

【2013】年度報告摘要

7	606261	阳光电源	3,954,025	54,921,407.25	3.17
8	608994	广日股份	4,905,311	54,153,838.22	3.13
9	002683	宏达爆破	1,700,047	53,177,470.16	3.07
10	000697	顺大 陆	3,201,177	52,659,364.65	3.04

注：报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资前十大股票基金管理人的网站定期报告公示。

8.4 报告期内投资组合报告附注其他资产

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(%)	金额单位：人民币元
1	200703	渤海转债	1,152,404.00		

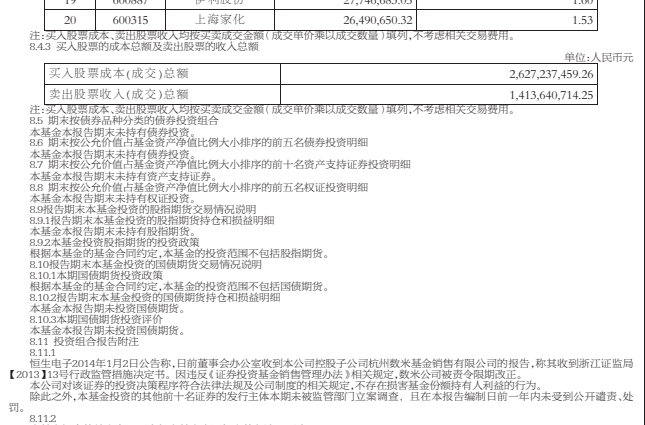
2	600002	万科 A	91,544,340.16	5.29
3	600108	海螺集团	91,333,444.28	5.28
4	600315	上海家化	78,588,943.97	4.54
5	600570	恒生电子	76,665,403.76	4.43
6	002447	壹桥药业	68,367,430.15	3.95
7	000997	新大陆	63,522,351.58	3.67
8	600383	金地集团	60,772,105.19	3.51
9	600011	华能国际	55,216,100.79	3.19
10	600187	国中水务	54,942,610.48	3.17
11	600266	广汇能源	52,782,283.17	3.06
12	600077	宋都股份	51,789,007.29	2.99
13	000607	冠城大通	50,771,479.24	2.93
14	002429	兆驰股份	50,302,656.24	2.91
15	600261	阳光照明	50,224,587.72	2.90
16	000783	长江证券	49,767,134.09	2.87
17	001117	中国化学	49,676,260.66	2.87
18	600552	万兴科技	47,081,903.95	2.72
19	002683	宏大爆破	46,950,534.09	2.71
20	600894	广日股份	45,203,171.96	2.61
21	600703	三安光电	44,814,763.19	2.59

22	300353	东土科技	42,825,426.85	2.47
23	600164	通源石油	42,117,069.83	2.43
24	600340	华夏幸福	41,285,146.24	2.38
25	601333	广沪铁路	41,083,126.81	2.37
26	000662	金马索道	41,077,560.31	2.31
27	600309	万华化学	39,609,564.45	2.29
28	600601	中国石化	38,594,428.92	2.23
29	300059	东方财富	38,363,121.45	2.19
30	000893	东方能源	38,353,334.89	2.06
31	300297	蓝盾股份	35,441,966.00	2.05

注：入股人数众多，且退出时间不一致，因此未披露入股人数及入股时间，以上表格中的数据仅供参考，不作为交易交割依据。

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	金额单位：元	
				占期末基金资产净值比例 (%)	占买入
1	600108	亚盛集团	108,754,764.00	6.28	
2	600011	华能国际	54,720,935.44	3.16	
3	600067	冠城大通	53,340,715.79	3.08	
4	601117	中国化学	51,344,110.56	2.97	
5	600309	万华化学	44,011,934.29	2.54	
6	600597	光明乳业	43,539,947.15	2.51	
7	000662	金马集团	40,227,791.09	2.32	
8	601333	广深铁路	39,018,014.63	2.25	

9	601601	中国太保	39,015,045.61	2.25
10	000581	威孚高科	36,297,344.61	2.10
11	300202	聚龙股份	35,990,054.27	2.08
12	600125	铁龙物流	35,152,734.04	2.03
13	300082	奥克股份	34,867,156.88	2.01
14	601955	永辉超市	33,222,345.04	1.92
15	000661	长春高新	31,119,444.59	1.80
16	300509	东方雨虹	29,632,366.02	1.71
17	002447	壹桥水产	28,388,711.19	1.64
18	600036	招商银行	28,197,290.32	1.63
19	000887	信和股份	23,716,493.06	1.40



本基金投资的前十名股票期末持仓基金合同规定的备选股票名单			单位:人民币元	
序号	名称	金额		
1	存出保证金	478,684.45		
2	应收证券清算款	--		
3	应收股利	--		
4	应收利息	35,540.17		
5	应收申购款	66,083,972.53		
6	其他应收款	--		
7	待摊费用	--		
8	其他	--		
9	合计	66,598,197.15		
8.1.14 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可转换债券				
8.1.15 期末前十名股票中存在流受限情况的说明				
			金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600017	招商局港口	1.38	非公开发行股票

8.1.3 按照中国会计准则和《企业会计准则》的有关规定，公司2020年12月31日归属于母公司的净资产为人民币1,280,420,412.00元，折合人民币12.80亿元。

9.1 期末基金持有人户数及持有产品结构

9.1.1 基金持有人户数及持有产品结构

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占基金份额比例	持有份额	占基金份额比例
5,794	239,736.46	1,055,487,082.50	75.99%	333,545,953.80	24.01%

9.1.2 期末基金持有人地区分布持有本基金的情况

项目	持有的份额总(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	5,821,597.27	0.4191%	
有本基金基金份额持有人,本公司高级管理人员、基金投资和研究人员、直接持有本基金基金份额超过1000份以上;本基金基金经理持 有本基金基金份额超过1000份以上			
9.4.5 基金管理人持有本基金基金份额			
项目	持有的份额数(股)	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额占总持有份额
基金管理人自有资金	4,000,321.60	0.29	三年
基金管理人高级管理人员	4,000,464.46	0.29	三年
基金经理等人员	1,001,101.00	0.07	三年
基金管理人股东	20,000,000.00	1.44	三年

其他	1,000,121.20	0.07	1,000,121.20	0.07	三年
合计	3,001,008.40	2.16	3,001,008.40	2.16	三年

**§10 开放式基金份额变动**

基金合同生效日(2013年3月18日)基金份额总额	266,204,465.59	单位:份
本报告期基金总申购份额	1,618,922,581.03	
减:本报告期基金总赎回份额	496,904,010.32	
本报告期基金净申购份额	-	
本报告期末基金份额总额	1,389,033,036.30	

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换转出份额。

**§11 基金份额持有人大会决议**

11.1 基金份额持有人大会决议

10	本基金管理人高级管理人员发生人事变动。	本基金管理人、基金托管人、基金销售机构均无人事变动。
11	本基金管理人2013年8月8日发布公告，经招商基金管理有限公司研究决定，聘任冯志为不再担任公司副总经理职务，上述变更事项，由招商基金管理有限公司第一届董事会第二十四次会议审议通过，并自决议之日起生效。	本基金管理人2013年8月8日发布公告，聘任黄秀芳为中国建设银行投资托管业务部副总经理。
12	本基金管理人、基金资产、基金托管人的投资。	本基金管理人、基金资产、基金托管人的重大投资事项。
13	本基金投资策略的改变。	本基金无基金投资策略的改变。
14	本基金对基金投资策略的改变。	本基金无基金投资策略的改变。
15	为基金资产提供担保的资产。	本基金于2013年9月1日至2013年9月18日期间，基金资产中计入公允价值计量的非现金资产为基金提供担保服务，本基金报告期内未发生变动。本基金报告期内计入公允价值计量的资产为：

11.7.1 基金租用证券交易单元进行证券投资的情况						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	占当期佣金总额的比例	
华龙证券	2	1,310,711,166.37	32.76%	1,167,382.89	32.28%	
东北证券	2	979,810,025.80	24.49%	892,016.59	24.67%	
中金公司	1	491,663,767.35	12.29%	447,611.14	12.38%	
国信证券	1	472,032,654.45	11.80%	429,738.08	11.88%	

安信证券	1	440,490,278.84	11.01%	401,020.88	11.09%	-
山西证券	1	365,635,825.78	7.64%	278,250.31	7.69%	-
中信证券	1	--	--	--	--	--
第一创业	1	--	--	--	--	--
广州证券	1	--	--	--	--	--
民生证券	1	--	--	--	--	--

注：选择前7席位的标准如下：

- (1) 资格标准：  
券商经纪人必须获得良好、经常行为合规、风险管理先进、投资风格与基金管理人互斥性低，在前一年无重大违法违规行为；
- (2) 业绩标准：  
券商经纪人必须在过去三年中取得良好的业绩，在基金管理人所管理的基金组合中，其负责管理或参与的基金组合的业绩信息能够充分、有效揭示行业特征和风格，并能根据基金管理人所管理基金的特性和要求，提供较为“干净”的数据，具有开发及运用投资组合模型的能力。
- (3) 其他标准：  
券商经纪人能够提供优质的佣金率；与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优质、最合理的佣金率。

基金管理人根据以上标准对申购和赎回申请进行审批，如存在以下情形，基金管理人有权拒绝或暂停接受投资者的申购、赎回申请：(1)因不可抗力导致基金无法正常运作；(2)发生基金合同约定的暂停估值的情形；(3)证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法就当日所发证券进行估值；(4)基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；(5)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购、赎回申请的，应当立即向中国证监会备案并公告，并在拒绝或暂停申购、赎回期间，暂停申购、赎回业务，直至另行通知。货币市场基金除外。

(3)本基金所有交易所交易单元均为本直销网路

11.7.2 基金名称用证券交易所交易单元进行其他证券投资的情况

	债券交易单元	债券回购交易单元	权证交易单元
券商名称	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 成交总额的比例	成交金额 占当期权证 成交总额的比例
华龙证券	-	45,000,000.00	25.42%
东兴证券	-	132,000. 100.00	74.58%

中金公司	--	--	--	--	--	--
国信证券	--	--	--	--	--	--
安信证券	--	--	--	--	--	--
山西证券	--	--	--	--	--	--
中信证券	--	--	--	--	--	--
第一创业	--	--	--	--	--	--
广州证券	--	--	--	--	--	--
民族证券	--	--	--	--	--	--

华海基金管理有限公司  
2014年3月26日