中国平安	15,800	621,572.00	0.98
4	002400	省广股份	25,000	614,500.00	0.97