基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年3月28日

长城保本混合型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31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2015年03月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年01月01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	长城保本混合
基金主代码	200016
交易代码	200016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月2日
基金管理人	长城基金管理有限公司
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	663,964,984.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用固定比例组合保险策略进行资产配置,在确保保本周期到期时本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分为两个层次:一层为基金在安全资产和风险资产之间的大类资产配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

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		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

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.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

§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8月2日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	102,559,110.71	50,079,304.36	14,512,761.47
本期利润	136,955,859.86	31,483,019.21	22,337,929.05
加权平均基金份额本期利润	0.1611	0.0219	0.0121
本期基金份额净值增长率	16.29%	1.88%	1.20%
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	0.1740	0.0307	0.0079
期末基金资产净值	795,927,833.24	1,100,591,111.42	1,770,154,614.42
期末基金份额净值	1.199	1.031	1.012

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。

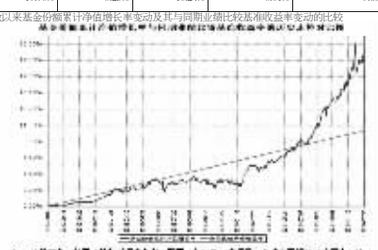
②上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

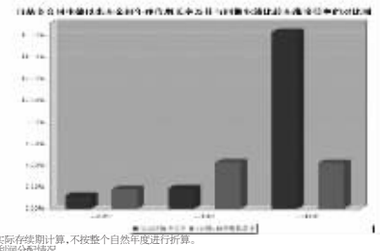
3.2 基金净值表现

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	4.90%	0.56%	1.04%	0.01%	3.86%	0.55%
过去六个月	10.61%	0.42%	2.12%	0.01%	8.49%	0.41%
过去一年	16.29%	0.32%	4.22%	0.01%	12.07%	0.31%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.90%	0.23%	10.24%	0.01%	9.66%	0.22%

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:合同生效当年按实际存续期计算,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

注:本基金基金合同于2012年08月02日生效,自基金合同生效以来未进行利润分配。

§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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司,由长城证券有限责任公司(40%)、东方证券股份有限公司(15%)、西北证券有限责任公司(15%)、北方国际信托投资股份有限公司(15%)、中原信托投资有限公司(15%)于2001年12月27日共同出资设立,当时注册资本为壹亿元人民币。2007年5月21日,经中国证监会批准,公司完成股权结构调整,现有股东为长城证券有限责任公司(47.059%)、东方证券股份有限公司(17.647%)、北方国际信托股份有限公司(17.647%)和中原信托有限公司(17.647%)。2007年10月12日,经中国证监会批准,将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币,公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司管理的基金有封闭式基金:久嘉证券投资基金;开放式基金:长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城庆丰混合型证券投资基金、长城多少金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健股票型证券投资基金、长城海金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金。

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		
钟光正	公司固定收益部总经理、长城保本混合、长城积极增利债券、长城增强收益债券的基金经理	2012年8月2日	-	5年	男,中国籍,经济学硕士。具有10年债券投资管理经历。曾就职于安徽安凯汽车股份有限公司,广发银行总行资金部、招商银行总行资金交易部。2009年11月进入长城基金管理有限公司,曾任债券研究员。自2010年2月至2011年10月任“长城货币市场证券投资基金”基金经理,自2010年2月至2011年11月任“长城稳健增利债券型证券投资基金”基金经理。
李振兴	长城久利保本基金、长城保本混合基金和长城久鑫保本混合基金的基金经理	2014年4月18日	-	7年	男,武汉大学计算机、工商管理双学士、金融学硕士。具有7年证券从业经历。曾就职于艾默生网络能源有限公司。2008年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、长城基金管理有限公司“长城久利保本混合型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”基金经理助理。
于雷	长城优化升级股票基金和长城中小盘股票基金的基金经理	2013年3月29日	2014年9月5日	7年	男,中国籍,中国人民大学财政金融学院经济学学士、硕士,香港大学金融学博士,特许金融分析师(CFA)。曾就职于华夏基金管理公司。2008年进入长城基金管理有限公司,曾任宏观、策略研究员、投资决策委员会秘书、“长城优化升级股票型证券投资基金”基金经理助理,“长城久利保本混合型证券投资基金”基金经理,“长城保本混合型证券投资基金”基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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了《证券投资基金法》、《长城保本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,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,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 公平交易制度实施情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法,严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节,本基金管理人制定和完善投资授权制度,投资对象和交易对于市场管理制度、投资信息保密措施,保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节,本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度,按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则,保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节,本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金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%的现象。

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年的债券市场波澜壮阔,基本面持续走强,通胀趋势下行,降低社会融资成本任务复杂,在此背景下,流动性持续宽松推动债券市场收益率曲线大幅下行。在安全资产投资方面,2014年初,基于对流动性逐渐宽松以及市场悲观预期过度的判断,本组合在春节前大幅提高信用债存仓位和久期,在提高组合静态收益的同时保持了组合的高流动性。春节之后,再次提高组合利率债仓位和久期,增强组合进攻性。3季度和3季度,我们对于债市继续看多,总体上在保持组合前期结构的基础上进行局部调整,通过优化置换提高了组合信用结构和流动性,4季度在降息预期兑现及地方债务置换等系列政策落地,市场风险逐步释放,利率债及高评级信用债与中低评级信用债走势出现一定分化,转债市场大涨。具体操作上,先行降息后我们卖出了部分高久期利率品种,降低组合利率风险,并且卖出一些中低评级信用债,提升了组合信用结构。

权益类投资方面,2014年在政府稳增长、调结构的主体思路下,投资与出口的高增长难以延续,宏观经济增长中枢持续下行,过往依靠粗放式增长的传统产业压力加大,投立为的投性需求减弱,经营指标下滑,转型升级动力增强。我们看到2014年国家推动改革转型的力度空前,宏观层面,第一、反腐倡廉、高政效率,正在打通经济运作的各个细胞点,更为公平自由的市场机制促进企业聚集于核心竞争力的加强,优胜劣汰的机制推动行业集中度的加速提升,一批走出中国、走向世界的伟大中资企业正在形成。第二、高效扶持新兴行业的力度加大、互联网、计算机、新能源汽车等新兴产业既能实现穿越宏观经济周期的快速增长,又是国内企业实现技术赶超、产业转型的催化机遇。作为未来经济新支柱,国家在2014年明显加大各细分行业的扶持力度,以点带面,盘活整体的局面正在形成,由此促进相关领域更为集中、更为确定的受益和快速发展。

2014年,我们秉持“自下而上选择优质成长股为主,自上而下宏观判断为辅”的思路进行权益类投资,随着保本基金安全垫的逐步积累,结合对A股市场及个股投资机会的判断,我们逐步加大了股票仓位,同时,通过保持仓位灵活、均衡行业与个股配置,实现了较好的净值回撤和波动性控制,从结果上看,总体实现了良好市稳健的投资收益。此外,2014年6月IPO的重启,也为保本基金扩展了投资标的范围,我们通过积极研究,参与并获配多只新股,进一步增厚了基金业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为16.29%,同期业绩比较基准为4.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年的经济形势将面临更复杂局面,经济增速下行,经济结构调整、通缩形势稳现,融资成本偏高,安全资产投资方面,我们认为,在经济形势未转机改善前,货币政策将持续宽松,流动性将整体宽裕,但企业利润在经济下行中面临挑战,加之地方债务甄别的推进,潜在的企业信用风险不可小觑。因此,我们认为2015年的债券市场,总体上以控制风险为主,并在控制风险的前提下,挖掘风险收益匹配度更好的投资机会。

权益投资方面,2015年我们重点看好两类投资机会,第一、快速成长、长期空间巨大的优质成长股,具体包括TMT、互联网、消费升级转型等行业。尽管在经历过去两年的底长股千市后,此类个股经历了可观的涨幅,估值也不在低位,但在当下日新月异的技术进步、模式升级的浪潮中,企业确实有机会迎来基本面颠覆式的快速成长,对于其中的佼佼者,我们仍然看好其后续的市盈率提升。第二、资金利率下行、经营效率提升的低估值监等股,具体包括金融保险、建筑、汽车、公用事业等领域。

2015年本保本基金将结合安全垫积累情况,适度调整股票仓位的弹性和灵活性,在回撤幅度可控范围内,力求为持有人实现稳健的投资收益。

4.6 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

公司成立了受托资产估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运营部负责人等组成。总经理、督察长、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握,对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因素,从价值投资的角度进行理论分析,并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案,利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具,针对不同的估值方法及估值模型进行演算,为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查,对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验,具备专业胜任能力;基金会计具有会计从业资格和基金行业业资格,精通基金估值政策、流程和标准,具有五年以上基金估值和会计核算工作经验;基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验,精通投资、研究理论知识和工具方法。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员,凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议,但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨,在估值方法的选择上力求客观、公允,在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金,其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

注: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	927,726,271.44
卖出股票收入(成交)总额	941,912,830.20

注:买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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	50,265,000.00	6.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	511,961,688.40	64.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,124,000.00	5.04
7	可转债	6,847,729.20	0.86
8	其他	-	-
9	合计	609,198,417.60	76.54

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	1480088	14丰城投债02	700,000	73,164,000.00	9.19
2	124335	13海国资	700,000	71,155,000.00	8.94
3	112208	14华邦01	500,000	50,750,000.00	6.38
4	019312	13国债12	500,000	50,265,000.00	6.32
5	124268	13渝南发	500,000	50,000,000.00	6.28

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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。

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

注:本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

8.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

8.11.3本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期本基金投资的前十名证券除金信诺发行主体外,其他证券的发行主体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。

金信诺发行主体深圳金信诺高新技术股份有限公司于2014年3月7日发布“关于收到《行政监管措施决定书》的公告”,公告称中国证券监督管理委员会深圳监管局经现场检查发现公司在公司治理、信息披露、财务会计基础工作和会计核算等方面存在问题,并采取责令改正的监督管理措施。

本基金管理小组分析认为,金信诺是一家具有长期投资价值的优质公司,该行政监管措施不影响公司的长期投资价值。本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对金信诺进行了投资。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	210,507.27
2	应收证券清算款	138,776.92
3	应收股利	-
4	应收利息	14,783,696.13
5	应收申购款	1,982.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,134,962.48

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

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	300144	宋城演艺	19,980,582.38	2.51	重大资产重组
2	300252	金信诺	3,472,000.00	0.44	重大事项

注:根据相关法规的规定,经与托管行协商一致,自2014年12月31日起,本管理人对旗下基金所持宋城演艺(300144)按指数收益法进行估值。详见本管理人2015年1月5日公告。

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
5,618	118,185.29	64,377.45	0.01%	663,900,607.51	99.99%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,081.88	0.0002%

9.3 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	0
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(2012年8月2日)基金份额总额	1,915,616,211.55
本报告期期初基金份额总额	1,067,817,292.16
本报告期基金总申购份额	11,168,587.13
减:本报告期基金总赎回份额	415,020,894.33
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	663,964,984.96

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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、基金管理人重大人事变动 自2014年3月24日起,余波先生不再担任公司副总经理,并全职担任长城基金管理有限公司子公司长城嘉信资产管理有限公司总经理职务;自2014年4月17日起,杨建华先生担任公司副总经理。 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵冕甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。 2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币陆万元。 3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

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

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	2	786,666,731.07	42.56%	716,182.28	42.56%	-
华西证券	1	459,777,360.12	24.87%	418,582.99	24.87%	-
海通证券	1	153,530,187.12	8.31%	139,773.81	8.31%	-
中金公司	1	122,796,342.43	6.64%	111,794.17	6.64%	-
东方证券	2	107,088,946.63	5.79%	97,494.05	5.79%	-
渤海证券	1	79,039,305.10	4.28%	71,957.19	4.28%	-
国金证券	2	52,832,147.08	2.86%	48,098.81	2.86%	-
长江证券	1	44,443,126.83	2.40%	40,461.13	2.40%	-
兴业证券	1	39,250,555.79	2.12%	35,733.70	2.12%	-
长城证券	3	3,030,358.50	0.16%	2,758.86	0.16%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注:1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

报告期内共新增5个专用交易单元(联讯证券新增2个交易单元、宏信证券新增1个交易单元、广州证券新增2个交易单元),截止本报告期末共计42个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,使用其席位作为基金的专用交易席位,选择的标准是:

(1)实力雄厚、信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;

(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

(3)经营行为规范,能满足基金运作的合法、合规需求;

(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;

(6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后,基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议,并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定,在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

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
国泰君安	25,842,389.54	3.66%	2,648,800,000.00	18.87%	-	-
华西证券	142,852,955.26	20.23%	5,623,600,000.00	40.06%	-	-
海通证券	58,861,360.27	8.34%	5,345,000,000.00	38.07%	-	-
中金公司	4,226,215.35	0.60%	-	-	-	-
东方证券	406,551,301.08	57.57%	40,000,000.00	0.28%	-	-
渤海证券	52,701,921.41	7.46%	381,400,000.00	2.72%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	15,130,437.50	2.14%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	100,000.00	0.00%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注: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	927,726,271.44
卖出股票收入(成交)总额	941,912,830.20

注:买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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	50,265,000.00	6.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	511,961,688.40	64.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,124,000.00	5.04
7	可转债	6,847,729.20	0.86
8	其他	-	-
9	合计	609,198,417.60	76.54

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	1480088	14丰城投债02	700,000	73,164,000.00	9.19
2	124335	13海国资	700,000	71,155,000.00	8.94
3	112208	14华邦01	500,000	50,750,000.00	6.38
4	019312	13国债12	500,000	50,265,000.00	6.32
5	124268	13渝南发	500,000	50,000,000.00	6.28

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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。

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

注:本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

8.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

8.11.3本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期本基金投资的前十名证券除金信诺发行主体外,其他证券的发行主体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。

金信诺发行主体深圳金信诺高新技术股份有限公司于2014年3月7日发布“关于收到《行政监管措施决定书》的公告”,公告称中国证券监督管理委员会深圳监管局经现场检查发现公司在公司治理、信息披露、财务会计基础工作和会计核算等方面存在问题,并采取责令改正的监督管理措施。

本基金管理小组分析认为,金信诺是一家具有长期投资价值的优质公司,该行政监管措施不影响公司的长期投资价值。本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对金信诺进行了投资。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	210,507.27
2	应收证券清算款	138,776.92
3	应收股利	-
4	应收利息	14,783,696.13
5	应收申购款	1,982.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,134,962.48

8.12.4 期末