信诚四季红混合型证券投资基金

[2013] 年度报告摘要

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年3月28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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读年度报告正文。

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	信诚四季红混合	
基金主代码	550001	
交易代码	前端交易代码:550001	后端交易代码:551001
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年4月29日	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,481,017,485.53份	
基金合同存续期	不定期	

2.2基金产品说明

投资目标	在有效配置资产的基础上,精选投资标的,追求在稳定分红的基础上,实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金在充分借鉴英国保诚集团的资产配置理念和方法的基础上,建立了适合国内市场的资产配置体系。本基金的资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA)。战略性资产配置(SAA)即决定投资组合中股票、债券和现金各目的长期均衡比重,按照本基金的风险偏好以及对资本市场各大类资产在长期均衡状态下的期望回报率假定而作出。战术性资产配置(TAA)是本基金资产配置的核心,是指根据特定市场情况对在一定时段持有某类资产的预期回报作出预测,并围绕基金资产的战略性资产配置基准,进行相应的短中期资产配置的过程。
业绩比较基准	62.5%×富时中国全A指数收益率+32.5%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	作为一只混合型基金,本基金的资产配置中股(股票62.5%,债券32.5%)确立了本基金在平衡型基金中的中等风险定位,因此本基金在证券投资基金中属于中等风险。同时,通过严谨的研究和稳健的操作,本基金力争在严格控制风险的前提下谋求基金资产的平长期稳定增值。

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		信诚基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐世春	李芳菲
	联系电话	021-68649788	010-66060069
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	95599
传真		021-50120888	010-63201816

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.xcfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所

§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	2011年
本期已实现收益	347,595,593.29	−623,456,773.13	−747,644,291.57
本期利润	340,912,226.01	−7,785,273.27	−1,620,599,581.06
加权平均基金份额本期利润	0.1228	−0.0022	−0.3578
本期基金份额净值增长率	16.51%	−2.13%	−33.16%
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	−0.1751	−0.2992	−0.2740
期末基金资产净值	2,053,867,917.89	2,282,219,932.79	3,203,100,600.35
期末基金份额净值	0.8278	0.7105	0.7260

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、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。

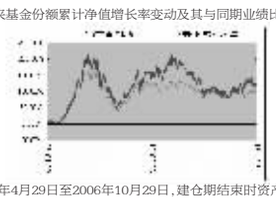
3.2基金净值表现

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	−1.17%	1.31%	−1.70%	0.75%	0.53%	0.56%
过去六个月	8.99%	1.25%	6.81%	0.79%	2.18%	0.46%
过去一年	16.51%	1.32%	1.33%	0.84%	15.18%	0.48%
过去三年	−23.79%	1.17%	−12.43%	0.84%	−11.36%	0.33%
过去五年	40.45%	1.34%	35.88%	0.97%	4.57%	0.37%
自基金合同生效起至今	127.19%	1.48%	95.04%	1.21%	32.15%	0.27%

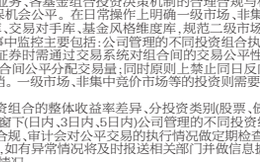
注:本基金的业绩比较基准为62.5%×富时中国全A指数收益率+32.5%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率

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:本基金建仓期自2006年4月29日至2006年10月29日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 过去五年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:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	−	−	−	−	本基金本期未分红。
2012	−	−	−	−	本基金本期未分红。
2011	0.510	158,024,525.07	88,229,384.88	246,253,909.95	本基金本期分红两次。
合计	0.510	158,024,525.07	88,229,384.88	246,253,909.95	本基金最近三年共利润分配两次

§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

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于2005年9月30日正式成立,注册资本2亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为49%、49%、2%。截至2013年底,本基金管理人共管理28只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚双益分级债券型证券投资基金、信诚周期轮动股票型证券投资基金(LOF)、信诚理财7日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业股票型证券投资基金、信诚中证800医药指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚季定期支付债券性证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金及信诚月月定期支付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		
阚志刚	本基金基金经理	2010年5月25日	−	12	清华大学MBA,12年证券、基金从业经验。曾先后在世纪证券、平安证券、平安资产管理有限公司从事投资研究工作。2008年加盟信诚基金管理有限公司,曾担任保诚韩国中国龙A股基金(QFII)投资经理(该基金由信诚基金担任投资顾问),现任信诚四季红混合基金的基金经理。

注:1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.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管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》、《信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:

定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差,对反向交易等进行价差分析。同时,合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%情况有一次,为与采用量化策略的指数基金反向,且发生反向交易时间不重叠,无异常情况。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年,对于投资者来说,是检验其投资理念和投资风格的一年。主板和创业板巨大的涨跌幅差异、传统的价值蓝筹股和新兴行业成长股的估值差异,无不体现得淋漓尽致。究其原因,中国传统增长模式难以为继、约束重重,资本市场在信息服务、文化传媒、信息设备、医疗服务、环保等行业寻找突破和转型方向,转型和改革的观念深入人心,人心思变,这也许是出现这种差异的主要原因。

从投资机会来说,今年的电子、通信、信息服务、信息设备、医药、环保等行业,以及自贸区、国企改革等主题性板块均得到了很好的表现,但是金融、地产等则很惨淡。由于对本轮结构化行情演绎到如此程度缺乏足够的认识,组合相对均衡地配置了部分传统的金融、地产等行业,同时对新兴成长股的持有不够坚定,其中估值的巨大差异的确是一个考验,组合较早地减持了部分成长类股票;另外,对一些主题性的投资机会也没有较好把握,这些都对组合业绩产生了较大的拖累。

贯穿2013年的投资逻辑和主线一直没有变,理解深刻、坚定方向后的投资回报远远高于对这一投资逻辑和主线的犹豫和游离,也许,提高对市场的理解和认识、拓宽宏观视野,加深行业和公司的理解后,投资能力可能会有所提高。希望通过持续修炼,提升自身,争取为持有人获得较好的回报。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

信诚四季红在2013年的份额净值增长率16.51%,业绩比较基准收益率1.33%,基金表现超越基准15.18个百分点。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年,随着三中全会决定内容的实施,中国经济的长期风险会有所下降,同时也会带来改革引发的阵痛。面对种种挑战,落实和深化改革尤为重要,同时,中国经济的转型也刻不容缓,资本市场已经并将持续反映这种转变,当然,资本市场自身的改革也会对其结构和体系产生巨大的影响。因此,2014年的资本市场将较2013年复杂,但投资逻辑和主线可能依然是改革和转型。对于我们来说,我们需要在坚持这一逻辑的同时,做好优质个股的选择和操作。

4.6管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013年度内,公司依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度,在督察长的指导和监察稽核部的努力下,开展了一系列监察稽核工作,取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下:

1.协调监管部门现场检查工作,全面加强公司内控建设。

2013年7月底至8月初,上海证监局对我公司进行了专项现场检查。监察稽核部对本次现场检查进行了积极的配合工作。通过本次现场检查,能更客观地发现公司各项内控中的薄弱环节,有助于督促公司不断改进流程设计,加强内控建设,提高经营效率。

2.对公司管理制度体系不断修订和完善。

监察稽核部负责对公司制定的规章制度进行审核和修订,主要包括从业人员投资管理、产品规划决策及开发业务管理、业务系统参数管理、专户产品预警流程、信息安全等方面。这些制度的修订和完善对确保公司各项业务顺利、规范地进行起到了很好的促进作用。

3.开展各类合规监控工作。

在投资合规监控方面,公司严格遵照法律法规和公司制度对公司和基金运作的合规情况进行监控。在基金日常投资运作过程中,监察稽核部和风险管理部对基金投资进行了事前、事中和事后的全方位监控,发现问题及时与相关部门沟通。对销售的合规监控方面,严格审核各类宣传推介材料和营销活动行为,确保各项行为的合法合规性。

4.强化合规培训教育,提高全员合规意识。

本报告期内,监察稽核部及时将新颁布的法律法规传递给各相关业务部门,并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训。本年度,监察稽核部根据监管部门的要求,结合自身实际情况,主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。

5.开展各类内部审计工作,包括4次季度常规审计以及5项针对性质较为重要或核心业务领域的专项审计工作。

6.完成各只基金及公司的各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的要求进行信息披露和公告,包括基金发行时的法律文件、基金季度报告、半年度报告、年度报告、分红公告以及在深圳证券交易所进行LOF基金生效、开放申赎、上市交易及定期报告等内容的公告,并报监管机关备案。

7.牵头开展反洗钱的各项工作,并按照相关规定将相关可疑记录及时上报反洗钱监测中心。根据人民银行下发的规定,研究落实客户风险等级划分措施。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员:分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则,《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》和《信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、债券及其他中国证监会批准的投资工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产30%-95%;债券资产0-65%(不包括到期日在一年以内的政府债券);现金或者到期日在一年内的政府债券不低于5%。本基金的业绩比较基准为:62.5%×富时中国全A指数收益率+32.5%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算指引》、《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006 年2 月15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错。

7.4.5 税项

根据财税字[1998]55号文、[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号文《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》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(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)基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)自2005年1月24日起,基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自2007年5月30日起,该税率上调至0.3%。自2008年4月24日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,调整证券(股票)交易印花税税率,由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,证券交易印花税改为单边征收,即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收。

(5)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

自2013年1月1日起,根据财税[2012]85号《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》,个人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税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

7.4.7.1通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本年度及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

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1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	32,842,716.48	39,192,844.94
其中:支付销售机构的客户维护费	7,295,479.13	7,278,967.76

注:支付基金管理人信诚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1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/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1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,473,786.01	6,532,140.85

注:支付基金托管人农业银行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

本基金在本年度与上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(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

份额单位:份

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1月1日至2012年12月31日
基金合同生效日(2006年4月29日)持有的基金份额	−	−
报告期初持有的基金份额	4,979,976.35	4,979,976.35
报告期间申购/买入总份额	−	−
报告期间因拆分变动的份额	−	−
减:报告期间赎回/卖出总份额	−	−
报告期末持有的基金份额	4,979,976.35	4,979,976.35
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%	0.16%

注:基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信诚人寿保险有限公司	−	−	65,370,101.68	2.04%

注:1、除上表所示外,本基金除基金管理人之外其它关联方在本年末与上年末均未持有本基金。

2、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

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1月1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
中国农业银行	236,530,906.90	2,576,058.21	321,996,272.70	3,254,359.63

注:本基金通过“中国农业银行基金托管结算资金转用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于本报告期末的相关余额为人民币5,379,082.26元。(上年度末余额:2,860,619.84元)。

7.4.7.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度可比期间,在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

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

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/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

于本报告期末,本基金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

于本报告期末,本基金未持有因正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.9有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§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	1,742,527,421.51	83.65
	其中:股票	1,742,527,421.51	83.65
2	固定收益投资	−	−
	其中:债券	−	−
	资产支持证券	−	−
3	贵金属投资	−	−
4	金融衍生品投资	−	−
5	买入返售金融资产	97,290,336.65	4.67
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	−	−
6	银行存款和结算备付金合计	241,909,989.16	11.61
7	其他各项资产	1,496,470.59	0.07
8	合计	2,083,224,217.91	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	−	−
C	制造业	1,043,900,554.56	50.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	−	−
E	建筑业	70,218,208.80	3.42
F	批发和零售业	22,794,208.08	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	37,664,603.82	1.83
H	住宿和餐饮业	−	−
I	信息传输、软件和信息技术服务业	333,416,182.74	16.23
J	金融业	−	−
K	房地产业	−	−
L	租赁和商务服务业	10,874,492.50	0.53
M	科学研究和技术服务业	−	−
N	水利、环境和公共设施管理业	148,860,682.73	7.25
O	居民服务、修理和其他服务业	−	−
P	教育	−	−
Q	卫生和社会工作	52,469,540.98	2.55
R	文化、体育和娱乐业	22,328,947.30	1.09
S	综合	−	−
	合计	1,742,527,421.51	84.84

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	300070	碧水源	2,569,667	105,330,650.33	5.13
2	600406	国电南瑞	6,800,000	101,116,000.00	4.92
3	002415	海康威视	4,310,000	99,043,800.00	4.82
4	000915	山大华特	3,042,841	93,445,647.11	4.55
5	600332	白云山	3,301,934	91,331,494.44	4.45
6	000581	威孚高科	2,640,506	81,327,584.80	3.96
7	000661	长春高新	708,283	76,990,362.10	3.75
8	002385	大北农	4,339,604	70,952,525.40	3.45
9	600535	天士力	1,649,726	70,756,748.14	3.45
10	002375	亚厦股份	2,721,636	70,218,208.80	3.42

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	600383	金地集团	198,432,943.12	8.69
2	000915	山大华特	183,262,836.25	8.03
3	600048	保利地产	174,100,561.80	7.63
4	600406	国电南瑞	167,537,314.64	7.34
5	601166	兴业银行	129,948,490.42	5.69
6	300070	碧水源	129,893,619.97	5.69
7	600332	白云山	126,162,652.47	5.53
8	300183	东软载波	123,089,374.08	5.39
9	300124	汇川技术	117,371,148.23	5.14
10	000538	云南白药	115,671,347.50	5.07
11	000002	万 科A	115,478,617.07	5.06
12	600887	伊利股份	114,815,627.15	5.03
13	600596	新安股份	113,033,652.52	4.95
14	601318	中国平安	113,023,174.19	4.95
15	600276	恒瑞医药	109,222,306.50	4.79
16	000625	长安汽车	106,019,104.82	4.65
17	600588	用友软件	104,440,262.24	4.58
18	600315	上海家化	99,046,696.44	4.34
19	601117	中国化学	97,429,126.80	4.27
20	000661	长春高新	96,850,617.51	4.24
21	600718	东软集团	96,566,715.55	4.23
22	600518	康美药业	88,526,537.52	3.88
23	002415	海康威视	85,784,112.35	3.76
24	002230	科大讯飞	84,107,352.01	3.69
25	600030	中信证券	81,813,348.62	3.58
26	000024	招商地产	81,079,873.21	3.55
27	002385	大北农	80,895,000.01	3.54
28	600675	中华企业	78,716,292.28	3.45
29	000581	威孚高科	77,503,802.17	3.40
30	000400	许继电气	77,120,781.64	3.38
31	000895	双汇发展	76,515,137.09	3.35
32	600763	通策医疗	76,431,003.20	3.35
33	000100	TCL 集团	75,647,233.78	3.31
34	300074	华平股份	72,654,904.53	3.18
35	300088	长信科技	72,126,966.59	3.16
36	601928	凤凰传媒	69,256,946.73	3.03
37	000919	金陵药业	67,826,559.56	2.97
38	600720	祁连山	67,775,447.85	2.97
39	600557	康缘药业	67,574,426.70	2.96
40	600000	浦发银行	67,514,451.11	2.96
41	600585	海螺水泥	67,494,399.65	2.96
42	600535	天士力	67,052,803.25	2.94
43	600519	贵州茅台	67,024,539.03	2.94
44	600261	阳光照明	66,784,699.74	2.93
45	300026	红日药业	66,686,254.35	2.92
46	300105	龙源技术	65,819,038.84	2.88
47	002223	鱼跃医疗	65,041,463.57	2.85
48	002325	洪涛股份	64,302,041.24	2.82
49	601377	兴业证券	58,732,303.19	2.57
50	002063	远光软件	57,313,434.68	2.51
51	002375	亚厦股份	54,022,366.39	2.37
52	000999	华润三九	53,895,213.87	2.36
53	600563	法拉电子	53,709,322.08	2.35
54	600104	上汽集团	50,821,570.33	2.23
55	000630	铜陵有色	48,784,447.31	2.14
56	600067	冠城大通	48,129,510.61	2.11
57	300015	爱尔眼科	47,775,066.32	2.09
58	002140	东华科技	46,747,625.93	2.05

注:买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出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 | 本期累计卖出金额 | 占期初基