（上接B249版）

101	002249	大洋电机	2,092,845.30	3.00
102	000006	深振业A	2,063,153.50	2.95
103	601992	金隅股份	2,048,948.25	2.93
104	600429	三元股份	2,036,463.00	2.92
105	300021	大禹节水	2,008,429.00	2.88
106	600573	惠泉啤酒	1,991,339.00	2.85
107	300065	海 兰 信	1,991,118.95	2.85
108	600998	九 州 通	1,951,869.00	2.79
109	300063	天龙集团	1,926,641.00	2.76
110	600497	驰宏锌锗	1,916,211.00	2.74
111	002549	凯美特气	1,858,241.73	2.66
112	600455	博通股份	1,856,335.50	2.66
113	300356	光一科技	1,856,004.89	2.66
114	002179	中航光电	1,808,951.38	2.59
115	600804	鹏 博 士	1,808,074.00	2.59
116	300183	东软载波	1,794,943.30	2.57
117	600372	中航电子	1,790,986.00	2.56
118	601009	南京银行	1,755,472.95	2.51
119	600662	强生控股	1,746,022.00	2.50
120	001696	宗申动力	1,735,014.00	2.48
121	600192	长城电工	1,641,905.00	2.35
122	000400	许继电气	1,633,055.00	2.34
123	600315	上海家化	1,625,900.00	2.33
124	600249	两 面 针	1,612,214.44	2.31
125	600337	美克家居	1,599,224.38	2.29
126	600863	内蒙华电	1,594,812.00	2.28
127	002237	恒邦股份	1,594,089.00	2.28
128	300267	尔康制药	1,591,222.00	2.28
129	000860	顺鑫农业	1,590,923.00	2.28
130	600708	海博股份	1,588,695.99	2.27
131	000895	双汇发展	1,588,668.57	2.27
132	600383	金地集团	1,587,774.00	2.27
133	300293	蓝英装备	1,583,342.10	2.27
134	002497	雅化集团	1,581,535.00	2.26
135	600519	贵州茅台	1,574,880.00	2.25
136	600266	北京城建	1,572,529.00	2.25
137	300043	互动娱乐	1,568,052.57	2.25
138	000060	中金岭南	1,561,916.00	2.24
139	601098	中南传媒	1,549,297.26	2.22
140	600572	康 恩 贝	1,540,587.00	2.21
141	600686	金龙汽车	1,535,995.00	2.20
142	600377	宁沪高速	1,534,824.26	2.20
143	000507	珠 海 港	1,530,492.00	2.19
144	002108	沧州明珠	1,526,424.00	2.19
145	600166	福田汽车	1,514,126.00	2.17
146	601088	中国神华	1,508,101.00	2.16
147	600737	中粮屯河	1,503,555.00	2.15
148	600150	中国船舶	1,494,071.00	2.14
149	002024	苏宁云商	1,490,848.00	2.13
150	000582	北部湾港	1,487,860.00	2.13
151	000963	华东医药	1,487,368.00	2.13
152	600720	祁 连 山	1,438,861.00	2.06
153	603000	人 民 网	1,431,077.36	2.05
154	002229	鸿博股份	1,407,782.00	2.02

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	601318	中国平安	10,108,289.11	14.47
2	600673	东阳光科	8,112,337.60	11.61
3	600016	民生银行	7,684,478.69	11.00
4	002340	格 林 美	7,112,555.83	10.18
5	000001	平安银行	6,962,361.51	9.97
6	000816	江淮动力	6,645,694.78	9.51
7	600000	浦发银行	6,344,115.63	9.08
8	600763	通策医疗	5,794,854.66	8.30
9	601231	环旭电子	5,742,012.55	8.22
10	300271	华宇软件	5,713,126.33	8.18
11	002465	海格通信	5,679,981.68	8.13
12	002085	万丰奥威	5,409,628.78	7.75
13	603766	隆鑫通用	5,280,593.20	7.56
14	601006	大秦铁路	5,248,786.72	7.51
15	600073	上海梅林	5,057,565.01	7.24
16	002303	美 盈 森	4,937,546.48	7.07
17	002605	姚记扑克	4,573,481.07	6.55
18	600429	三元股份	4,523,423.99	6.48
19	300139	福星晓程	4,453,333.52	6.38
20	600699	均胜电子	4,422,806.92	6.33
21	300175	朗源股份	4,380,877.94	6.27
22	601377	兴业证券	4,367,453.45	6.25
23	600406	国电南瑞	4,337,558.52	6.21
24	600372	中航电子	4,277,172.28	6.12
25	601000	唐 山 港	4,275,478.44	6.12
26	601166	兴业银行	4,215,723.10	6.04
27	600066	宇通客车	4,209,850.13	6.03
28	600325	华发股份	4,130,768.67	5.91
29	002005	德豪润达	4,018,708.97	5.75
30	600115	东方航空	4,007,061.00	5.74
31	600885	宏发股份	3,922,757.86	5.62
32	600588	用友软件	3,886,044.54	5.56
33	000778	新兴铸管	3,825,894.50	5.48
34	600330	天通股份	3,771,417.54	5.40
35	600030	中信证券	3,721,097.01	5.33
36	002144	宏达高科	3,559,390.95	5.10
37	000860	顺鑫农业	3,552,794.02	5.09
38	300085	银 之 杰	3,545,869.00	5.08
39	601222	林洋电子	3,544,927.66	5.08
40	300128	锦富新材	3,491,948.86	5.00
41	600690	青岛海尔	3,454,155.74	4.95
42	600340	华夏幸福	3,386,636.00	4.85
43	002117	东港股份	3,291,260.99	4.71
44	000021	长城开发	3,273,810.84	4.69
45	002049	同方国芯	3,258,248.77	4.66
46	600108	亚盛集团	3,158,945.00	4.52
47	002330	得 利 斯	3,153,905.18	4.52
48	601989	中国重工	3,150,467.89	4.51
49	600048	保利地产	3,095,993.90	4.43
50	000541	佛山照明	3,063,824.55	4.39
51	000402	金 融 街	3,054,852.80	4.37
52	600316	洪都航空	3,053,475.98	4.37
53	300334	津膜科技	3,043,853.55	4.36
54	600081	东风科技	3,002,704.02	4.30
55	002111	威海广泰	2,975,588.88	4.26
56	002584	西陇化工	2,884,959.78	4.13
57	603000	人 民 网	2,866,159.40	4.10
58	002325	洪涛股份	2,848,804.00	4.08
59	600879	航天电子	2,764,784.01	3.96
60	002241	歌尔声学	2,728,054.72	3.91
61	002458	益生股份	2,702,495.35	3.87
62	300227	光 韵 达	2,701,189.89	3.87
63	300030	阳普医疗	2,693,524.45	3.86
64	300104	乐 视 网	2,680,054.70	3.84
65	002488	金固股份	2,666,082.59	3.82
66	600008	首创股份	2,665,130.67	3.82
67	601288	农业银行	2,637,415.17	3.78
68	600104	上汽集团	2,622,210.00	3.75
69	000997	新 大 陆	2,618,222.03	3.75
70	300238	冠昊生物	2,606,761.64	3.73
71	600580	卧龙电气	2,593,937.95	3.71
72	000776	广发证券	2,589,678.00	3.71
73	600999	招商证券	2,582,168.31	3.70
74	600240	华业地产	2,580,830.72	3.70
75	002557	洽洽食品	2,545,093.90	3.64
76	002482	广田股份	2,501,700.64	3.58
77	002415	海康威视	2,461,804.89	3.52
78	000049	德赛电池	2,449,113.00	3.51
79	000938	紫光股份	2,448,289.16	3.51
80	300065	海 兰 信	2,440,824.14	3.49
81	601607	上海医药	2,408,057.00	3.45
82	600037	歌华有线	2,358,441.01	3.38
83	600261	阳光照明	2,339,018.88	3.35
84	000712	锦龙股份	2,336,116.50	3.34
85	600376	首开股份	2,333,252.97	3.34
86	000547	闽福发A	2,327,801.92	3.33
87	002642	荣 之 联	2,276,340.94	3.26
88	000919	金陵药业	2,271,252.98	3.25
89	002666	德联集团	2,253,489.52	3.23
90	002299	圣农发展	2,238,077.34	3.20
91	002249	大洋电机	2,195,947.12	3.14
92	002285	世 联 行	2,164,293.72	3.10
93	600741	华域汽车	2,137,976.00	3.06
94	600276	恒瑞医药	2,136,557.49	3.06
95	600875	东方电气	2,130,739.29	3.05
96	601009	南京银行	2,125,160.63	3.04
97	000732	泰禾集团	2,123,573.93	3.04
98	000726	鲁 泰 A	2,113,387.00	3.03
99	600256	广汇能源	2,108,580.00	3.02
100	601668	中国建筑	2,089,752.00	2.99
101	601688	华泰证券	2,077,274.71	2.97
102	601012	隆基股份	2,073,757.51	2.97
103	601992	金隅股份	2,067,829.00	2.96
104	300021	大禹节水	2,059,995.35	2.95
105	600067	冠城大通	2,056,991.85	2.95
106	600573	惠泉啤酒	2,053,744.00	2.94
107	600062	华润双鹤	2,021,336.80	2.89
108	000006	深振业A	1,978,103.50	2.83
109	002683	宏大爆破	1,971,111.71	2.82
110	300223	北京君正	1,953,455.78	2.80
111	300068	南都电源	1,942,808.00	2.78
112	001696	宗申动力	1,873,158.00	2.68
113	600249	两 面 针	1,867,885.56	2.67
114	600497	驰宏锌锗	1,859,868.29	2.66
115	002179	中航光电	1,841,726.31	2.64
116	600315	上海家化	1,840,448.09	2.64
117	300063	天龙集团	1,826,170.22	2.61
118	600998	九 州 通	1,820,297.31	2.61
119	300356	光一科技	1,792,497.20	2.57
120	300183	东软载波	1,777,733.50	2.55
121	600804	鹏 博 士	1,756,943.61	2.52
122	000507	珠 海 港	1,749,527.20	2.50
123	002549	凯美特气	1,748,368.00	2.50
124	600863	内蒙华电	1,686,420.00	2.41
125	600455	博通股份	1,653,018.00	2.37
126	600377	宁沪高速	1,644,001.28	2.35
127	600708	海博股份	1,643,278.96	2.35
128	600266	北京城建	1,641,146.33	2.35
129	300282	汇冠股份	1,632,766.00	2.34
130	300267	尔康制药	1,616,733.30	2.31
131	002497	雅化集团	1,615,311.07	2.31
132	600337	美克家居	1,599,620.80	2.29
133	600662	强生控股	1,597,886.00	2.29
134	600192	长城电工	1,590,654.00	2.28
135	000963	华东医药	1,579,245.49	2.26
136	000400	许继电气	1,570,847.40	2.25
137	002570	贝 因 美	1,564,745.44	2.24
138	600383	金地集团	1,556,616.00	2.23
139	600686	金龙汽车	1,545,170.00	2.21
140	000060	中金岭南	1,536,424.00	2.20
141	300293	蓝英装备	1,529,433.50	2.19
142	002237	恒邦股份	1,522,220.00	2.18
143	601098	中南传媒	1,505,312.00	2.16
144	601088	中国神华	1,501,322.73	2.15
145	600519	贵州茅台	1,487,832.94	2.13
146	600572	康 恩 贝	1,487,020.30	2.13
147	600166	福田汽车	1,468,750.00	2.10
148	600150	中国船舶	1,464,157.63	2.10
149	002024	苏宁云商	1,458,780.00	2.09
150	600737	中粮屯河	1,451,436.00	2.08
151	000895	双汇发展	1,424,325.89	2.04
152	601800	中国交建	1,415,456.00	2.03
153	002108	沧州明珠	1,413,097.90	2.02
154	000915	山大华特	1,397,356.00	2.00

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	503,583,478.97
卖出股票收入（成交）总额	503,508,647.54

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	1,925,988.00	2.29
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	14,925,648.28	17.74
8	其他	1,951,870.00	2.32
9	合计	18,803,506.28	22.35

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	110015	石化转债	20,000	2,698,400.00	3.21
2	110027	东方转债	15,000	2,568,150.00	3.05
3	110029	浙能转债	18,000	2,519,280.00	2.99
4	110028	冠城转债	15,000	2,210,100.00	2.63
5	018001	国开1301	19,000	1,951,870.00	2.32

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

报告期，本基金未投资股指期货。

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

报告期，本基金未投资国债期货。

8.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					–
国债期货投资本期收益（元）					–
国债期货投资本期公允价值变动（元）					–

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中，未有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、处罚的情况。

8.12.2

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	93,076.17
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	183,760.24
5	应收申购款	113,764.65
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	390,601.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	2,698,400.00	3.21
2	110020	南山转债	1,396,100.00	1.66
3	110023	民生转债	1,382,700.00	1.64
4	110017	中海转债	1,358,640.00	1.62
5	127002	徐工转债	536,418.00	0.64
6	128005	齐翔转债	97,311.00	0.12

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

注：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

无

§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
2,152	30,163.97	13,229,397.32	20.38%	51,683,471.29	79.62%

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	2,461,906.84	3.7926%

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	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

9.5发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00	0.00	0.00	–
基金管理人高级管理人员	1,808,081.40	2.79	1,400,342.78	2.16	3年
基金经理等人员	612,958.53	0.94	500,080.64	0.77	3年
基金管理人股东	8,501,132.50	13.10	8,501,132.50	13.10	3年
其他	600,084.67	0.92	600,084.67	0.92	3年
合计	11,522,257.10	17.75	11,001,640.59	16.95	3年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月28日）基金份额总额	178,532,819.63
本报告期期初基金份额总额	72,844,349.98
本报告期基金总申购份额	50,004,744.77
减:本报告期基金总赎回份额	57,936,226.14
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	64,912,868.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

2014年07月16日，张丽女士新任基金管理人督察长，毛伟先生不再担任基金管理人督察长职务。2014年12月18日李修辞先生不再担任基金管理人副总经理职务。除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、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，国金通用国鑫发起式基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为50,000元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无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	
中信证券	2	273,989,707.48	27.21%	224,530.83	30.13%	–
国金证券	1	219,727,446.41	21.82%	156,094.08	20.94%	–
华创证券	1	179,410,917.79	17.81%	127,453.85	17.10%	–
东方证券	1	173,134,288.94	17.19%	122,995.25	16.50%	–
方正证券	1	160,829,765.89	15.97%	114,253.09	15.33%	–

注：1.本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；

② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；

④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；

⑤交易佣金收取标准合理。

（2）基金专用交易席位的选择程序如下：

① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2.本报告期新增方正证券、中信证券（山东）各一个交易单元。

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
中信证券	29,628,603.47	38.38%	121,300,000.00	21.82%	–	–
国金证券	17,748,239.65	22.99%	337,000,000.00	60.63%	–	–
华创证券	3,293,241.90	4.27%	–	–	–	–
东方证券	1,686,605.47	2.18%	9,455,000.00	1.70%	–	–
方正证券	24,847,985.40	32.18%	88,100,000.00	15.85%	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无

国金通用基金管理有限公司
2015年3月30日

（上接B251版）

60	中国民族证券有限责任公司	注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F 办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F 法定代表人：赵大建 联系人：李微 电话：010-59355941 传真：010-56437030 客服电话：4008895618 网址：www.e5618.com
61	[illegible]	注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层 办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元 法定代表人：李长伟 [illegible]
79	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层 法定代表人：杨懿 联系人：刘宝文 电话：010-58325388 传真：010-58325282 客服电话：400-166-1188 网址：https://8.jrj.com.cn
80	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人：梁越 联系人：陈攀 电话：010-57756019 [illegible]

[illegible]

性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

5、股指期货等投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于股票期权、股指期权或其他衍生品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等，并与基金托管人协商一致后修改基金合同相关章节，无需召开基金份额持有人大会。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管[illegible]

[illegible]

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

（十一）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	551,202.14
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,728,046.30
5	应收申购款	169,814.45
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,449,062.89

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。

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(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002184	海得控制	21,820,000.00	3.03	重大事项停牌
2	300009	安科生物	19,336,606.74	2.69	重大事项停牌

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

净值增长率与同期业绩基准收益率比较表：

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
2014.02.26-2014.12.31	10.00%	0.49%	36.99%	0.72%	-26.99%	-0.23%
自基金合同生效起至今	10.00%	0.49%	36.99%	0.72%	-26.99%	-0.23%

十三、基金的费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费；

(2)基金托管人的托管费；

(3)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

(5)基金份额持有人大会费用；

(6)基金的证券交易费用；

(7)基金的银行汇划费用；

(8)按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E\times1.5\%\div$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

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times0.25\%\div$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

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

上述"一、基金费用的种类中第3－7项费用"，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

(1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

(3)《基金合同》生效前的相关费用；

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、托管费率，无需召开基金份额持有人大会。除根据法律法规要求提高该等报酬标准以外，提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒体上公告。

5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费率最高不高于1.5%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示

申购金额（M）	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	0.9%
500万≤M<1000万	0.3%
M≥1000万	每笔1,000元

投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、本基金赎回费率最高不超过1.5%，随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示（其中1年指365天）：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<7日	1.5%
7日≤N<30日	0.75%
30日≤N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.3%
N≥2年	0

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用75%归入基金财产；对于持有期长于3个月但小于6个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用50%归入基金财产；对于持有期长于6个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用25%归入基金财产。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金销售费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在"基金管理人"部分，对基金管理人的"主要人员情况"进行了更新。

2、在"基金托管人"部分，对基金托管人的情况进行了更新。

3、在"相关服务机构"部分，更新了本基金代销机构的信息。

4、在"基金份额的申购、赎回"部分，进行了更新。

5、在"基金的投资"部分，更新了本基金最近一期投资组合报告和投资业绩。

6、对"基金份额持有人的服务"进行了更新。

7、对"其他应披露事项"进行了更新。

8、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
2015年月日