

(上接B146版)

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无从证券间市场债券回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无从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。

7.4.10 有助于理解和分析师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和金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低级别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 公允价值计量的金融资产

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具不属于第一层次的余额为62,233,866.28元,属于第二层次的余额为3,489,937.97元,无属于第三层次的余额。

③ 公允价值所属层级的重大变动
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内对相应股票和债券的公允价值列入第二层次或第三层次,上述事项停牌时除对相应股票和债券的公允价值列入第一层次。

(3) 第二层次公允价值余额和本期变动金额

8. 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。

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,723,804.25	92.78
2	固定收益投资	6,572,536.25	9.22
3	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	5,665,659.48	7.15
10	其他资产	52,745.45	0.08
11	合计	78,035,238.58	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	1,242,458.74	1.82
B	医药生物	21,903,819.76	31.87
C	制造业	27,237,232.70	39.62
D	电力、煤气、热力、水务生产和供应业	2,022,068.11	2.96
E	建筑业	1,949,838.11	2.84
F	批发和零售业	4,366,201.30	6.39
G	交通运输、仓储和邮政业	2,669,706.90	3.91
H	住宿和餐饮业	70,308.00	0.10
I	信息技术、软件和信息技术服务业	3,575,326.60	5.21
J	金融业	1,177,158.00	1.71
K	房地产业	5,275,971.46	7.72
L	租赁和商务服务业	1,622,462.48	2.35
M	科学研究和技术服务业	303,825.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	502,870.00	0.73
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	72,827.49	0.11
S	综合	1,064,428.00	1.53
	合计	68,629,094.25	96.01

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	医药生物	-	-
C	制造业	94,710.00	0.14
D	电力、煤气、热力、水务生产和供应业	-	-
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	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	94,710.00	0.14

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组合

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	601099	太平洋	57,200	81,384.00	1.19
2	300059	东方财富	20,000	309,200.00	0.44
3	600266	北京城建	15,600	369,096.00	0.54
4	601069	太原重工	41,600	382,752.00	0.53
5	600699	久远银海	7,500	389,475.00	0.55
6	000988	鲁南钨业	18,146	387,298.74	0.53
7	600881	华泰证券	46,800	394,596.00	0.53
8	300168	万达信息	7,500	346,500.00	0.47
9	600879	东方电机	20,800	324,480.00	0.45
10	600755	厦门国贸	28,600	323,180.00	0.45

注:投资者欲了解本报告期末指数投资的所有股票明细,应阅读登录于www.lionfund.com.cn网站的年度投资正文。

8.3.1 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组合

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	000627	天茂集团	23,000	94,710.00	0.14

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	000088	壹连环保	5,574,819.93	8.42	
2	600499	科达股份	5,543,193.93	8.11	
3	002088	长电科技	5,473,262.00	8.01	
4	600594	蓝焰股份	5,056,920.79	7.34	
5	002040	华发股份	4,950,545.30	7.24	
6	601929	吉视传媒	4,860,030.20	7.11	
7	002065	南桥通信	4,736,369.21	6.93	
8	600570	航天电子	4,604,415.41	6.74	
9	000997	新天天地	4,340,515.72	6.35	
10	600599	万润化学	4,295,385.88	6.28	
11	600112	皖通航空	4,294,088.00	6.18	
12	000998	华平股份	4,184,947.03	6.12	
13	002252	上海泰和	4,170,387.68	6.10	
14	002022	科华生物	4,094,805.71	5.99	
15	600557	康辉股份	4,050,900.92	5.96	
16	000897	津滨发展	4,032,877.52	5.90	
17	600879	航天电子	3,926,405.83	5.74	
18	600418	江淮汽车	3,798,157.10	5.56	
19	600770	谊品股份	3,724,589.60	5.45	
20	600200	江苏吴中	3,719,759.66	5.44	
21	600890	博隆股份	3,715,308.02	5.43	
22	002063	爱迪药业	3,677,990.63	5.29	
23	000717	康平集团	3,592,538.00	5.26	
24	600643	爱建股份	3,582,522.11	5.24	
25	002152	广电信息	3,563,747.82	5.21	
26	600517	奥佳华	3,560,810.00	5.21	
27	000584	长电科技	3,560,984.14	5.21	
28	002480	国光集团	3,519,000.00	5.13	
29	600522	中天科技	3,496,279.45	5.11	
30	600645	中国软件	3,460,307.01	5.06	
31	000422	昆明药业	3,423,089.78	5.01	
32	600198	大唐电信	3,381,796.45	4.95	
33	600872	中国高科	3,376,349.28	4.94	
34	600118	华升股份	3,366,395.83	4.91	
35	002256	新亚股份	3,358,209.63	4.88	
36	002040	华发股份	3,311,171.91	4.84	
37	600881	华泰证券	3,275,606.00	4.79	
38	600978	实华资本	3,242,357.90	4.74	
39	600654	飞乐音响	3,234,727.31	4.73	
40	600805	拓达投资	3,211,897.88	4.70	
41	002129	智联医疗	3,184,431.64	4.66	
42	600675	中华企业	3,164,785.00	4.63	
43	002292	奥飞动漫	3,158,289.29	4.62	
44	002380	梅桂股份	3,131,033.47	4.56	
45	600610	中国国旅	3,117,800.00	4.50	
46	600685	津劝业	2,962,555.24	4.31	
47	600045	大众交通	3,044,013.62	4.43	
48	600478	东方园林	3,043,796.01	4.43	
49	600515	航天机电	3,034,953.10	4.44	
50	600759	中国广核	3,016,344.44	4.41	
51	600525	长园集团	2,981,364.68	4.36	
52	000898	华工智能	2,972,821.44	4.35	
53	600765	中航光电	2,931,653.00	4.29	
54	000829	天普股份	2,929,607.92	4.28	
55	600690	亚星客车	2,925,479.10	4.28	
56	000797	渤海股份	2,910,870.00	4.26	
57	002085	中孚实业	2,900,461.00	4.25	
58	600734	顺产集团	2,865,099.07	4.19	
59	000712	锦泰股份	2,835,024.00	4.13	
60	600596	南桥通信	2,827,023.30	4.14	
61	600110	中科兴发	2,825,881.00	4.13	
62	600521	华南药业	2,823,637.97	4.13	
63	002250	群创光电	2,824,584.66	4.13	
64	600511	国药控股	2,823,571.40	4.13	
65	002117	众生药业	2,815,155.55	4.12	
66	000762	西藏矿业	2,813,074.37	4.12	
67	600735	罗普斯金	2,784,946.63	4.02	
68	600566	中航资本	2,782,584.80	4.02	
69	002191	创兴资源	2,762,458.36	3.99	
70	000788	运达股份	2,681,044.36	3.92	
71	600158	华神集团	2,677,294.78	3.92	
72	000977	奥康医药	2,668,190.68	3.90	

73	600787	中核股份	2,664,494.90	3.90
74	002004	华翔新材	2,658,933.58	3.87
75	600037	数字有线	2,646,234.14	3.87
76	600733	拓日新科	2,639,365.50	3.86
77	000939	凯迪电力	2,620,907.57	3.85
78	600171	上海电气	2,620,707.00	3.84
79	000413	荣事达	2,606,126.41	3.81
80	000541	南化股份	2,581,176.60	3.78
81	600755	烟台冰心	2,552,140.00	3.75
82	600320	振华重工	2,544,728.04	3.72
83	600641	天亿生物	2,537,208.29	3.71
84	600835	中航光电	2,529,661.17	3.70
85	000449	鼎理光电	2,525,035.51	3.69
86	600490	鹏辉能源	2,509,620.28	3.67
87	600387	海印股份	2,447,368.22	3.67
88	600699	瑞恒电子	2,436,976.45	3.58
89	002273	水晶光电	2,430,070.20	3.55
90	000511	博敏电子	2,420,301.00	3.54
91	002309	中航科技	2,399,035.60	3.51
92	600884	杉杉股份	2,379,461.51	3.48
93	002181	奇理集团	2,377,019.19	3.48
94	601216	内蒙君正	2,374,208.99	3.47
95	000587	东方特钢	2,372,532.07	3.47
96	600038	哈药股份	2,358,350.50	3.45
97	600820	哈投股份	2,357,598.71	3.45
98	002028	江苏阳光	2,347,991.15	3.42
99	002029	赣锋锂业	2,338,651.99	3.42
100	002315	南点科技	2,325,869.47	3.40
101	600270	江苏发展	2,322,967.65	3.40
102	600607	铁岭重工	2,316,038.98	3.39
103	600125	铁龙物流	2,309,265.66	3.38
104	600112	信达投资	2,308,200.22	3.38
105	002153	石基信息	2,303,130.02	3.37
106	600281	浙江广厦	2,295,269.28	3.37
107	002092	中核矿业	2,285,544.17	3.34
108	600747	中核自控	2,281,913.54	3.34
109	000922	洲际油气	2,274,906.69	3.33
110	000887	中微股份	2,272,571.60	3.32
111	600435	北方导航	2,261,496.00	3.31
112	601519	天普股份	2,259,136.00	3.30
113	600410	华研天地	2,258,798.08	3.30
114	002028	德康电气	2,251,421.47	3.27
115	000652	泰达股份	2,242,229.99	3.20
116	000885	节能风电	2,227,360.58	3.26
117	002701	华成股份	2,227,172.18	3.26
118	600651	飞亚音响	2,190,211.56	3.20
119	603111	亿利洁能	2,182,192.74	3.19
120	600289	亿阳信通	2,178,532.98	3.19
121	002049	国邦医药	2,166,603.33	3.17
122	600122	宏图高科	2,165,264.11	3.17
123	002277	华院股份	2,164,034.74	3.16
124	000596	海南椰岛	2,153,094.30	3.15
125	002264	中粮肉食	2,141,688.51	3.12
126	600183	中航科技	2,130,900.40	3.12
127	000979	中弘股份	2,110,028.89	3.09
128	000808	盛和资源	2,085,785.00	3.08
129	600515	北方导航	2,103,928.95	3.08
130	000828	康钧医药	2,100,881.47	3.07
131	000729	康沃医疗	2,099,770.56	3.07
132	600825	新华传媒	2,085,705.38	3.07
133	000513	鼎捷股份	2,095,065.27	3.06
134	000415	鼎捷股份	2,086,627.21	3.05
135	000726	普 惠 A	2,084,595.66	3.05
136	600284	浦东建设	2,069,888.00	3.01
137	002271	德邦股份	2,047,502.02	3.00
138	000606	中航地产	2,040,771.64	2.99
139	000942	中德股份	2,040,551.66	2.99
140	002347	普康药业	2,034,868.99	2.98
141	000759	中航光电	2,029,352.90	2.97