

申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金

2014 半年度报告摘要

证券投资基金2014年半年度报告财务指标、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详见正文，以内容为准，准确完整。

6.1 资产负债表 6 半年度财务会计报告(未经审计)

单位:人民币元

资产	期末	期初
货币资金	13,035,682.72	13,035,682.72
结算备付金	1,228,193.99	1,228,193.99
存出保证金	107,576.88	107,576.88
交易性金融资产	154,616,354.75	154,616,354.75
其中:股票投资	154,616,354.75	154,616,354.75
债券投资	-	-
其他金融资产	-	-
应收利息	3,407.69	3,407.69
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	32,975.05	32,975.05
资产总计	169,023,756.48	169,023,756.48

负债和所有者权益

负债	期末	期初
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付赎回款	-	-
交易性金融负债	-	-
其他金融负债	-	-
其他负债	-	-
所有者权益	169,023,756.48	169,023,756.48

6.2 净值表现

注:1. 本报告期内本基金累计净值增长率为4.31%，同期业绩比较基准收益率为3.28%。

注:2. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:3. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:4. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:5. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:6. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:7. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:8. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:9. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:10. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:11. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:12. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:13. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:14. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:15. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:16. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:17. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:18. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:19. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:20. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:21. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:22. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:23. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:24. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:25. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:26. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:27. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:28. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:29. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:30. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:31. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:32. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:33. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:34. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:35. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:36. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:37. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:38. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:39. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:40. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:41. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:42. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:43. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:44. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:45. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:46. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:47. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:48. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:49. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:50. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:51. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:52. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:53. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:54. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:55. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:56. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:57. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:58. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:59. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:60. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:61. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:62. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:63. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:64. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:65. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:66. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:67. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:68. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:69. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

注:70. 本基金自2014年6月30日起实施侧袋机制，侧袋账户资产净值占基金资产净值的比例为0.00%。

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	600300	中信证券	58,697,722.63	32.70
2	600837	海康威视	37,272,103.85	22.13
3	600776	广发证券	15,783,419.94	9.37
4	601901	方正证券	13,247,201.13	7.87
5	601688	华泰证券	12,008,083.36	7.12
6	600739	中信建投	11,264,364.32	6.69
7	600999	招商证券	9,296,628.25	5.52
8	601039	国信证券	9,176,643.17	5.47
9	601577	中国银河	8,886,864.89	5.25
10	600783	北汽控股	8,378,147.76	4.97
11	600623	普华永道	6,791,587.49	3.98
12	601788	光大证券	6,263,327.27	3.72
13	601099	太平洋	5,937,437.40	3.54
14	601555	东吴证券	4,987,310.91	2.93
15	601006	华泰证券	4,811,144.25	2.87
16	000728	国元证券	4,796,423.25	2.84
17	600309	西南证券	4,029,398.38	2.39
18	000750	国信证券	3,695,982.13	2.19
19	002500	山东黄金	3,011,124.50	1.79
20	002628	奇安信	2,635,848.79	1.56

7.4.2 买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600300	中信证券	58,697,722.63	32.70
2	600837	海康威视	37,272,103.85	22.13
3	600776	广发证券	15,783,419.94	9.37
4	601901	方正证券	13,247,201.13	7.87
5	601688	华泰证券	12,008,083.36	7.12
6	600739	中信建投	11,264,364.32	6.69
7	600999	招商证券	9,296,628.25	5.52
8	601039	国信证券	9,176,643.17	5.47
9	601577	中国银河	8,886,864.89	5.25
10	600783	北汽控股	8,378,147.76	4.97
11	600623	普华永道	6,791,587.49	3.98
12	601788	光大证券	6,263,327.27	3.72
13	601099	太平洋	5,937,437.40	3.54
14	601555	东吴证券	4,987,310.91	2.93
15	601006	华泰证券	4,811,144.25	2.87
16	000728	国元证券	4,796,423.25	2.84
17	600309	西南证券	4,029,398.38	2.39
18	000750	国信证券	3,695,982.13	2.19
19	002500	山东黄金	3,011,124.50	1.79
20	002628	奇安信	2,635,848.79	1.56

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本(成交总额)	卖出股票的收入(成交总额)
228,120,472.48	70,437,609.26

注:“买入金额”、“卖出金额”均按买卖成交金额(成交金额乘以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按市值计量的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金本报告期末持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

7.11 本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12 本基金投资的期权持仓和损益明细

7.13 本基金投资的资产支持证券明细

7.14 本基金投资的银行理财产品明细

7.15 本基金投资的结构性理财产品明细

7.16 本基金投资的信托计划明细

7.17 本基金投资的私募股权基金明细

7.18 本基金投资的私募证券投资基金明细

7.19 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.20 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.21 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.22 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.23 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.24 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.25 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.26 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.27 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.28 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.29 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.30 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.31 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.32 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.33 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.34 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.35 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.36 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.37 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.38 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.39 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.40 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.41 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.42 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.43 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.44 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.45 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.46 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.47 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.48 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.49 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.50 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.51 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.52 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.53 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.54 本基金投资的私募股权投资基金明细

7.55 本基金投资的私募股权投资基金明细