益民创新优势混合型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

基金管理人:益民基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2015 年 3 月 27 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

本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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年 3 月 24 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。

本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 2014 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	益民创新优势混合
基金主代码	560003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年 7 月 11 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,201,205,708.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的优势企业和潜在优势企业,为基金份额持有人实现较高风险水平下的较高收益。
投资策略	本基金着眼于全球视野,遵循从全球到国内的分析思路,从对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点,再结合国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析,从而判别国内各行业产业链传导的内在机制,并从中找出能够分享全球经济增长的创新行业或主题。本基金对于企业创新特性的定义将主要包括四大方面:技术创新,产品及服务创新、制度创新和商业模式创新。本基金将以寻求创新溢价为目标,来综合构建基金组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金产品定位于偏股型的混合型基金。风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

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		益民基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘伟	林葛
	联系电话	010-63105556	010-66060069
	电子邮箱	jcb@ymfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-650-8808	95599
传真		010-63100588	010-68121816

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.ymfund.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区宣外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

§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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	368,804,107.69	773,432,033.21	−720,036,747.88
本期利润	693,357,916.88	467,147,913.26	−358,624,486.61
加权平均基金份额本期利润	0.1913	0.1121	−0.0801
本期基金份额净值增长率	26.57%	15.74%	−10.62%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	−0.0629	−0.2176	−0.3613
期末基金资产净值	3,170,210,547.44	3,060,401,243.77	2,954,711,744.71
期末基金份额净值	0.9903	0.7824	0.6760

注: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。

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。

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)。

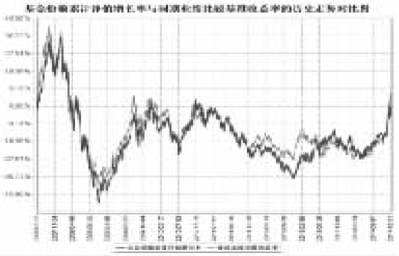
3.2 基金净值表现

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	17.64%	1.26%	32.18%	1.23%	−14.54%	0.03%
过去六个月	28.09%	1.06%	45.53%	0.99%	−17.44%	0.07%
过去一年	26.57%	1.13%	38.81%	0.91%	−12.24%	0.22%
过去三年	30.94%	1.18%	42.16%	0.97%	−11.22%	0.21%
过去五年	3.61%	1.18%	6.69%	1.02%	−3.08%	0.16%
自基金合同生效起至今	0.56%	1.49%	8.72%	1.32%	−8.16%	0.17%

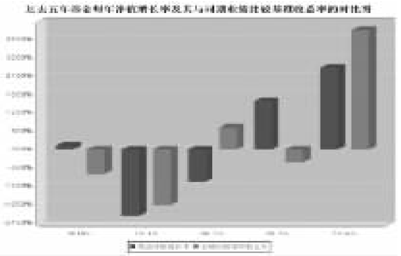
注:自 2009 年 5 月 1 日起益民创新优势混合型证券投资基金的业绩比较基准,由原来的"沪深 300 指数收益率×75%+新华巴克莱指数收益率×25%"变更为"沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%"。

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:按照本基金的基金合同约定,本基金自 2007 年 7 月 11 日合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 过去五年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:图中数据按合同生效当年实际存续期计算,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

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准,于 2005 年 12 月 12 日正式成立。公司股东由重庆国际信托有限公司(出资比例 49%)、中国新纪元有限公司(出资比例 31%)、中山证券有限责任公司(出资比例 20%)组成,注册资本为 1 亿元人民币,注册地:重庆,主要办公地点:北京。截至 2014 年末,公司管理的基金共有六只,均为开放式基金。其中,益民货币市场基金于 2006 年 7 月 17 日成立,首发规模超过 17 亿份;益民红利成长混合型证券投资基金于 2006 年 11 月 21 日成立,首发规模近 9 亿份;益民创新优势混合型证券投资基金于 2007 年 7 月 11 日成立,首发规模近 73 亿份;益民多利债券型证券投资基金于 2008 年 5 月 21 日成立,首发规模超过 7 亿份;益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金于 2012 年 8 月 16 日成立,首发规模超过 11 亿份;益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金于 2013 年 12 月 13 日成立,首发规模超过 10 亿份。

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		
韩宁	研究发展部副总经理、益民创新优势混合型证券投资基金基金经理、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012年 8 月 16 日	–	12	曾任中国有色金属材料总公司业务经理、闽发证券有限责任公司高级研究员、新时代证券有限责任公司高级研究员。自 2005 年加入益民基金管理有限公司,曾先后担任行业研究员、研究发展部副总经理。自 2012 年 3 月 21 日起任益民创新优势混合型证券投资基金基金经理,自 2012 年 8 月 16 日起任益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:此处的"任职日期"为根据公司决定确定的聘任日期,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券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,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者的合法权益,避免出现不公平交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了《益民基金管理有限公司公平交易管理制度》、《益民基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,并建立了有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司严格遵守公平交易管理制度的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合。对于交易所公开竞价交易,公司均执行交易系统中的公平交易程序,即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令;因特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令,需履行事先审批流程;对不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象,各投资组合经理需要在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和交易数量,公司在获配额度确定后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;公司根据市场公认的第三方信息,对投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,相关投资组合经理应对交易价格异常情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,不存在直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

本报告期内,各投资组合 1 日、3 日、5 日同向交易价差大部分通过统计检验,不存在价差显著的情况。但因投资组合规模悬殊、投资组合经理对市场判断的差异及决策时机不同,导致投资组合间四组配对分析出现 1 日、3 日、5 日同向交易价差检验显著的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为,不同投资组合之间不存在交易所公开竞价同日反向交易,不存在报告期内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

2014 年,美国经济从低谷逐步走向复苏、量化宽松政策在相机抉择中逐步退出,新兴经济体国家经济依然疲软。我国经济走势总体平稳,通胀水平较低,改革进程稳步推进,利率市场化提速、货币政策维持中性偏松,尤其是四季度开始降息,中国进入新一轮降息周期,货币政策明显从中性变为中性偏宽松。

本基金在 2014 年初认为:"经济增长窄幅波动、通胀低位运行,经济、金融领域的各项改革将继续推进。A 股市场总体会好于 2013 年,两极分化程度不会超过 2013 年,具体表现在蓝筹股企稳,而以创业板为代表的成长股板块也不会呈现出单边上涨的态势,而是出现分化的同时波动也随之加大"2014 年,股票市场风格轮动非常明显、主题性行情贯穿全年,大盘走势前抑后扬,四季度出现较大幅度上涨,以中小板、创业板为代表的新兴成长股票前三季度表现出色,四季度出现明显调整。

本基金在 2014 年相对较好地把握了市场波动的节奏,年初以精选成长股为主,较好地分享了传媒、电子、计算机等行业的上涨;二季度基于对经济、业绩和流动性的判断,组合配置及时转向均衡,较好地把握了农业、环保、新能源汽车等行业的上涨;三季度,本基金维持相对均衡的配置,逐步减持了前期涨幅较大的相关个股,并加大了蓝筹股配置;四季度,本基金出于对货币政策偏松的判断,较大比例地配置了券商、保险、建筑、地产等行业,市场表现完全符合我们的判断,基金净值和基金排名大幅提升。全年总体来看,前三季度业绩表现处于同类基金中等水平,四季度表现不错,全年基金业绩处于同类基金较好水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末,本基金份额净值为 0.9903 元。本报告期份额净值增长率为 26.57%,同期业绩比较基准收益率为 38.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年,我们认为经济增长前低后高,通胀和前低后高,经济、金融领域的各项改革将继续推进。本基金判断 A 股市场总体机会较多,大小盘股票均有机会,但蓝筹股波动幅度不会超过 2014 年,具体表现在蓝筹股中趋涨,而以创业板为代表的成长股板块依然会出现较好的上涨态势,由于创业板指数过去两年累计涨幅较大,波动也随之加大。出于资金面和政策面等多重考虑,本基金认为上半年是成长股比较好的的投资时机,随着下半年经济逐步复苏,蓝筹股的投资机会也相对较好。行业配置方面,我们全年看好的行业包括军工、环保、计算机、传媒、医药、大众消费品、北斗导航、移动互联网、金融、地产等,主题投资机会看好国企改革和"长江经济带"等区域经济。本基金全年的操作思路是一季度会相对积极的寻找投资机会,在力求组合稳健的同时寻找投资机会与热点;在二季度尤其是四、五月份,保持谨慎。本基金在 2015 年将加强对国企改革相关股票的研究,以基本面向好低估值蓝筹股作为底仓,积极参与国企改革股票和中小市值股票;在看好的中小市值股票出现大幅上涨时,降低中小市值股票投资比例,力求把握好市场的风格轮动。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人在内部监察稽核工作中,一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发,由督察长领导独立的监察稽核部门对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查,推动公司内部控制机制的完善与优化,保证各项法规和管理制度的落实,发现问题及时提出建议,并跟踪改进落实情况。本报告期内,公司监察稽核体系运行顺利,本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内,本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面:

1、根据基金监管法律法规的最新变化,推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程,制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度,确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性,并加强内部督导,将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合,通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法,加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测,并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查,完善了公平交易、交易环节及后台运营等专项监察。

3、规范基金销售业务,保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中,严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料,逐步落实反洗钱法律法规各项要求,并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务,保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制,以投资决策委员会为最高投资决策机构,投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训,促进公司合规文化的建设,及时向公司传达基金相关的法律法规;加大了对员工行为的监察稽核力度,从源头上防范合规风险,防范利益输送行为。

公司自成立以来,各项业务运作正常,内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心,进一步提高内部监察工作的科学性和有效性,切实保障基金的规范运作,充分保障基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述:

根据相关规定,本基金管理人成立估值委员会,估值委员会是基金估值的最高决策机构,负责公司估值相关决策及执行。成员由公司总经理、投资总监、运作保障部、金融工程部、监察稽核部、基金会计等相关人员组成。相关参与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验,熟悉相关法规和估值方法。

研究部行业研究员:研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究,参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定,并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责;相关参与人员应当具有多年的行业研究经验,能够对行业发展趋势做出判断,熟悉相关法规和估值方法。

监察稽核部:监察稽核部参与估值流程的人员,应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督,发现问题及时要求整改;参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验,应当具备熟知与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法的专业能力,并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

金融工程部金融工程人员:金融工程人员负责估值相关数值的处理和计算,并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验,具备基金绩效评估专业能力,并熟悉相关法规和估值方法。

运作保障部基金会计:基金会计在估值流程中的相关工作职责包括参与基金组合停牌股票估值方法的确定,复核由估值委员会提供的估值价格,并与相关托管行进行核对确认。如有不符合的情况出现,立即向估值委员会反映情况,并提出合理的调整建议。基金会计人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通,获悉的与基金估值相关的重大信息及时向公司及估值小组反馈。基金会计应当具备多年基金从业经验,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,具备熟悉及了解基金估值法规、政策和方法的专业能力。

2、基金经理参与或决定估值的程度:

基金管理公司估值委员会成员中不包括基金经理。基金经理不参与估值工作决策和执行的过程。

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担;

4、本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

5、在符合有关基金分红条件的情况下,本基金收益分配每季度不超过三次,每年不超过十二次。基金合同生效不满三个月,收益可不分配。每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

在托管益民创新优势混合型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》、《益民创新优势混合型证券投资基金托管协议》的约定,对益民创新优势混合型证券投资基金管理人—益民基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,益民基金管理有限公司在益民创新优势混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,益民基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的益民创新优势混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部
2015 年 3 月 24 日

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2015)审字第 61036918_A03 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	益民创新优势混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的益民创新优势混合型证券投资基金财务报表,包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表和 2014 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。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人益民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。	
注册会计师的责任段	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。	
审计意见段	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,公允反映了益民创新优势混合型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2015年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:益民创新优势混合型证券投资基金
报告截止日:2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款		121,781,206.86	10,087,861.02
结算备付金		43,344,122.63	53,036,893.51
存出保证金		2,744,864.62	4,635,102.81
交易性金融资产		2,918,391,213.09	2,668,395,769.11
其中:股票投资		2,683,651,613.09	2,353,729,615.91
基金投资		–	–
债券投资		234,739,600.00	314,666,153.20
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		190,000,000.00	334,700,000.00
应收证券清算款		60,364,746.78	40,119,361.87
应收利息		4,912,421.34	3,584,516.87
应收股利		–	–
应收申购款		11,742.77	8,731.60
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		3,341,550,318.09	3,114,568,236.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年 12 月 31 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		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		145,165,436.13	36,326,124.57
应付赎回款		4,037,558.22	1,566,048.47
应付管理人报酬		3,950,126.90	3,927,887.58
应付托管费		658,354.43	654,647.92
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		14,569,481.00	8,746,513.37
应交税费		2,474,068.58	1,961,194.40
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		484,745.39	984,576.71
负债合计		171,339,770.65	54,166,993.02
所有者权益:			
实收基金		3,201,205,708.65	3,911,461,732.23
未分配利润		−30,995,161.21	−851,060,488.46
所有者权益合计		3,170,210,547.44	3,060,401,243.77
负债和所有者权益总计		3,341,550,318.09	3,114,568,236.79

注:报告截止日 2014 年 12 月 31 日,基金份额净值为人民币 0.9903 元,基金份额总额为 3,201,205,708.65 份。

7.2 利润表

会计主体:益民创新优势混合型证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		814,185,082.78	594,240,271.12
1.利息收入		22,080,428.35	21,739,183.00
其中:存款利息收入		1,600,939.26	1,142,647.66
债券利息收入		10,270,391.22	9,938,156.57
资产支持证券利息收入		273,151.52	–
买入返售金融资产收入		9,935,946.35	10,658,378.77
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		467,547,132.32	878,772,251.70
其中:股票投资收益		451,212,241.18	863,600,136.59
基金投资收益		–	–
债券投资收益		−5,425,397.84	−3,900,024.90
资产支持证券投资收益		−119,922.00	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		21,880,210.98	19,072,140.01
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		324,553,809.19	−306,284,119.95
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		3,712.92	12,956.37
减:二、费用		120,827,165.90	127,092,357.86
1.管理人报酬		43,402,194.55	48,096,695.34
2.托管费		7,233,699.03	8,016,115.86
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		69,867,659.57	70,656,511.60
5.利息支出		949.66	–
其中:卖出回购金融资产支出		949.66	–
6.其他费用		322,663.09	323,035.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		693,357,916.88	467,147,913.26
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		693,357,916.88	467,147,913.26

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:益民创新优势混合型证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 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)	3,911,461,732.23	−851,060,488.46	3,060,401,243.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	693,357,916.88	693,357,916.88
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)	−710,256,023.58	126,707,410.37	−583,548,613.21
其中:1.基金申购款	53,616,473.82	−2,222,367.05	51,394,106.77
2.基金赎回款	−763,872,497.40	128,929,777.42	−634,942,719.98
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)	3,201,205,708.65	−30,995,161.21	3,170,210,547.44
项目	上年度可比期间 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)	4,371,104,890.60	−1,416,393,145.89	2,954,711,744.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	467,147,913.26	467,147,913.26
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)	−459,643,158.37	98,184,744.17	−361,458,414.20
其中:1.基金申购款	13,584,695.14	−2,955,335.33	10,629,359.81
2.基金赎回款	−473,227,853.51	101,140,079.50	−372,087,774.01
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)	3,911,461,732.23	−851,060,488.46	3,060,401,243.77

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:

雷学军	吴晓明	吴晓明
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 基金基本情况

益民创新优势混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2007]157 号文《关于同意益民创新优势混合型证券投资基金募集的批复》的批准,由益民基金管理有限公司于 2007 年 6 月 18 日至 2007 年 7 月 8 日向社会公开募集,基金合同于 2007 年 7 月 11 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次募集规模为 7,238,122,974.81 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为益民基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为监管机构允许投资的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 80%以上的股票资产将投资于具有持续创新能力的优势企业以及潜在的优势企业。本基金投资组合的资产配置比例为:股票资产为基金资产的 40%-90%,债券资产为基金资产的 5%-55%,权证为基金资产净值的 0-3%,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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"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并发布的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月,财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》;上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月,财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》,在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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[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[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[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、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。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]132 号《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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
益民基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构
重庆国际信托有限公司	基金管理人控股股东
中山证券有限责任公司("中山证券")	基金管理人股东、基金代销机构
中国新纪元有限公司	基金管理人股东
重庆国际信托有限公司工会委员会	基金管理人控股股东的工会组织
国泓资产管理有限公司	基金管理人子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 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
中山证券	48,876,240.00	0.11%	1,094,207,534.25	2.37%

7.4.8.1.2 债券交易

本基金于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债券交易。

7.4.8.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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
中山证券	–	–	2,799,300,000.00	4.35%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金于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 2014年 1 月 1 日至 2014 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
中山证券	44,497.57	0.11%	44,497.57	0.31%
关联方名称	上年度可比期间 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(%)
中山证券	996,163.73	2.38%	192,527.32	2.20%

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和经手费后的净额列示。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。

7.4.8.2 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 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	43,402,194.55	48,096,695.34
其中:支付销售机构的客户维护费	7,802,998.77	8,691,009.83

注:基金管理费每日计提,按月支付。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 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,233,699.03	8,016,115.86

注:基金托管费每日计提,按月支付。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 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

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

本基金于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

份额单位:份

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2007 年 7 月 11 日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	8,426,308.25	8,426,308.25
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	8,426,308.25	8,426,308.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.26%	0.22%

注:基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年 12 月 31 日		上年度末 2013年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
重庆国际信托有限公司工会委员会	281,718.20	0.01%	281,718.20	0.01%

注:除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 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
中国农业银行	121,781,206.86	862,633.02	10,087,861.02	280,710.07

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于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(2014 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

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
300315	掌趣科技	2014年7月14日	重大资产重组	19.59	2015年2月16日	17.41	3,770,605	66,995,705.30	73,866,151.95	–
002335	科华恒盛	2014年12月8日	重大事项未公告	21.41	2015年1月30日	22.00	2,972,401	62,083,776.98	63,639,105.41	–
002009	天奇股份	2014年10月20日	重大资产重组	17.87	2015年1月28日	17.93	1,095,618	16,454,117.22	19,578,693.66	–
002439	启明星辰	2014年12月8日	重大资产重组	26.24	2015年3月12日	28.86	9,736	211,797.52	255,472.64	–

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。

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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应付证券清算款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,526,312,189.43 元,属于第二层次的余额为人民币 392,079,023.66 元,属于第三层次的余额为人民币零元。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

§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	2,683,651,613.09	80.31
	其中:股票	2,683,651,613.09	80.31
2	固定收益投资	234,739,600.00	7.02
	其中:债券	234,739,600.00	7.02
	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	190,000,000.00	5.69
	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	165,125,329.49	4.94
7	其他各项资产	68,033,775.51	2.04
8	合计	3,341,550,318.09	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	55,645,395.00	1.76
B	采矿业	–	–
C	制造业	442,267,947.58	13.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	138,399,997.25	4.37
F	批发和零售业	192,300,041.66	6.07
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	311,113,144.19	9.81
J	金融业	1,041,238,098.73	32.84
K	房地产业	313,628,138.97	9.89
L	租赁和商务服务业	106,639,080.96	3.36
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	82,419,768.75	2.60
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	2,683,651,613.09	84.65

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	600000	浦发银行	12,192,062	191,293,452.78	6.03
2	600016	民生银行	14,164,217	154,106,680.96	4.86
3	300274	阳光电源	8,483,444	137,092,455.04	4.32
4	002315	焦点科技	2,073,656	113,636,348.80	3.58
5	601688	华泰证券	4,635,502	113,430,733.94	3.58
6	601888	中国国旅	2,401,304	106,617,897.60	3.36
7	601988	中国银行	24,741,649	102,677,843.35	3.24
8	000402	金 融 街	8,038,465	99,114,273.45	3.13
9	000728	国元证券	3,036,980	94,662,666.60	2.99
10	600340	华夏幸福	2,017,301	87,954,323.60	2.77

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	600000	浦发银行	422,487,881.66	13.80
2	600016	民生银行	411,428,339.74	13.44
3	600030	中信证券	380,809,443.50	12.44
4	000001	平安银行	373,845,906.12	12.22
5	000002	万 科 A	356,673,203.40	11.65
6	300017	网宿科技	353,743,458.68	11.56
7	600837	海通证券	324,211,871.52	10.59
8	601988	中国银行	315,139,568.02	10.30
9	300315	掌趣科技	307,097,785.61	10.03
10	000728	国元证券	303,117,569.76	9.90
11	300027	华谊兄弟	298,330,273.94	9.75
12	300104	乐视网	292,665,113.62	9.56
13	002024	苏宁云商	292,609,945.24	9.56
14	000024	招商地产	264,235,103.12	8.63
15	002421	达实智能	261,211,446.76	8.54
16	002229	鸿博股份	247,469,874.52	8.09
17	601318	中国平安	241,327,605.06	7.89
18	601688	华泰证券	209,344,858.52	6.84
19	002030	达安基因	208,969,422.28	6.83
20	002236	大华股份	208,495,144.93	6.81
21	000402	金 融 街	200,865,158.22	6.56
22	300002	神州泰岳	199,979,832.67	6.53
23	600519	贵州茅台	199,872,498.60	6.53
24	601377	兴业证券	195,964,113.92	6.40
25	600109	国金证券	191,558,233.08	6.26
26	601668	中国建筑	190,160,757.61	6.21
27	002181	粤 传 媒	171,997,852.65	5.62
28	002292	奥飞动漫	170,244,901.76	5.56
29	300269	联建光电	164,307,930.91	5.37
30	600037	歌华有线	162,083,068.45	5.30
31	601328	交通银行	152,546,128.83	4.98
32	600340	华夏幸福	150,997,966.89	4.93
33	300274	阳光电源	149,886,630.37	4.90
34	300045	华力创通	143,110,951.03	4.68
35	000661	长春高新	142,412,340.16	4.65
36	002315	焦点科技	140,130,359.59	4.58
37	600804	鹏博士	138,660,998.43	4.53
38	000858	五 粮 液	136,848,176.79	4.47
39	000568	泸州老窖	133,209,350.56	4.35
40	300251	光线传媒	130,449,862.09	4.26
41	600036	招商银行	125,905,916.91	4.11
42	600019	宝钢股份	123,935,056.65	4.05
43	601788	光大证券	120,879,897.14	3.95
44	601166	兴业银行	119,627,005.88	3.91
45	600765	中航重机	118,205,526.20	3.86
46	000783	长江证券	116,404,052.18	3.80
47	000069	华侨城 A	116,372,329.68	3.80
48	000651	格力电器	114,881,805.06	3.75
49	600122	宏图高科	110,370,823.21	3.61
50	300226	上海钢联	108,120,638.88	3.53
51	600549	厦门钨业	105,368,546.78	3.44
52	601009	南京银行	104,262,979.81	3.41
53	600048	保利地产	104,230,933.40	3.41
54	000997	新 大 陆	104,127,954.55	3.40
55	002405	四维图新	103,428,969.30	3.38
56	601888	中国国旅	103,140,315.34	3.37
57	000776	广发证券	101,036,415.47	3.30
58	600820	隧道股份	99,032,390.14	3.24
59	300124	汇川技术	96,844,223.26	3.16
60	600887	伊利股份	95,157,927.54	3.11
61	600637	百视通	95,154,335.73	3.11
62	600104	上汽集团	93,333,998.43	3.05
63	300263	隆华节能	89,718,048.41	2.93
64	000538	云南白药	89,633,910.80	2.93
65	002153	石基信息	89,001,787.87	2.91
66	601800	中国交建	88,478,609.19	2.89
67	300071	华谊嘉信	87,099,318.96	2.85
68	300059	东方财富	86,507,864.19	2.83
69	300058	蓝色光标	86,378,801.98	2.82
70	600551	时代出版	83,846,691.88	2.74
71	600315	上海家化	83,343,771.98	2.72
72	300216	千山药机	82,984,178.97	2.71
73	300183	东软载波	82,668,299.61	2.70
74	000831	五矿稀土	82,006,699.19	2.68
75	600388	龙净环保	81,594,765.94	2.67
76	600268	国电南自	80,351,097.18	2.63
77	002154	报 喜 鸟	80,196,062.94	2.62
78	600570	恒生电子	79,939,541.07	2.61
79	000559	万向钱潮	77,727,756.71	2.54
80	300148	天舟文化	77,524,603.29	2.53
81	002385	大北农	75,864,309.43	2.48
82	300074	华平股份	75,507,588.03	2.47
83	002148	北纬通信	75,450,828.52	2.47
84	000425	徐工机械	75,251,270.33	2.46
85	600027	华电国际	73,720,224.37	2.41
86	300022	吉峰农机	73,665,470.41	2.41
87	603000	人民网	73,633,468.62	2.41
88	600050	中国联通	72,542,121.92	2.37
89	002219	恒康医疗	72,113,775.70	2.36
90	002063	远光软件	71,840,405.31	2.35
91	600446	金证股份	71,573,724.61	2.34
92	000797	中国武夷	70,916,370.01	2.32
93	600188	兖州煤业	70,871,847.87	2.32
94	600839	四川长虹	70,493,790.01	2.30
95	600089	特变电工	70,443,941.76	2.30
96	600180	瑞茂通	69,554,399.62	2.27
97	600770	综艺股份	68,541,691.78	2.24
98	600718	东软集团	68,116,532.57	2.23
99	600330	天通股份	67,199,092.41	2.20
100	000596	古井贡酒	67,041,176.30	2.19
101	600332	白云山	66,089,400.27	2.16
102	300380	安硕信息	65,073,597.83	2.13
103	300223	北京君正	63,632,272.19	2.08
104	002104	恒宝股份	63,288,461.24	2.07
105	600150	中国船舶	63,141,531.86	2.06
106	600271	航天信息	62,969,761.87	2.06
107	600999	招商证券	62,252,350.94	2.03
108	002202	金风科技	62,162,096.76	2.03
109	002335	科华恒盛	62,083,776.98	2.03
110	300087	荃银高科	62,051,203.07	2.03
111	600823	世茂股份	61,996,615.77	2.03
112	600068	葛洲坝	61,787,148.91	2.02
113	000423	东阿阿胶	61,745,944.10	2.02
114	601390	中国中铁	61,653,531.84	2.01
115	601186	中国铁建	61,497,658.86	2.01
116	000046	泛海控股	61,380,918.42	2.01

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	000001	平安银行	496,912,680.08	16.24
2	600030	中信证券	436,679,058.47	14.27
3	600837	海通证券	403,204,680.07	13.17
4	600000	浦发银行	398,842,675.90	13.03
5	600016	民生银行	385,638,495.33	12.60
6	000002	万 科 A	371,882,350.18	12.15
7	300017	网宿科技	369,010,933.95	12.06
8	000024	招商地产	347,445,128.31	11.35
9	002024	苏宁云商	312,337,592.73	10.21
10	002421	达实智能	295,922,058.24	9.67
11	300027	华谊兄弟	290,327,636.73	9.49
12	300104	乐视网	288,945,748.73	9.44
13	601318	中国平安	246,652,801.61	8.06
14	000661	长春高新	245,881,968.05	8.03
15	300315	掌趣科技	245,054,417.39	8.01
16	002030	达安基因	242,360,650.10	7.92
17	601988	中国银行	235,778,307.56	7.70
18	002229	鸿博股份	229,218,090.84	7.49
19	601377	兴业证券	221,557,046.22	7.24
20	000728	国元证券	218,307,000.31	7.13
21	601668	中国建筑	217,923,593.01	7.12
22	600519	贵州茅台	207,168,936.60	6.77
23	300002	神州泰岳	191,434,404.46	6.26
24	002236	大华股份	187,475,392.25	6.13
25	002292	奥飞动漫	180,892,193.33	5.91
26	000402	金 融 街	179,670,607.30	5.87
27	300269	联建光电	174,776,869.00	5.71
28	600037	歌华有线	159,429,333.12	5.21
29	600104	上汽集团	156,698,900.23	5.12
30	600109	国金证券	156,425,381.25	5.11
31	300045	华力创通	156,147,974.56	5.10
32	600640	号百控股	155,865,131.22	5.09
33	603000	人民网	151,141,366.94	4.94
34	600048	保利地产	148,819,728.96	4.86
35	002181	粤 传 媒	144,646,924.94	4.73
36	601166	兴业银行	143,069,311.29	4.67
37	002104	恒宝股份	141,436,297.91	4.62
38	300251	光线传媒	136,959,388.76	4.48
39	600019	宝钢股份	130,789,811.84	4.27
40	600383	金地集团	128,656,380.62	4.20
41	000858	五 粮 液	127,126,235.39	4.15
42	600804	鹏博士	126,653,911.15	4.14
43	300074	华平股份	125,070,447.87	4.09
44	300226	上海钢联	124,001,116.45	4.05
45	000568	泸州老窖	123,643,215.99	4.04
46	600887	伊利股份	119,811,372.68	3.91
47	601328	交通银行	119,514,558.66	3.91
48	600036	招商银行	115,231,147.42	3.77
49	000538	云南白药	114,008,843.23	3.73
50	300216	千山药机	113,104,274.58	3.70
51	600765	中航重机	111,884,908.35	3.66
52	601688	华泰证券	110,231,764.25	3.60
53	300139	福星晓程	108,610,555.23	3.55
54	600549	厦门钨业	106,919,738.66	3.49
55	002405	四维图新	106,500,491.48	3.48
56	000651	格力电器	100,510,221.31	3.28
57	300071	华谊嘉信	99,289,368.70	3.24
58	601800	中国交建	99,210,050.68	3.24
59	600388	龙净环保	98,660,054.38	3.22
60	300059	东方财富	97,787,514.02	3.20
61	601009	南京银行	96,755,262.14	3.16
62	002154	报 喜 鸟	94,390,690.84	3.08
63	000831	五矿稀土	94,372,107.64	3.08
64	000559	万向钱潮	92,953,587.99	3.04
65	300183	东软载波	92,404,241.17	3.02
66	600340	华夏幸福	91,809,438.88	3.00
67	000997	新 大 陆	91,060,946.53	2.98
68	600118	中国卫星	88,967,406.00	2.91
69	600535	天士力	88,174,564.62	2.88
70	300124	汇川技术	86,710,902.43	2.83
71	600637	百视通	86,240,296.81	2.82
72	600770	综艺股份	85,655,006.21	2.80
73	601788	光大证券	85,419,290.23	2.79
74	300058	蓝色光标	83,475,362.26	2.73
75	600122	宏图高科	82,525,627.52	2.70
76	002153	石基信息	81,567,477.57	2.67
77	300022	吉峰农机	80,761,001.30	2.64
78	600268	国电南自	80,522,015.84	2.63
79	300157	恒泰艾普	79,601,884.99	2.60
80	000425	徐工机械	79,125,936.22	2.59
81	600839	四川长虹	78,722,494.59	2.57
82	002385	大北农	78,322,770.12	2.56
83	600345	长江通信	78,274,751.39	2.56
84	002219	恒康医疗	77,249,917.87	2.52
85	600027	华电国际	77,227,453.10	2.52
86	600570	恒生电子	77,005,290.86	2.52
87	600050	中国联通	75,916,941.47	2.48
88	600446	金证股份	75,584,616.59	2.47
89	300148	天舟文化	74,374,569.02	2.43
90	600180	瑞茂通	73,683,704.84	2.41
91	300263	隆华节能	72,811,797.56	2.38
92	600585	海螺水泥	71,803,365.93	2.35
93	600315	上海家化	71,717,752.95	2.34
94	000046	泛海控股	71,575,779.75	2.34
95	600330	天通股份	68,424,672.86	2.24
96	300380	安硕信息	68,319,908.45	2.23
97	601939	建设银行	67,921,532.95	2.22
98	002253	川大智胜	66,949,015.28	2.19
99	600718	东软集团	66,917,136.41	2.19
100	600188	兖州煤业	66,735,968.56	2.18
101	601186	中国铁建	66,578,433.96	2.18
102	600332	白云山	66,382,577.43	2.17
103	600551	时代出版	66,092,422.36	2.16
104	600584	长电科技	65,593,140.21	2.14
105	002148	北纬通信	65,321,536.83	2.13
106	300098	高新兴	65,252,873.74	2.13
107	600376	首开股份	65,075,927.04	2.13
108	002063	远光软件	64,991,347.23	2.12
109	600089	特变电工	64,656,997.75	2.11
110	002241	歌尔声学	64,198,152.72	2.10
111	300223	北京君正	64,102,651.35	2.09
112	600271	航天信息	63,751,838.01	2.08
113	000555	神州信息	62,734,239.84	2.05
114	600157	永泰能源	62,720,664.44	2.05
115	600823	世茂股份	62,493,469.36	2.04
116	300087	荃银高科	62,480,432.95	2.04
117	300053	欧比特	62,417,168.90	2.04
118	601390	中国中铁	61,725,653.29	2.02
119	600111	包钢稀土	61,571,679.68	2.01

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 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

买入股票成本(成交)总额	22,577,682,419.78
卖出股票收入(成交)总额	23,017,928,257.50

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	160,741,600.00	5.07
	其中:政策性金融债	160,741,600.00	5.07
4	企业债券	30,345,000.00	0.96
5	企业短期融资券	43,653,000.00	1.38
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	234,739,600.00	7.40

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	140444	14农发 44	800,000	80,176,000.00	2.53
2	140223	14国开 23	450,000	45,058,500.00	1.42
3	140204	14国开 04	355,000	35,507,100.00	1.12
4	068019	06京投债	300,000	30,345,000.00	0.96
5	041461002	14中南建筑 CP001	100,000	10,134,000.00	0.32

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

华泰证券股份有限公司于 2014 年 9 月公告其收到中国证监会《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定([2014]62 号)》,内容为华泰证券股份有限公司管理的华泰紫金增强债券集合资产管理计划、华泰紫金周期轮动集合资产管理计划等多个资产管理计划在 2013 年 1 月至 2014 年 3 月期间,存在同日或隔日通过交易对手实现不同计划之间间接进行债券买卖交易的情形。中国人民银行南京分行于 2014 年 6 月就此事项对华泰证券进行行政处罚,但华泰证券并未及时向监管部门报告。上述事项对华泰证券日常经营未构成重大影响。

报告期内本基金投资的其余九名证券的发行主体,没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	2,744,864.62
2	应收证券清算款	60,364,746.78
3	应收股利	–
4	应收利息	4,912,421.34
5	应收申购款	11,742.77
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	68,033,775.51

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
140,929	22,715.02	74,667,534.85	2.33%	3,126,538,173.80	97.67%

9.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	869,550.35	0.03%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007 年 7 月 11 日)基金份额总额	7,238,122,974.81
本报告期期初基金份额总额	3,911,461,732.23
本报告期基金总申购份额	53,616,473.82
减:本报告期基金总赎回份额	763,872,497.40
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	3,201,205,708.65

注:本期申购中包含转入份额,本期赎回中包含转出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内,基金管理人 —— 益民基金管理有限公司于 2014 年 12 月 25 日召开股东会及董事会,选举第二届董事会董事,选举第二届监事会监事。公司第二届董事会董事任职资格已经中国证监会审核批准。

基金托管人 —— 中国农业银行股份有限公司因工作需要,任命余晓晨先生主持托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度,为本基金进行审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所。本年度为其提供审计服务的第 2 年,本报告期内应付审计费 80,000.00 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
申银万国	1	3,131,815,614.07	6.87%	2,851,196.06	6.87%	–
海通证券	2	3,107,011,609.03	6.82%	2,828,623.88	6.82%	–
光大证券	2	2,813,427,549.06	6.17%	2,561,342.29	6.17%	–
民生证券(沪深)	2	2,208,508,603.20	4.85%	2,010,624.88	4.85%	–
国联证券	1	2,128,282,929.38	4.67%	1,937,588.81	4.67%	–
招商证券	1	2,080,046,957.61	4.56%	1,893,668.41	4.56%	–
国金证券(沪深)	2	2,015,061,726.27	4.42%	1,834,508.53	4.42%	–
民族证券	1	1,933,025,002.86	4.24%	1,759,828.02	4.24%	–
齐鲁证券	1	1,719,329,196.24	3.77%	1,565,278.70	3.77%	–
国泰君安	1	1,687,863,051.67	3.70%	1,536,632.66	3.70%	–
东兴证券	1	1,554,397,771.48	3.41%	1,415,119.67	3.41%	–
广州证券	1	1,541,592,627.72	3.38%	1,403,466.92	3.38%	–
西部证券	1	1,329,847,100.59	2.92%	1,210,694.21	2.92%	–
中信建投(沪深)	2	1,256,746,338.25	2.76%	1,144,143.79	2.76%	–
国都证券	1	1,252,229,655.98	2.75%	1,140,031.01	2.75%	–
浙商证券	1	1,236,005,093.86	2.71%	1,125,259.02	2.71%	–
兴业证券	1	1,131,101,441.25	2.48%	1,029,756.56	2.48%	–
华泰证券	1	1,108,500,795.60	2.43%	1,009,179.64	2.43%	–
中信证券(沪深)	2	1,063,708,305.82	2.33%	968,398.83	2.33%	–
方正证券	1	1,008,671,716.94	2.21%	918,295.58	2.21%	–
山西证券	1	977,964,804.42	2.15%	890,340.37	2.15%	–
中投证券	1	949,265,650.62	2.08%	864,214.24	2.08%	–
渤海证券	1	907,437,037.17	1.99%	826,131.20	1.99%	–
西南证券	1	888,609,198.84	1.95%	808,986.23	1.95%	–
中银国际	1	865,627,786.95	1.90%	788,069.55	1.90%	–
广发证券	1	848,299,503.84	1.86%	772,293.86	1.86%	–
平安证券	1	834,008,654.51	1.83%	759,282.73	1.83%	–
银河证券	1	813,178,675.30	1.78%	740,314.87	1.78%	–
华创证券	1	643,993,976.10	1.41%	586,292.37	1.41%	–
国信证券	1	616,410,081.75	1.35%	561,179.73	1.35%	–
中金公司	1	605,368,655.84	1.33%	551,126.92	1.33%	–
东方证券	1	599,806,774.51	1.32%	546,065.14	1.32%	–
安信证券	1	502,567,888.34	1.10%	457,540.36	1.10%	–
中金沪市	1	170,226,933.09	0.37%	154,974.97	0.37%	–
中山证券	1	48,876,240.00	0.11%	44,497.57	0.11%	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
高华证券	1	–	–	–	–	–

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
申银万国	19,215,811.60	23.15%	12,409,500,000.00	19.89%	–	–
海通证券	–	–	680,000,000.00	1.09%	–	–
光大证券	–	–	4,584,000,000.00	7.35%	–	–
民生证券(沪深)	26,029,194.51	31.36%	3,287,500,000.00	5.27%	–	–
国联证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	17,054,741.40	20.55%	5,270,600,000.00	8.45%	–	–
国金证券(沪深)	–	–	2,047,400,000.00	3.28%	–	–
民族证券	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券	10,912,499.50	13.15%	6,887,000,000.00	11.04%	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
东兴证券	3,780,127.00	4.55%	5,682,500,000.00	9.11%	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	4,279,900,000.00	6.86%	–	–
中信建投(沪深)	–	–	1,949,500,000.00	3.12%	–	–
国都证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	2,191,700,000.00	3.51%	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
中信证券(沪深)	1,891.20	0.00%	1,002,800,000.00	1.61%	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
山西证券	1,908.12	0.00%	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
渤海证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	1,995,100,000.00	3.20%	–	–
中银国际	–	–	1,367,500,000.00	2.19%	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	1,585,400,000.00	2.54%	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	3,425,500,000.00	5.49%	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	5,997,922.40	7.23%	3,741,600,000.00	6.00%	–	–
中金沪市	–	–	–	–	–	–
中山证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–

注:1、本公司租用券商交易单元的选择标准:

(1)基本情况:包括但不限于资本充足,财务状况及最近三年盈利情况良好;经营行为规范,最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机构的处罚;主要股东实力强大;具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合进行证券交易的需要,并能为投资组合提供全面的信息服务;

(2)公司治理:公司治理完善,股东会、董事会、监事会及管理层权责明确,内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足投资组合运作高度保密的要求;

(3)研究实力:有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员;研究覆盖面广,能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域,并能在符合相关法规及执业规范的前提下,根据公司的特定要求,提供专题研究报告;研究报告应分析严谨,观点独立、客观,并具备较强的风险意识和风险测算能力;

(4)服务能力:具备较强的服务意识,能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会;或者具备某一区域的调研服务能力的优势;

(5)综合业务能力:在投资银行业务上有较强的实力,能协助本公司投资组合参与股票、债券的发行;在新产品开发方面经验丰富,能帮助公司拓展资产管理业务(如 QDII、专户等集合理财产品);在证券创新品种开发方面处于行业前列(如交易所固定收益平台、融资融券、金融期货等);

(6)其他因素(在某一具体方面的特别优势)。

2、本公司租用券商交易单元的程序:

(1)基金的交易单元选择,投资总监、研究部、金融工程部、投资部经集体讨论后遵照上述标准填写《券商选择标准评分表》,并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全。必要时可要求券商提供相应证明文件;

(2)投资总监向投资决策委员会上报拟选券商名单、相应的席位租用安排以及相关评选材料;

(3)投资决策委员会审查拟选券商名单及相应的席位租用安排,审查通过后由总经理上报董事会,董事会如对公司管理层有相应授权的,由公司管理层依据授权内容办理;

(4)券商名单及相应的席位租用安排确定后,集中交易部参照公司《证券交易单元租用协议》及《综合服务协议》范本负责协调办理正式协议签署等相关事宜。若实际签署协议与协议范本不一致的,由集中交易部将实际签署协议提交监察稽核部进行合规性审核。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

(1)深市新增方正证券交易单元 1 个、广州证券交易单元 1 个,华泰证券交易单元 1 个,海通证券交易单元 1 个。

益民基金管理有限公司
2015 年 3 月 27 日