华泰柏瑞创新升级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：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
送出日期：2015年3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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月30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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

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，应阅读年报报告正文。

本报告期自2014年5月6日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞创新升级
基金主代码	000566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月6日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	372,406,137.72份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证TMT产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

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	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及托管人住所

§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5月6日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	28,119,338.50
本期利润	61,616,099.61
加权平均基金份额本期利润	0.3146
本期基金份额净值增长率	35.00%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.2017
期末基金资产净值	502,881,240.00
期末基金份额净值	1.350

注：1、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。

2、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。

3、对期末可供分配利润，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。

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

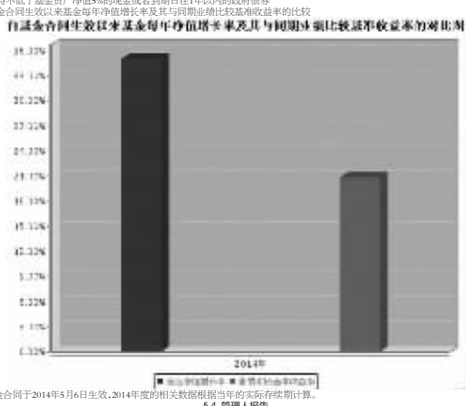
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.66%	1.52%	3.64%	0.85%	8.02%	0.67%
过去六个月	33.14%	1.19%	16.07%	0.73%	17.07%	0.46%
自基金合同生效起至今	35.00%	1.05%	20.85%	0.71%	14.15%	0.34%

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：图示日期为2014年5月6日至2014年12月31日。

1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围的要求，本基金持有的股票占基金资产的比例为30%~95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为8%~70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债券。

3.2.3 自基金合同生效以来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：1.本基金合同于2014年5月6日生效，2014年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

§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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞全球稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健盈债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金和华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金，截至2014年12月31日，公司基金管理规模为600.75亿元。

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		
张慧	本基金的基金经理	2014年5月6日	-	8	经济学硕士，8年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员，2010年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2013年9月起任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
沈雪峰	本基金的基金经理，投资部总监	2014年5月6日	-	21	经济学硕士，历任：安徽省国际信托投资公司投资银行部、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研发发展部高级研发员；亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理，研究所副所长；华富基金管理公司资深研究员、基金经理、投研部副总监，后重新加入华安基金管理公司，任基金经理。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013年2月起任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2014年7月起任投资部总监。2014年8月任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金的基金经理。

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《中华人民共和国证券法》、《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》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规性的专项说明

4.3.1 公平交易的制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同账户。风控管理部对投资组合期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断基金之间是否在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理职（业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策，公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。公募价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易利润进非时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”，针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确地从某一方向、同时潜在利益输送长期存在的倾向。因此不构成利益输送，造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内本公司投资决策的专项说明

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同账户。风控管理部对投资组合期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断基金之间是否在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.5 报告期内基金投资组合的业绩表现说明

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同账户。风控管理部对投资组合期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断基金之间是否在不公平交易或利益输送的可能。

4.6 报告期内基金业绩表现说明

4.6.1 报告期内基金份额净值增长率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	11.66%	1.52%	3.64%	0.85%	8.02%	0.67%
过去六个月	33.14%	1.19%	16.07%	0.73%	17.07%	0.46%
自基金合同生效起至今	35.00%	1.05%	20.85%	0.71%	14.15%	0.34%

4.6.2 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：图示日期为2014年5月6日至2014年12月31日。

1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围的要求，本基金持有的股票占基金资产的比例为30%~95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为8%~70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债券。

4.7.2 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	本期末公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019003	11国债07	33,826,000.00	6.72
2	019021	13国债01	33,822,000.00	6.72
3	019029	13国债09	33,819,000.00	6.72
4	019030	13国债10	33,816,000.00	6.72
5	019033	13国债13	33,813,000.00	6.72

4.7.3 报告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

序号	证券代码	证券名称	本期末公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1080011	10建行卡C1	1,000,000.00	0.199%
2	1080012	10建行卡C2	1,000,000.00	0.199%
3	1080013	10建行卡C3	1,000,000.00	0.199%
4	1080014	10建行卡C4	1,000,000.00	0.199%
5	1080015	10建行卡C5	1,000,000.00	0.199%
6	1080016	10建行卡C6	1,000,000.00	0.199%
7	1080017	10建行卡C7	1,000,000.00	0.199%
8	1080018	10建行卡C8	1,000,000.00	0.199%
9	1080019	10建行卡C9	1,000,000.00	0.199%
10	1080020	10建行卡C10	1,000,000.00	0.199%

4.7.4 报告期末按照成本法反映的持有的所有资产支持证券投资组合的情况

序号	证券代码	证券名称	本期末成本	本期末应计利息
1	1080011	10建行卡C1	1,000,000.00	2,000.00
2	1080012	10建行卡C2	1,000,000.00	2,000.00
3	1080013	10建行卡C3	1,000,000.00	2,000.00
4	1080014	10建行卡C4	1,000,000.00	2,000.00
5	1080015	10建行卡C5	1,000,000.00	2,000.00
6	1080016	10建行卡C6	1,000,000.00	2,000.00
7	1080017	10建行卡C7	1,000,000.00	2,000.00
8	1080018	10建行卡C8	1,000,000.00	2,000.00
9	1080019	10建行卡C9	1,000,000.00	2,000.00
10	1080020	10建行卡C10	1,000,000.00	2,000.00

4.7.5 报告期末按照成本反映的持有的所有股票投资组合的情况

代码	行业类别	成本	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	27,771,410.00	5.52
C	制造业	100,280,465.63	19.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	46,487,034.16	9.24
J	金融业	164,539,323.51	32.72
K	房地产业	11,987,899.98	2.38
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	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	5,689,160.00	1.13
	合计	356,755,293.28	70.94

4.8.3 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	453,000	33,843,630.00	6.73
2	601939	建设银行	3,557,000	23,938,610.00	4.76
3	601601	中国太保	713,980	23,061,554.00	4.59
4	600536	中国软件	666,000	21,911,400.00	4.36
5	600016	民生银行	1,783,000	19,399,040.00	3.86
6	601398	工商银行	3,757,000	18,296,590.00	3.64
7	601288	农业银行	4,234,981	15,711,779.51	3.12
8	600104	上汽集团	721,000	15,479,870.00	3.08
9	600837	海通证券	620,000	14,917,200.00	2.97
10	601088	中国神华	729,000	14,791,410.00	2.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.huatai-pb.com网站的年度报告正文。

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	33,035,512.05	6.57
2	601601	中国太保	32,096,880.36	6.38
3	600104	上汽集团	28,263,815.62	5.62
4	300339	润和软件	27,119,828.55	5.39
5	600536	中国软件	25,509,479.44	5.07
6	601939	建设银行	23,130,596.52	4.60
7	600837	海通证券	22,896,673.98	4.55
8	600016	民生银行	21,623,088.00	4.30
9	000425	徐工机械	20,497,335.64	4.08
10	300253	卫宁软件	19,471,925.92	3.87
11	601336	新华保险	18,731,894.47	3.72
12	600000	浦发银行	17,823,218.23	3.54
13	002285	世联行	17,794,666.13	3.54
14	000528	柳　工	17,697,586.17	3.52
15	300227	光韵达	17,661,812.45	3.51
16	601398	工商银行	16,544,265.40	3.29
17	600048	保利地产	16,541,267.15	3.29
18	601628	中国人寿	16,419,709.50	3.27
19	300059	东方财富	16,201,079.86	3.22
20	601288	农业银行	15,619,379.44	3.11
21	000024	招商地产	15,559,221.82	3.09
22	601166	兴业银行	14,965,718.83	2.98
23	300098	高新兴	14,623,255.14	2.91
24	000002	万　科A	14,572,946.84	2.90
25	601088	中国神华	14,424,570.00	2.87
26	300016	北陆药业	14,297,553.35	2.84
27	600761	安徽合力	14,083,211.42	2.80
28	002280	新世纪	13,774,783.99	2.74
29	300213	佳讯飞鸿	13,748,409.25	2.73
30	300038	梅泰诺	13,521,143.96	2.69
31	002491	通鼎光电	13,301,205.73	2.64
32	002452	长高集团	13,297,355.25	2.64
33	002329	皇氏集团	13,082,384.00	2.60
34	002446	盛路通信	13,003,018.20	2.59
35	002445	中南重工	12,816,188.33	2.55
36	002065	东华软件	12,788,117.07	2.54
37	002060	粤　水　电	12,722,844.13	2.53
38	300271	华宇软件	12,629,048.70	2.51
39	000937	冀中能源	12,614,878.99	2.51
40	002401	中海科技	12,451,151.67	2.48
41	600028	中国石化	11,796,000.00	2.35
42	002053	云南盐化	11,589,257.40	2.30
43	002496	辉丰股份	11,532,967.00	2.29
44	002223	鱼跃医疗	11,481,174.13	2.28
45	600594	益佰制药	11,232,077.70	2.23
46	000550	江铃汽车	10,821,738.79	2.15
47	600340	华夏幸福	10,475,792.66	2.08

注：本项买入金额均按买卖成交金额（或交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300339	润和软件	31,470,205.40	6.26
2	300253	卫宁软件	23,657,629.00	4.70
3	000425	徐工机械	21,597,783.51	4.29
4	300227	光韵达	17,086,123.46	3.40
5	002285	世联行	16,894,666.42	3.36
6	601336	新华保险	16,778,540.42	3.34
7	300098	高新兴	15,787,184.75	3.14
8	601166	兴业银行	15,758,162.00	3.13
9	002491	通鼎光电	15,458,950.54	3.07
10	000024	招商地产	15,430,690.65	3.07
11	601628	中国人寿	15,305,429.69	3.04
12	000002	万　科A	14,600,382.50	2.90
13	002452	长高集团	14,356,352.13	2.85
14	300038	梅泰诺	14,036,061.28	2.79
15	002445	中南重工	13,830,547.59	2.75
16	002060	粤　水　电	13,223,770.30	2.63
17	601601	中国太保	12,995,868.85	2.58
18	002280	新世纪	12,959,137.28	2.58
19	300213	佳讯飞鸿	12,949,300.63	2.58
20	300016	北陆药业	12,781,280.92	2.54
21	002065	东华软件	12,558,542.93	2.50
22	300271	华宇软件	12,541,486.31	2.49
23	002446	盛路通信	12,392,779.39	2.46
24	002401	中海科技	12,104,502.55	2.41
25	600104	上汽集团	12,079,505.64	2.40
26	002053	云南盐化	11,462,933.82	2.28
27	000937	冀中能源	11,127,932.24	2.21
28	600837	海通证券	10,665,912.09	2.12
29	002223	鱼跃医疗	10,284,705.63	2.05
30	600594	益佰制药	10,088,488.60	2.01

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（或交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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	1,298,736,231.04
卖出股票收入（成交）总额	1,004,382,620.61

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)，中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)作为债务融资工具“13浙建投MTN001”主承销商，在其知发行人浙江省建设投资集团有限公司整合下属子公司少数股东权益事项后未及时组织召开持有人会议，违反了《银行间债券市场非金融企业债务融资工具持有人会议规程》的规定，依据相关自律规定，经自律处分会议审定，给予工商银行、中信银行触谈话处分，并处青令改正。

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	191,682.53
2	应收证券清算款	5,575,233.06
3	应收股利	-
4	应收利息	13,938.61
5	应收申购款	31,594,055.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,374,909.53

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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
3,240	114,940.17	179,526,961.34	48.21%	192,879,176.38	51.79%

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	3,305,587.71	0.8876%

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

注：本公司高级管理人员、基金经理和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为100万份以上，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为10万份至50万份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年5月6日）基金份额总额	267,739,518.28
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	667,769,709.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	563,103,090.06
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	372,406,137.72

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未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

2014年5月15日，公司任命高山先生为公司副总经理，高山先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。 2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。 报告期内本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

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

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为60000元人民币，该事务所已向本基金提供了1年的审计服务。

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

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
长江证券	1	346,983,192.98	15.07%	315,893.18	15.33%	-
中投证券	1	339,277,000.40	14.73%	300,227.74	14.57%	-
光大证券	2	333,323,156.20	14.47%	294,957.44	14.31%	-
东吴证券	2	274,540,869.77	11.92%	242,941.07	11.79%	-
安信证券	2	256,574,588.56	11.14%	233,584.96	11.34%	-
兴业证券	1	245,632,066.75	10.67%	217,359.61	10.55%	-
广发证券	1	141,014,177.35	6.12%	128,378.75	6.23%	-
东方证券	1	113,876,008.53	4.94%	100,769.14	4.89%	-
国元证券	1	75,199,100.33	3.27%	68,461.32	3.32%	-
华鑫证券	1	69,587,330.38	3.02%	61,578.12	2.99%	-
中银国际	1	69,248,534.55	3.01%	63,043.69	3.06%	-
华创证券	1	37,666,309.85	1.64%	33,330.95	1.62%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好、经营行为规范、具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单