

(上接B161版)

7.4.2.1 基金管理费

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12月31日止 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	533,241.21	769,632.45
其中:支付销售机构的客户维护费	160,336.34	181,572.30

注:(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提,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5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、公休等,则顺延至下一个工作日;

(2)基金管理人的管理费计算公式为:日基金管理人管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数;

(3)“客户维护费”是指基金管理人与基金销售机构签订的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,该费用仅由基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金财产中列支的费用项目;

(4) 本基金成立于2013年3月22日,上年度可比期间数据只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据,特此说明。

7.4.2.2 基金托管费

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12月31日止 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	79,986.15	115,448.88

注:(1)支付基金管理人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,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5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,则顺延至下一个工作日;

(2)基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数;

(3) 本基金成立于2013年3月22日,上年度可比期间数据只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据,特此说明。

7.4.3 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。

7.4.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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12月31日止 2013年12月31日
期末余额		
当期利息收入		
上海银行股份有限公司	4,001,335.96	26,722.50
	3,055,469.91	76,298.14

注:(1)本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管,按银行同业利率计息。

(2) 本基金成立于2013年3月22日,上年度可比期间数据只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据,特此说明。

7.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购买关联方承销的证券。

7.4.7 其他关联方事项的说明
本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联方事项的说明。

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 以公允价值计量的受限证券:本基金本报告期末持有流通受限证券 0.15%,与上年度可比期间相比,本基金本报告期末未有因认购新发/增发的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票
7.4.9.3 期末持有的暂时停牌股票

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 开盘价	数量 (股/份)	期末 持仓数量	期末 估值总额
60075	广药集团	2014-09-09	重大事项	4.11	-	-	83,600	310,819.53	343,596.00
600332	白云山	2014-12-04	重大事项	27.11	2015-01-13	29.82	8,736	247,168.86	236,829.96
000562	宏源证券	2014-12-10	换股退市	30.50	2015-01-26	17.77	26,900	300,442.99	820,450.00
600649	现代制药	2014-11-03	重大事项	7.23	-	-	46,775	299,584.91	338,183.25
000938	紫光股份	2014-12-22	重大事项	20.13	-	-	2,000	54,664.32	58,200.00
002170	汉国药业	2014-12-25	重大事项	9.00	2015-01-05	9.38	5,761	49,037.12	51,849.00
000258	英钢	2014-12-23	重大事项	11.48	2015-02-13	12.63	2,800	35,873.00	32,144.00

注:根据上市公司公告,宏源证券(000562)公司控股股东华融资产管理股份有限公司因部分公司理财产品到期赎回,导致宏源证券于2014年12月26日在深圳证券交易所上市,申万源通的股票价格为:“申万源通”股票代码为:“000166”。

7.4.9.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.10 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
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,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

2)以公允价值计量的金融工具
(1)公允价值计量工具公允价值
2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币4,498,100.94元,属于第二层次的余额为人民币1,881,515.26元,属于第三层次的余额为人民币1,079,984.29元,属于第三层次的余额为人民币1,179,418.06元,属于第三层次的余额。

(2)公允价值计量层次的变动
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(包括涨跌停时的交易不活跃)、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一层次,并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的调整程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(3)不以公允价值计量的金融资产和负债
本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

2.承诺事项
截至资产负债表日,本基金无需说明的承诺事项。

3.其他事项
截至资产负债表日,本基金无需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

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12月31日止 2013年12月31日
成交金额		
占当期股票成交总额的比例		
财富通证券	26,243,723.56	9.27%
	173,256,799.65	6.35%

7.4.8.1.2 债券交易

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		
占当期债券成交总额的比例		
财富通证券	57,111,377.30	11.31%
	197,733,011.32	4.75%

7.4.8.1.3 债券回购交易

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		
占当期债券回购成交总额的比例		
财富通证券	1,074,400,000.00	18.48%
	1,918,000,000.00	9.11%

7.4.8.1.4 权证投资
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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

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
当期佣金		
占当期佣金总额的比例		
财富通证券	23,223.02	10.60%
	9,611.63	5.72%

7.4.8.1.6 债券正回购

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
当期利息		
占当期应付利息总额的比例		
财富通证券	155,773.76	7.34%
	1,835,141.49	-

注:(1)本基金按市场利率定价,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

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	1,531,138.23	7,340,566.05
其中:支付销售机构的客户维护费	847,725.88	4,028,348.36

注:(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提,逐日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,则顺延至下一个工作日;

(2)基金管理人的管理费计算公式为:日基金管理人管理费=前一日基金资产净值×0.8%/当年天数;

(3)“客户维护费”是指基金管理人与基金销售机构签订的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,该费用仅由基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金财产中列支的费用项目;

7.4.8.2.2 基金托管费

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	382,784.59	1,835,141.49

注:(1)支付基金管理人的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,则顺延至下一个工作日;

(2)基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数;

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
本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
本基金本报告期及上年度未除基金管理人以外的其他关联方均未持有本基金份额。

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

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		
中国工商银行活期存款	1,050,216.45	39,128.60
	2,347,846.60	382,010.23

注:本基金银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息;

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销的证券的情况
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买关联方承销的证券。

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	46,866,416.14	90.54
2	其中:股票	46,866,416.14	90.54
1	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,016,078.95	7.76
7	其他各项资产	881,760.25	1.70
8	合计	51,764,255.34	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末(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	采矿业	3,715,532.23	7.32
C	制造业	14,892,893.23	29.33
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	1,297,946.63	2.56
E	建筑业	5,434,967.25	10.70
F	批发性零售业	-	-
C	交通运输、仓储和邮政业	2,995,275.12	5.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	866,646.10	1.71
J	金融业	10,315,940.80	20.31
K	房地产业	2,741,006.72	5.43
L	租赁和商务服务业	626,479.92	1.25
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	42,886,680.02	84.45

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	2,853,485.12	5.62
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	724,310.00	1.44
E	建筑业	101,916.02	0.20
F	批发性零售业	140,727.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	415,719.00	0.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	281,977.00	0.56
J	金融业	35,360.00	0.07
K	房地产业	48,420.00	0.10
L	租赁和商务服务业	29,711.00	0.06
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	3,979,728.12	7.84

8.3 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

8.3.1 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

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	601800	中国交建	70,281	976,203.09	1.92
2	601390	中国中铁	95,997	892,772.10	1.76
3	000783	长江证券	51,855	872,201.10	1.72
4	601186	中国铁建	54,120	825,871.20	1.63
5	000562	宏源证券	26,900	820,450.00	1.62
6	601618	中国中冶	146,322	738,926.10	1.46
7	600448	保利地产	63,321	685,132.22	1.35
8	601600	中国铝业	109,320	683,250.00	1.35
9	000776	广发证券	25,536	662,659.20	1.30
10	600369	西南证券	29,287	652,307.23	1.29

注:投资集中度指本报告期末基金指数投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 期末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

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	600755	广药集团	83,600	343,596.00	0.68
2	000666	经纬纺机	12,000	216,000.00	0.43
3	300295	三六五网	2,000	151,600.00	0.30
4	400596	吉井贡酒	3,900	144,105.00	0.28
5	600436	片仔癀	1,600	140,288.00	0.28

注:投资集中度指本报告期末基金指数投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.4.8.7 其他关联方事项的说明
本基金本报告期及上年度可比期间内均无其他关联方事项的说明。

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 以公允价值计量的受限证券:本基金本报告期末持有流通受限证券 0.15%,与上年度可比期间相比,本基金本报告期末未有因认购新发/增发的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票
7.4.9.3 期末持有的暂时停牌股票

7.4.9.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.10 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
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,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

2)以公允价值计量的金融工具
(1)公允价值计量工具公允价值
2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币44,366,810.27元,属于第二层次的余额为人民币71,236,000.00元,属于第三层次的余额为人民币135,072,678.55元,属于第三层次的余额为人民币273,674,528.70元,属于第三层次的余额。

(2)公允价值计量层次的变动
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(包括涨跌停时的交易不活跃)、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一层次,并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的调整程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(3)不以公允价值计量的金融资产和负债
本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

2.承诺事项
截至资产负债表日,本基金无需说明的承诺事项。

3.其他事项
截至资产负债表日,本基金无需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	10,634,810.27	8.64
2	其中:股票	10,634,810.27	8.64
1	固定收益投资	104,968,000.00	85.28
其中:债券	104,968,000.00	85.28	
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,644,812.42	1.34
7	其他各项资产	5,841,999.86	4.75
8	合计	123,089,631.55	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末(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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发性零售业	-	-
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	10,634,810.27	10.06
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			