基金管理人:中邮创业基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2014年3月29日

中邮战略新兴产业股票型证券投资基金

2013 年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 重要提示

中邮战略新兴产业股票型证券投资基金管理人中邮创业基金管理有限公司的董事会及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责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司(简称:兴业银行)根据本基金合同规定,于2014年03月25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。

本报告财务资料已经审计,致同会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2013年1月1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	中邮战略新兴产业股票
基金主代码	590008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月12日
基金管理人	中邮创业基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	201,942,081.87份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会,在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。 2.股票投资策略 本基金采用主题投资策略,通过对战略性新兴产业发展状况持续跟踪,结合对国家政策的解读、重大科技和工艺创新情况调研、上市公司战略规划及商业运营模式分析等方法挖掘属于战略性新兴产业范畴的投资主题及相关股票,作为重点进行投资,分享这类企业带来的较高回报。 3.债券投资策略 (1)平均久期配置 本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析,预测未来的利率趋势,并据此积极调整债券组合的平均久期,在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。当预期市场利率上升时,本基金将缩短债券投资组合久期,以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时,本基金将拉长债券投资组合久期,以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。 (2)期限结构配置 结合对宏观经济形势和政策的判断,运用统计和数量分析技术,本基金对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析,预测收益率曲线的变化趋势,制定组合的期限结构配置策略。在预期收益率曲线趋向平坦化时,本基金将采取哑铃型策略,重点配置收益率曲线的两端。当预期收益率曲线趋向陡峭化时,采取子弹型策略,重点配置收益率曲线的中部。当预期收益率曲线不变或平行移动时,则采取梯形策略,债券投资资产在各期限间平均配置。 (3)类属配置 本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。根据中国债券市场存在市场分割的特点,本基金将考察相同债券在交易所市场和银行间市场的利差情况,结合流动性等因素的分析,选择具有更高投资价值的市场进行配置。 (4)回购套利 本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内,适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率,比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险的套利操作。
业绩比较基准	中证新兴产业指数*75%+上证国债指数*25%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		中邮创业基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	吴荣
	联系电话	010-82295160-157	021-52629999-213117
	电子邮箱	houyuc@postfund.com.cn	011693@cib.com.cn
客户服务电话		010-58511618	95561
传真		010-82295155	021-62535823

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.postfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人或基金托管人的办公场所

§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	2013年	2012年6月12日(基金合同生效日)-2012年12月31日	2011年
本期已实现收益	103,965,267.60	5,137,070.65	-
本期利润	149,200,924.79	9,764,228.52	-
加权平均基金份额本期利润	0.7630	0.0365	-
本期基金份额净值增长率	80.38%	4.50%	-
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.5656	0.0276	-
期末基金资产净值	380,718,043.71	60,739,850.71	-
期末基金份额净值	1.885	1.045	-

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.所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.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(为期末余额,不是当前发生额)。

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

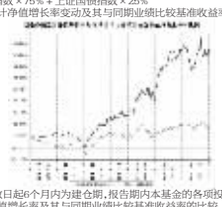
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.37%	1.88%	-0.49%	1.13%	0.12%	0.75%
过去六个月	35.81%	1.92%	13.13%	1.13%	22.68%	0.79%
过去一年	80.38%	1.79%	18.99%	1.16%	61.39%	0.63%
自基金合同生效起至今	88.50%	1.53%	11.16%	1.10%	77.34%	0.43%

注:1.所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.关于业绩基准的说明

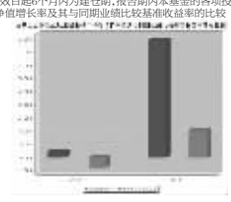
本基金业绩衡量基准=中证新兴产业指数×75%+上证国债指数×25%

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:按相关法规规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§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

基金管理人中邮创业基金管理有限公司成立于2006年5月18日,旗下目前管理九只开放式基金产品,分别为中邮核心优选股票型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证380指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业股票型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放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		
厉建超	基金经理	2012年6月12日	2013年7月23日	12年	经济学硕士,曾任中国证券市场研究设计中心高级研究员、东吴基金管理有限公司研究员、中海基金管理有限公司研究员、中邮创业基金管理有限公司研究员,主要负责信息、新能源等新兴产业的研究工作,中邮创业基金管理有限公司中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任中邮核心优选股票型证券投资基金基金经理、中邮战略新兴产业股票型证券投资基金基金经理。
任泽松	基金经理	2012年12月21日	-	4年	生物学硕士,曾任毕马威华振会计师事务所审计员、北京源乐晟资产管理有限公司行业研究员、中邮创业基金管理有限公司研究部行业研究员、中邮创业基金管理有限公司中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理助理兼行业研究员,现任中邮战略新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

注:基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的基金经理注册或变更等通知的日期。证券从业的含义遵从行业协会《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公平交易管理制度的规定,各基金在研究、投资、交易等各方面受到公平对待,确保各基金获得公平交易的机会。

报告期内,本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求;交易行为合法合规,未出现操纵市场的现象;未发生内幕交易的情况;相关的信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务、注册登记业务均按规定的程序、规则进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

报告期内,因本基金管理人恒生交易系统未对停牌期内的股票估值权指数估值法进行重新调整,导致恒生系统计算出的本基金资产净值比实际资产净值大,从而造成本基金持有的苏大维格(证券代码300331)市值连续十个交易日超过基金资产净值的10%,违反了《证券投资基金运作管理办法》。在接到基金托管人的风险提示后,本基金管理人已及时查出恒生系统错误原因,进行相应的减仓操作,并于当日将该股票的投资比例调整至符合《证券投资基金运作管理办法》规定的范围。

除此,本基金的其他投资运作行为均严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定以及基金合同的约定。

4.3 管理人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,基金管理人的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字(2014)第110ZA0689号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中邮战略新兴产业股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的中邮战略新兴产业股票型证券投资基金(以下简称中邮战略新兴产业基金)财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表,2013年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中邮战略新兴产业基金的基金管理人中邮创业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,中邮战略新兴产业基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中邮战略新兴产业基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和所有者权益(基金净值)变动情况。
注册会计师的姓名	邓传洲 李惠琦
会计师事务所的名称	致同会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国北京 朝阳区建国门外大街22号赛特广场5层
审计报告日期	2014年3月10日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中邮战略新兴产业股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		43,441,546.57	20,265,014.01
结算备付金		1,510,573.10	294,504.30
存出保证金		940,459.13	500,000.00
交易性金融资产		337,194,485.54	40,571,051.53
其中:股票投资		337,194,485.54	40,571,051.53
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		18,974.80	6,643.02
应收股利		-	-
应收申购款		-	313,292.60
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		383,106,039.14	61,950,505.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		776,465.01	309,910.29
应付管理人报酬		498,078.73	96,628.85
应付托管费		83,013.12	16,104.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		947,522.95	226,842.82
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		82,915.62	561,167.99
负债合计		2,387,995.43	1,210,654.75
所有者权益:			
实收基金		201,942,081.87	58,107,167.88
未分配利润		178,775,961.84	2,632,682.83
所有者权益合计		380,718,043.71	60,739,850.71
负债和所有者权益总计		383,106,039.14	61,950,505.46

注:报告截止日:2013年12月31日,基金份额净值:1.885元,基金份额总额:201,942,081.87份。

7.2 利润表

会计主体:中邮战略新兴产业股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		159,724,897.33	13,228,535.83
1.利息收入		935,796.72	2,575,411.96
其中:存款利息收入		854,105.96	1,271,841.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		81,690.76	1,303,570.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		112,247,180.88	5,360,049.76
其中:股票投资收益		111,586,097.71	5,232,477.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		661,083.17	127,572.64
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		45,235,657.19	4,627,157.87
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,306,262.54	665,916.24
减:二、费用		10,523,972.54	3,464,307.31
1.管理人报酬		4,947,393.58	2,168,654.27
2.托管费		824,565.53	361,442.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		4,238,020.56	665,472.47
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		513,992.87	268,738.24
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		149,200,924.79	9,764,228.52
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		149,200,924.79	9,764,228.52

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中邮战略新兴产业股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	58,107,167.88	2,632,682.83	60,739,850.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	149,200,924.79	149,200,924.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	143,834,913.99	26,942,354.22	170,777,268.21
其中:1.基金申购款	776,705,471.26	445,365,540.74	1,222,071,012.00
2.基金赎回款	-632,870,557.27	-418,423,186.52	-1,051,293,743.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	201,942,081.87	178,775,961.84	380,718,043.71

项目	上年度可比期间 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	575,757,582.95	-	575,757,582.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,764,228.52	9,764,228.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-517,650,415.07	-7,131,545.69	-524,781,960.76
其中:1.基金申购款	7,728,796.45	216,420.02	7,945,216.47
2.基金赎回款	-525,379,211.52	-7,347,965.71	-532,727,177.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	58,107,167.88	2,632,682.83	60,739,850.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

周克_____ 周克_____ 吕伟卓_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中邮战略新兴产业股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]1951号《关于核准中邮战略新兴产业股票型证券投资基金募集的批复》核准,由中邮创业基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《中邮战略新兴产业股票型证券投资基金基金合同》发起,并于2012年6月12日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集包括认购资金利息共募集576,757,582.95元,业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字(2012)第0058号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮战略新兴产业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,在正常市场情况下,本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为:股票资产占基金资产的50%-95%,债券资产占基金资产的0%-40%,权证占基金资产净值的0%-3%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于战略性新兴产业相关股票比例不低于基金股票资产的80%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制,执行财政部2006年2月15日颁布的企业会计准则和中国证券业协会2007年6月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会2010年2月8日颁布的证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板3号<年度报告和半年度报告>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求,真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和所有者权益(基金净值)变动情况等有关信息。

7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本期内本基金无会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本期内本基金无会计估计变更。

7.4.4.3 差错更正的说明

本期本基金无差错更正。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]11号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金主要税项列示如下:

1. 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

2. 自2013年1月1日起,对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得。

3. 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

4. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中邮创业基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国邮政集团公司	基金管理人的股东
三井住友银行股份有限公司	基金管理人的股东
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金管理人股东控股的公司、基金代销机构

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,947,393.58	2,168,654.27
其中:支付销售机构的客户维护费	1,921,430.98	222,455.29

注:支付基金管理人中邮创业基金管理有限公司的基金管理人报酬,按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	824,565.53	361,442.33

注:支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费,按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本期及上年度可比期间,本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本期及上年度可比期间,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.7.4.2 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

注:本期末及上年度末,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	43,441,546.57	822,678.34	20,265,014.01	1,188,262.08

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本期及上年度可比期间,本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.8 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期未未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	337,194,485.54	88.02
	其中:股票	337,194,485.54	88.02
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	44,952,119.67	11.73
6	其他各项资产	959,433.93	0.25
7	合计	383,106,039.14	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	-	-
B	采矿业	20,007,867.44	5.26
C	制造业	142,861,167.68	37.52
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	153,871,847.44	40.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	20,453,602.98	5.37
S	综合	-	-
	合计	337,194,485.54	88.57

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

金额单位:人民币元

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	300324	旋极信息	2,290,000	62,081,900.00	16.31
2	300331	苏大维格	942,417	39,232,819.71	10.30
3	300271	华宇软件	1,300,000	37,180,000.00	9.77
4	300267	尔康制药	940,342	34,698,619.80	9.11
5	300300	汉鼎股份	1,743,950	34,111,662.00	8.96
6	300285	国瓷材料	1,011,598	32,087,888.56	8.43
7	300148	天舟文化	809,723	20,453,602.98	5.37
8	002207	准油股份	1,200,232	20,007,867.44	5.26
9	300353	东土科技	774,190	17,798,628.10	4.68
10	300166	东方国信	650,176	17,678,285.44	4.64

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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300072	三聚环保	76,636,493.85	126.17
2	300331	苏大维格	69,804,772.72	114.92
3	300267	尔康制药	69,736,874.63	114.81
4	300300	汉鼎股份	66,146,945.08	108.90
5	000400	许继电气	60,922,716.54	100.30
6	300324	旋极信息	52,888,804.83	87.07
7	300113	顺网科技	52,679,132.09	86.73
8	300207	欣旺达	49,511,887.95	81.51
9	002618	丹邦科技	48,462,340.92	79.79
10	300285	国瓷材料	44,376,387.49	73.06
11	300349	金卡股份	43,626,035.94	71.82
12	300079	数码视讯	39,194,917.79	64.53
13	300054	鼎龙股份	39,096,204.08	64.37
14	300148	天舟文化	37,130,459.12	61.13
15	600251	冠农股份	36,768,923.82	60.54
16	600519	贵州茅台	35,720,834.93	58.81
17	300271	华宇软件	34,620,580.68	57.00
18	601231	环旭电子	34,568,996.65	56.91
19	600804	鹏博士	26,102,901.43	42.97
20	300261	雅本化学	24,347,748.11	40.09
21	300115	长盈精密	24,178,388.32	39.81
22	000516	开元投资	22,667,202.53	37.32
23	002161	远望谷	22,494,560.20	37.03
24	600109	国金证券	22,298,520.28	36.71
25	002207	准油股份	20,657,205.01	34.01
26	300161	华中数控	20,553,481.94	33.84
27	600728	佳都新太	20,041,013.65	32.99
28	300135	宝利沥青	19,186,058.19	31.59
29	300337	银邦股份	18,510,992.53	30.48
30	300023	宝德股份	18,403,650.27	30.30
31	300057	万顺股份	18,127,050.96	29.84
32	300182	捷成股份	17,992,926.23	29.62
33	300353	东土科技	17,912,535.01	29.49
34	601929	吉视传媒	17,639,519.85	29.04
35	300166	东方国信	15,637,917.94	25.75
36	300251	光线传媒	15,462,816.57	25.46
37	000948	南天信息	12,608,404.65	20.76
38	300327	中颖电子	11,952,450.05	19.68
39	601208	东材科技	11,879,137.18	19.56
40	300154	瑞凌股份	11,607,808.91	19.11
41	300342	天银机电	11,366,065.14	18.71
42	300123	太阳鸟	10,910,951.00	17.96
43	000938	紫光股份	10,241,227.50	16.86
44	002643	烟台万润	10,113,714.17	16.65
45	300192	科斯伍德	9,561,437.87	15.74
46	002382	蓝帆股份	8,634,323.97	14.22
47	002264	新华都	7,190,969.07	11.84
48	300332	天壕节能	7,075,706.20	11.65
49	002551	尚荣医疗	6,948,068.48	11.44
50	002281	光迅科技	6,625,812.22	10.91
51	002259	升达林业	6,317,052.43	10.40
52	000768	中航飞机	4,748,997.48	7.82
53	002454	松芝股份	4,638,236.47	7.64
54	600315	上海家化	4,622,518.00	7.61
55	002646	青青稞酒	4,618,901.59	7.60
56	300181	佐力药业	4,532,803.76	7.46
57	300282