

## 【2014】半年度报告摘要

# 配置混合型证券投资基金

## 年度报告摘要

[illegible]

6.4.3.2.2 基金托管费				
项目	2014年1月1日至2014年6月30日	本期	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期为基金托管人应付的托管费		817,096.64		952,687.38
注：1、托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ H为每日应计提的托管费 E为前一日的基金资产净值 2、托管费每日计提，逐月累计至每个月末，按月支付。		176,441.99		187,014.63
注：2、基金托管费于2014年上半年未支付的金额为¥11,027.07，于2013年上半年未支付的金额为¥179,330.66。				
6.4.3.2.3 基金销售服务费				
项目	2014年1月1日至2014年6月30日	本期	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期为基金托管人应付的托管费		136,347.82		65,447.80
注：1、销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ H为每日应计提的基金销售服务费 E为前一日的基金资产净值				

[illegible]

6.4.03 其他关联交易事项的说明										
6.4.10 货币	2014年4月30日	1	本基金会持有的流通受限证券							
6.4.11 以公允价值计量的金融资产	2014年4月30日	1	本基金会持有的流通受限证券							
6.4.12 其他金融资产投资、投资				金额单位：人民币千元						
证券名称	投资名称	可流通日	公允价值类型	认购价格	期末公允价值	数量(股)	期末公允价值总额	期末公允价值总额	备注	
603369	众安保险	2014年6月25日	2014年7月1日	16.93	16.93	14,931,100	14,930,000	15,000,000		
002727	汇通	2014年6月25日	2014年7月1日	12.30	12.30	500	6,300,000	6,300,000		
6.4.12.2 期末持有的以公允价值计量的金融资产				金额单位：人民币千元						
股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末公允价值	赎回日期	赎回价格/公允价值	数量(股)	期末公允价值总额	期末公允价值总额	备注
		2014年6月25日	流动性差							

300721	华孚时尚	27日	重 大 事 件	60.30	-	-	31,969	1,140,840,840	1,488,888.10
300379	东方盛虹	2014年7月 23日	重 大 事 件	62.17	2014年 7月13日	67.39	15,967	946,513.65	992,668.39

6.10.2 回购价格与证券市场价格存在差异的，说明理由：  
6.10.2.1 银行间市场债券正回购：本基金未从事有从银行间市场债券正回购交易中作为融资方的债券。  
6.10.2.2 交易所市场债券正回购：本基金未从事有从交易所市场债券正回购交易中作为融资方的债券。  
6.11 对于理财产品风险分析报告需要说明的其他重要事项：  
截至资产负债表日，本基金无需说明的承诺事项。  
其他承诺：  
截至资产负债表日，本基金无需说明的其他重要事项。

### 7.1 期末基金资产组合情况

#### 7.1.1 权益投资

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	77,952,066.46	83.70

	其中:担保	77,752,986.46	83.70
2	银行存款	7,489,352.20	8.06
	其中:质押	7,489,352.20	8.06
	银行承兑汇票	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	委托理财及委托贷款	—	—
5	其他金融资产投资	—	—
	其中:结构性理财产品,买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和现金资产合计	6,354,941.20	6.84
7	其他类固定资产	1,300,044.12	1.40
		92,936,426.98	100.00

7.2 期末按行权分类的股票期权负债情况

负债		公允价值	金融资产(负债)公允价值
A	待、授、业	115,900.00	0.13
B	资产	—	—

C	制造业	55,705,780.07	61.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	191,000.00	0.08
F	批发和零售业	6,400.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,386,000.00	2.54
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,692,066.39	12.78
J	金融业	3,000,000.00	0.33
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	502,500.00	0.55
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	9,886,000.00	10.75

合计		2,296,000.00	2.48
期末按公允价值计量金融资产净值占期末小排行的前八十股票投资金额		77,592,066.46	85.63

7.2 期末按公允价值计量金融资产净值占期末小排行的前八十股票投资金额

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占期末公允价值金融资产净值比例(%)
1	300307	东方通信	154,896	4,522,063.20	4.38
2	000561	金健米业	160,000	2,945,000.00	2.84
3	300368	华力创通	169,000	2,906,000.00	3.23
4	300098	三圣生物	71,808	2,883,160.20	3.14
5	002349	精华制药	149,911	2,767,387.06	3.05
6	000513	神州高铁	54,972	2,596,327.56	2.86
7	300362	华力药业	20,000	2,538,000.00	2.74
8	300063	亚星客车	29,000	2,508,000.00	2.75
9	600422	世昌新材	109,080	2,301,679.80	2.53
10	002711	广博通信	60,000	2,306,400.00	2.55

7.4 期末按公允价值计量金融资产净值占期末小排行的前八十股票投资金额

7.1	序号	基金名称	股票市值	基金资产净值	股票市值占基金资产净值比例(%)
1	000065	新华优选	7,789,441.40	5.51	
2	000553	新华动力	7,591,447.50	5.38	
3	000087	新华价值	7,310,348.00	5.20	
4	000422	新华稳健	6,970,584.18	4.89	
5	000719	新华成长	6,597,076.43	4.67	
6	000651	新华回报	6,486,357.02	4.59	
7	000774	新华策略	6,295,566.79	4.47	
8	000202	新华多利	6,100,316.14	4.32	
9	000097	新华蓝筹	6,051,796.28	4.29	
10	300067	新华动力	5,980,751.10	4.24	
11	300168	新华蓝筹	5,713,164.00	4.09	
12	000629	新华回报	5,513,780.07	3.95	
13	000996	新华蓝筹	5,116,268.79	3.62	

14	002068	汇通能源	5,101,889.00	3.61
15	300077	汇源光电	4,900,499.40	3.51
16	002079	凯撒股份	4,726,626.73	3.39
17	300047	金富药业	4,520,885.27	3.25
18	002711	欧陆集团	4,447,544.00	3.13
19	300104	长海股份	4,408,439.40	3.10
20	600035	上海石化	4,380,409.70	3.11
21	002085	广汇能源	4,358,468.43	3.08
22	300027	联拓光电	4,337,758.72	3.07
23	600008	鲁航长	4,326,738.00	3.07
24	002084	西陇化工	4,274,272.79	3.05
25	002405	广宇集团	4,144,569.32	2.94
26	002349	恒泰证券	4,044,686.73	2.87
27	600808	用友软件	3,843,345.00	2.72
28	002435	海康威视	3,837,769.79	2.72

29	600581	东方证券	3,776,286.99	2.68
30	600584	上海物贸	3,570,271.31	2.61
31	500075	华研精密	3,046,437.89	2.08
32	600587	康缘药业	3,614,696.03	2.56
33	002373	千方科技	3,583,560.39	2.54
34	600915	大唐电信	3,879,626.61	2.63
35	600288	包钢稀土	3,825,679.29	2.62
36	300226	上海钢联	3,518,328.75	2.49
37	002550	红红纺织	3,369,424.00	2.39
38	600872	中泰证券	3,361,161.00	2.38
39	300566	宇信科技	3,345,335.55	2.37
40	500043	云南城投	3,331,080.04	2.36
41	300208	云赛智联	3,159,753.92	2.23
42	300168	美吉科粉	3,040,010.00	2.15
43	600768	东方医药	2,928,098.14	2.07

45	600593	发债资产	2,051,439.20	2.02
46	000533	华鲁制药	2,826,638.20	2.79
注：1、本期资产注入金额=投入大交数金额+投入中交数金额+投入小交数金额，不考虑相关交易费用。				
2、资产注入比例=本期资产注入金额/期初总资产				
				金额单位：人民币元
序号	股票代码	股票名称	本期资产注入金额	占期初总资产比例(%)
1	000095	双环发展	11,139,848.96	7.80
2	000887	伊利股份	9,036,134.74	6.97
3	000313	上海家化	9,736,814.85	6.93
4	000533	华鲁制药	9,625,397.52	6.92
5	000066	青岛啤酒	8,054,475.05	6.27
6	000418	江淮汽车	8,308,011.78	5.88
7	000155	华芳纺织	8,225,606.13	5.83
8	000626	宏发电子	8,134,321.16	5.77
9	000476	荣泰发展	7,990,268.58	5.59
10	300274	阳光电源	7,550,248.67	5.27

46	000933	东药集团	2,051,439.20	2.02
45	000573	东江集团	2,028,636.20	2.00
(注：*本财务报表未包含“拟投入或交还的”或“交还的资产以或交还的”属项，不考虑相关关联交易。				
注：*本财务报表未包含“拟投入或交还的”或“交还的资产以或交还的”属项，不考虑相关关联交易。				
注：*本财务报表未包含“拟投入或交还的”或“交还的资产以或交还的”属项，不考虑相关关联交易。				金额单位：人民币
序号	股票代码	投资对象	金额(人民币)	金额单位：人民币
1	000095	发展银行	11,038,888.96	7.80
2	000807	伊利股份	9,038,131.74	6.97
3	000115	上海医药	9,736,831.45	6.93
4	000533	金城汽车	9,620,287.92	6.93
5	000066	中国铝业	8,054,475.05	6.27
6	000418	江铃汽车	8,308,011.78	5.88
7	000597	光明乳业	8,225,601.33	5.83
8	000625	民生银行	8,143,321.16	5.77
9	000076	中国石化	7,890,261.58	5.76
10	200274	阳光电源	7,150,248.67	5.07
11	000718	东药集团	6,690,550.28	4.74
12	300367	东方医疗	6,532,461.80	4.61
13	000807	伊利股份	5,795,607.72	4.17
14	000573	东江集团	5,095,210.74	4.03
15	000508	中航光电	5,634,251.29	3.99
16	000681	格力电器	5,611,278.49	3.97
17	000501	格力电器	5,424,627.74	3.84
18	000575	中航光电	5,295,591.92	3.75
19	000565	中航光电	5,255,995.74	3.73
20	000535	格力电器	5,218,345.72	3.70
21	000422	招商银行	4,944,712.72	3.50
22	000333	美的集团	4,742,895.85	3.36
23	000128	格力电器	4,680,762.11	3.35
24	000323	美的集团	4,660,156.50	3.30
25	000266	三一重工	4,673,121.06	3.27

26	000963	华东医药	4,337,405.96	3.07
27	002584	西陇化工	4,246,696.21	3.01

26	000963	华东医药	4,337,405.96	3.07
27	002584	西陇化工	4,246,696.21	3.01

无

民生加银基金管理有限公司  
2014年8月26日