



# 信息披露

2015年3月31日 星期二  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B187

## (上接B186版)

7.4.10.23 销售服务费  
注:无。  
7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。  
7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况  
7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
注:无。  
7.4.10.4.2 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

关联方名称	2014年12月31日		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
沪深300ETF联接基金	27,475,244.00	0.2900%	45,936,300.00	0.7600%
华泰证券	281,058,124.00	2.9600%	127,229,991.00	2.1000%

7.4.10.5 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	2014年1月1日至2014年12月31日	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	941,631,129.25	1,500,306.56
		72,200,274.80
		737,821.33

注:本基金的银行存款由基金管理人存入中国工商银行保管,按银行利率计息。  
7.4.10.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况  
注:无。  
7.4.11 利润分配情况  
7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

序号	权益发放日	除息日	每10份基金份额派发红利数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2014年1月20日	2014年1月21日	0.48	316,981,809.01	-	316,981,809.01	
合计	-	-	0.48	316,981,809.01	-	316,981,809.01	

7.4.12 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券  
7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券  
注:截至本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。  
7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票流通受限股票

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	复牌收盘价	数量股	期末成本总额	期末估值总额	备注
600352	白云山	2014年12月13日	筹划重大事项	27.11	2015年1月13日	29.82	1,476,090	40,284,445.45	40,016,230.59	-
600649	城投控股	2014年11月11日	筹划重大事项	7.23	-	-	3,261,939	23,282,830.59	23,728,483.97	-
600664	哈投股份	2014年12月31日	筹划重大事项	8.68	2015年2月17日	9.45	381,565	31,688,531.15	33,198,885.40	-
601216	内蒙君正	2014年12月25日	注入重大资产重组停牌	10.04	2015年1月7日	11.18	154,893	1,529,711.33	15,815,482.92	-
000009	中国宝安	2014年11月29日	证监会拟对公司实施重大资产重组	12.95	2015年1月7日	13.58	5,079,723	66,435,454.34	65,782,386.95	-
000413	东旭光电	2014年11月25日	筹划重大事项	7.67	2015年1月28日	8.44	17,918,939	13,521,616.67	13,911,165.13	-
000562	北新药业	2014年12月18日	华融信托公司合并	30.50	2015年1月26日	17.77	574,035	10,045,421.96	17,362,506.50	改名为万邦
000883	湖北能源	2014年11月18日	筹划重大事项	6.43	-	-	4,238,808	15,938,845.55	27,255,535.44	-

注:本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易场所恢复交易。

7.4.12.3 期末债券正回购及作为抵押的债券  
7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元,无未作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元,无未作为质押的债券。

7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
(1) 基金申购赎回  
7.4.13.1 申购赎回:本基金申购基金份额的对价总额为2,048,833,222.02元,其中包括以股票支付的申购款1,955,092.10元和以现金支付的申购款792,740,720.92元;于2013年度,本基金申购基金份额的对价总额为28,571,722,118.02元,其中包括以股票支付的申购款20,765,371,472.61元和以现金支付的申购款7,806,350,645.41元。

(2) 公允价值  
金融工具公允价值计量的方法  
公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:  
第一层次:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整的)报价。  
第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。  
第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。  
持续的以公允价值计量的金融工具  
在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33,249,557,688.00元,属于第二层次的余额为994,071,611.90元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次:14,186,711,426.06元,第二层次:181,665,638.67元,无第三层次);于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负债余额为2,801,280元,无属于第一层次的余额,属于第二层次的余额为3,033,260.90元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日,第一层次:111,107.83元,第二层次:157,866.30元,无第三层次)。

公允价值所属层次的重大变动  
对于证券交易所上市的投资品种,由于市场流动性差,交易不活跃(包括连续停牌)的交易不活跃,或属于非公开发行等情形,本基金会于停牌日交易价格或最近交易日期间,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影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值余额和本期变动金额  
非持续的以公允价值计量的金融工具  
于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:无);  
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,其账面价值与公允价值相若很小。  
(3) 除公允价值外,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	33,643,629,309.50	97.21
	其中:股票	33,643,629,309.50	97.21
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
6	银行承兑汇票及商业承兑汇票	961,944,222.75	2.79
7	其他各项资产	2,963,068.41	0.01
8	合计	34,610,536,591.66	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	105,414,738.02	0.31
B	采矿业	1,504,709,674.20	4.44
C	制造业	10,275,803,153.93	30.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,228,955,400.86	3.63
E	建筑业	1,581,511,378.32	4.67
F	批发和零售业	76,322,037.10	2.26
G	交通运输、仓储和邮政业	929,421.38	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,159,680,468.68	3.42
J	金融业	13,257,909,998.52	39.12
K	房地产业	1,257,331,123.81	4.60
L	租赁和商务服务业	328,083,870.96	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	341,825,435.90	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	214,234,372.60	0.07
R	文化、体育和娱乐业	379,666,077.84	1.12
S	综合	20,682,228.88	0.60
8	合计	33,643,629,309.50	99.28

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

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	601318	中国平安	19,287,911	1,440,999,830.81	4.25
2	600016	民生银行	109,237,868	1,188,500,003.84	3.51
3	600036	招商银行	66,554,741	1,104,143,153.19	3.26
4	600030	中信证券	31,737,950	1,075,916,505.00	3.17
5	600837	海通证券	32,469,521	781,216,675.26	2.31
6	601166	兴业银行	46,170,067	761,806,105.50	2.25
7	600000	浦发银行	45,322,870	711,115,830.30	2.10
8	000002	万科A	38,808,161	539,433,465.70	1.59
9	601668	中国铁建	60,791,981	442,565,621.68	1.31
10	601328	交通银行	63,638,867	432,744,295.60	1.28

注:上述股票买入成本按照期末基金持有的所有股票折算,应阅读我下方: Huanpu.com 网站中的年度报告正文。  
8.4 报告期末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

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	000002	万科A	1,138,896,707.21	7.92
2	000651	格力电器	911,761,460.04	6.34
3	000001	平安银行	825,281,886.54	5.74
4	000776	广发证券	613,721,094.74	4.27
5	000333	美的集团	501,869,904.74	3.49
6	002024	苏宁云商	429,534,718.57	2.98
7	000858	五粮液	411,776,669.12	2.86
8	000783	长江证券	409,463,269.30	2.85
9	000663	中兴通讯	372,308,029.29	2.59
10	000625	长安汽车	351,584,282.76	2.44
11	000725	苏宁云商	327,912,462.30	2.29
12	000538	云南白药	324,145,185.75	2.25
13	002415	海康威视	290,200,834.45	2.14
14	000895	双汇发展	291,444,331.64	2.03
15	000157	中联重科	280,261,224.78	1.95
16	000100	TCL集团	276,531,697.35	1.92
17	000338	潍柴动力	254,554,502.99	1.83
18	002594	比亚迪	253,415,446.00	1.78
19	000669	华侨城A	252,908,524.48	1.76
20	000728	国元证券	243,142,004.19	1.69

注:1.不考虑相关交易费用。  
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

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	000002	万科A	989,938,050.12	6.88
2	000651	格力电器	788,114,858.93	5.48
3	000001	平安银行	688,117,721.05	4.78
4	000776	广发证券	509,109,802.98	3.54
5	000333	美的集团	401,142,194.86	2.79
6	002024	苏宁云商	382,355,726.72	2.66
7	000858	五粮液	368,328,871.39	2.56
8	000783	长江证券	341,544,660.48	2.37
9	000663	中兴通讯	330,452,049.06	2.30
10	000625	长安汽车	292,494,344.16	2.03
11	000538	云南白药	279,928,131.77	1.95
12	000725	苏宁云商	275,843,633.89	1.92
13	002415	海康威视	267,084,642.02	1.86
14	000895	双汇发展	258,786,565.10	1.80
15	000100	TCL集团	248,602,906.95	1.73
16	000157	中联重科	246,556,652.35	1.71
17	000338	潍柴动力	228,270,612.68	1.59
18	002594	比亚迪	226,454,111.27	1.57
19	000669	华侨城A	216,271,088.80	1.51
20	002341	聚尔声学	204,893,720.67	1.42

注:不考虑相关交易费用。  
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

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	000002	万科A	989,938,050.12	6.88
2	000651	格力电器	788,114,858.93	5.48
3	000001	平安银行	688,117,721.05	4.78
4	000776	广发证券	509,109,802.98	3.54
5	000333	美的集团	401,142,194.86	2.79
6	002024	苏宁云商	382,355,726.72	2.66
7	000858	五粮液	368,328,871.39	2.56
8	000783	长江证券	341,544,660.48	2.37
9	000663	中兴通讯	330,452,049.06	2.30
10	000625	长安汽车	292,494,344.16	2.03
11	000538	云南白药	279,928,131.77	1.95
12	000725	苏宁云商	275,843,633.89	1.92
13	002415	海康威视	267,084,642.02	1.86
14	000895	双汇发展	258,786,565.10	1.80
15	000100	TCL集团	248,602,906.95	1.73
16	000157	中联重科	246,556,652.35	1.71
17	000338	潍柴动力	228,270,612.68	1.59
18	002594	比亚迪	226,454,111.27	1.57
19	000669	华侨城A	216,271,088.80	1.51
20	002341	聚尔声学	204,893,720.67	1.42

注:不考虑相关交易费用。  
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

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	000002	万科A	989,938,050.12	6.88
2	000651	格力电器	788,114,858.93	5.48
3	000001	平安银行	688,117,721.05	4.78
4	000776	广发证券	509,109,802.98	3.54
5	000333	美的集团	401,142,194.86	2.79
6	002024	苏宁云商	382,355,726.72	2.66
7	000858	五粮液	368,328,871.39	2.56
8	000783	长江证券	341,544,660.48	2.37
9	000663	中兴通讯	330,452,049.06	2.30
10	000625	长安汽车	292,494,344.16	2.03
11	000538	云南白药	279,928,131.77	1.95
12	000725	苏宁云商	275,843,633.89	1.92
13	002415	海康威视	267,084,642.02	1.86
14	000895	双汇发展	258,786,565.10	1.80
15	000100	TCL集团	248,602,906.95	1.73
16	000157	中联重科	246,556,652.35	1.71
17	000338	潍柴动力	228,270,612.68	1.59
18	002594	比亚迪	226,454,111.27	1.57
19	000669	华侨城A	216,271,088.80	1.51
20	002341	聚尔声学	204,893,720.67	1.42

注:不考虑相关交易费用。  
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

12	000025	万科A	275,843,633.89	1.92
13	002415	海康威视	267,084,642.02	1.86
14	000895	双汇发展	258,786,565.10	1.80
15	000100	TCL 集团	248,602,906.95	1.73
16	000157	中联重科	246,556,652.35	1.71
17	000338	潍柴动力	228,270,612.68	1.59
18	002594	比亚迪	226,454,111.27	1.57
19	000069	华侨城A	216,721,088.80	1.51
20	002241	歌尔声学	204,893,720.67	1.42

注：不含虚拟交易易费用。