上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年八月二十五日

§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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华夏能源ETF
场内简称	能源行业
基金主代码	510610
交易代码	510610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年3月28日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	157,086,925份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年5月8日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等原因导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法(如买入非成份股等)进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证能源行业指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-24,328,863.38
本期利润	-14,352,190.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0867
本期基金份额净值增长率	-10.33%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3528
期末基金资产净值	110,143,466.35
期末基金份额净值	0.7012

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。

3.2 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
过去一个月	1.04%	0.69%	0.27%	0.68%	0.77%	0.01%
过去三个月	0.91%	1.08%	0.15%	1.09%	0.76%	-0.01%
过去六个月	-10.33%	1.22%	-10.95%	1.25%	0.62%	-0.03%
过去一年	-10.90%	1.32%	-15.46%	1.37%	4.56%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-29.88%	1.32%	-37.93%	1.41%	8.05%	-0.09%

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

上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年3月28日至2014年6月30日)

注:根据上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条(三)投资范围、(八)投资限制的有关约定。

§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

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批ODII基金管理人、境内首只ETF基金管理人,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在ETF基金管方面积累了丰富的经验,目前旗下管理9只ETF产品,分别为华夏沪深300ETF、华夏上证50ETF、华夏中小板ETF、华夏能源ETF、华夏材料ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF和华夏恒生ETF,初步形成了覆盖综合指数、权重股指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的ETF产品线。

2014年上半年,在《中国证券报》主办的"第十一届中国基金业金牛奖"评选中,华夏基金荣获年度"金牛基金管理公司奖",所管理的基金荣获6个单项奖;在《上海证券报》主办的"第十一届中国金基金奖"评选中,华夏基金荣获"金基金·TOP公司大奖",所管理的基金荣获5个单项奖,为获奖最多的基金公司;在《证券时报》主办的"2013年度中国基金业明星基金奖"评选中,华夏基金荣获"五年持续回报明星基金公司奖"和"2013年度十大明星基金公司奖",所管理的基金荣获3个单项奖。

在客户服务方面,上半年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:(1)华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务,方便投资者进行现金管理;(2)华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见,且可见即可用,提高投资者的交易效率;(3)在华夏基金微信公众服务平台增加扫码绑定功能,投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询,提高投资者使用的便利性。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2013-03-28	-	14年	硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理等。

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《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金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5%的情况。

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

本基金跟踪的标的指数为上证能源行业指数,是上证行业指数系列的组成部分。上证行业指数选择上海证券市场各行业中规模大、流动性好的股票组成样本股,自2009年1月9日起正式发布,以反映上海证券市场不同行业公司股票的整体表现。本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

2014年上半年,国际方面,美联储继续稳步削减量化宽松规模;欧央行宣布降息,实施货币宽松。国内方面,宏观经济依然较弱,房地产投资和销量下滑较快,超日债违约事件等也加剧了投资者对经济运行环境的担忧,在此背景下,政府推出定向调控政策,央行两次定向降准,市场资金面相对宽松。

市场方面,报告期内A股整体呈窄幅震荡下跌走势,上证能源行业指数本报告期下跌10.95%,表现低于市场平均水平。从成份股报告期表现分析,对指数正贡献最大的是中国石化,对指数负贡献最大的是广汇能源。

报告期内,本基金严格按照基金合同要求,在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对成份股的定期调整,努力降低成本、减少市场冲击。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行,经上海证券交易所同意,部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前,本基金的流动性服务商包括中国银河证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为0.7012元,本报告期份额净值增长率为-10.33%,同期上证能源行业指数增长率为-10.95%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.62%,与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、成份股调整、日常运作费用、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济运行仍将面临诸多挑战,房地产下行风险短期难消,库存调整压力依然较大,预计稳增长政策会陆续出台,资金面仍将保持相对宽松,经济或将出现短期企稳。此外,国企改革的深入及沪港通政策的落地也会给市场带来积极效应。受上述因素影响,A股市场或将出现阶段性投资机会。上证能源行业指数作为周期性指数,受宏观经济影响较大,在经济或政策超预期时或有强于大盘的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时,我们也将积极争取推动产品的进一步创新,充分发挥ETF的功能,为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的经营理念,规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中,近三分之二的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定,本基金收益分配应遵循下列原则:本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到1%以上时,可进行收益分配。基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下,本基金收益每年最多分配2次,每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。法律法规、监管机构、登记结算机构、上海证券交易所另有规定的从其规定。

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		1,769,780.10	4,583,445.30
结算备付金		71,332.30	34,833.84
存出保证金		2,868.67	5,444.60
交易性金融资产		108,515,434.31	138,985,998.23
其中:股票投资		108,515,434.31	138,985,998.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	222,372.50
应收利息		330.68	966.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		110,359,746.06	143,833,061.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		5,948.24	16,131.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		44,823.57	68,810.99
应付托管费		8,964.70	13,762.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		48,662.65	46,872.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		107,880.55	121,200.65
负债合计		216,279.71	266,777.19
所有者权益:			
实收基金		157,086,925.00	183,586,925.00
未分配利润		-46,943,458.65	-40,020,640.87
所有者权益合计		110,143,466.35	143,566,284.13
负债和所有者权益总计		110,359,746.06	143,833,061.32

注:①报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.7012元,基金份额总额157,086,925份。

②本基金合同于2013年3月28日生效,上年度可比期间自2013年3月28日至2013年6月30日。

6.2 利润表

会计主体:上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月28日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入		-13,881,475.05	-65,749,841.06
1.利息收入		8,847.11	263,378.46
其中:存款利息收入		8,847.11	263,378.46
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-23,848,963.49	-25,888,381.51
其中:股票投资收益		-24,855,268.96	-29,002,112.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	21,060.00
股利收益		1,006,305.47	3,092,671.37
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		9,976,672.78	-40,172,028.03
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-18,031.45	47,190.02
减:二、费用		470,715.55	805,333.14
1.管理人报酬		292,000.11	511,420.11
2.托管费		58,400.00	102,284.05
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		9,232.93	95,141.66
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		111,082.51	96,487.32
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-14,352,190.60	-66,555,174.20
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-14,352,190.60	-66,555,174.20

注:本基金合同于2013年3月28日生效,上年度可比期间自2013年3月28日至2013年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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)	183,586,925.00	-40,020,640.87	143,566,284.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,352,190.60	-14,352,190.60
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)	-26,500,000.00	7,429,372.82	-19,070,627.18
其中:1.基金申购款	825,000,000.00	-239,576,748.02	585,423,251.98
2.基金赎回款	-851,500,000.00	247,006,120.84	-604,493,879.16
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)	157,086,925.00	-46,943,458.65	110,143,466.35
项目	上年度可比期间 2013年3月28日(基金合同生效日)至2013年6月30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)	548,586,925.00	-	548,586,925.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-66,555,174.20	-66,555,174.20
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)	-298,000,000.00	13,185,858.05	-284,814,141.95
其中:1.基金申购款	211,000,000.00	-17,839,315.25	193,160,684.75
2.基金赎回款	-509,000,000.00	31,025,173.30	-477,974,826.70
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)	250,586,925.00	-53,369,316.15	197,217,608.85

注:本基金合同于2013年3月28日生效,上年度可比期间自2013年3月28日至2013年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

杨明辉　　崔雁巍　　崔雁巍
基金管理人负责人　主管会计工作负责人　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东、一级交易商

注:①根据华夏基金管理有限公司于2014年2月12日发布的公告,华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券(出资比例62.2%)、山东省农村经济开发投资公司(比例10%)、POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例10%)、青岛海鹏科技投资有限公司(出资比例10%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例7.8%)。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月28日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	292,000.11	511,420.11

注:①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月28日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,400.00	102,284.05

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 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 2014年6月30日		上年度末 2013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
中信证券	10,000,000.00	6.37%	10,000,000.00	3.99%

注:中信证券持有本基金份额变动的交易通过交易所系统进行,相关规定由上交所、登记结算机构等制定。

6.4.4.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月28日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	1,769,780.10	8,542.94	1,820,074.21	242,745.97

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层级:

第一层级:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级:对估值日活跃市场无报价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.6.2各层级金融工具公允价值

截至2014年6月30日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为108,515,434.31元,第二层级的余额为0元,第三层级的余额为0元。(截止2013年12月31日至:第一层级的余额为138,985,998.23元,第二层及的余额为0元,第三层级的余额为0元。)

6.4.6.3公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

6.4.6.4第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 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	108,515,434.31	98.33
	其中:股票	108,515,434.31	98.33
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	-	-
	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	1,841,112.40	1.67
7	其他各项资产	3,199.35	0.00
8	合计	110,359,746.06	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 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	96,705,680.97	87.80
C	制造业	8,908,400.62	8.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	685,965.00	0.62
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,215,387.72	2.01
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	108,515,434.31	98.52

7.3 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	601088	中国神华	1,124,651	16,352,425.54	14.85
2	600028	中国石化	2,688,035	14,165,944.45	12.86
3	601857	中国石油	1,848,171	13,935,209.34	12.65
4	600256	广汇能源	1,484,415	10,420,593.30	9.46
5	600583	海油工程	846,064	6,235,491.68	5.66
6	601808	中海油服	278,752	4,903,247.68	4.45
7	601898	中煤能源	875,539	3,528,422.17	3.20
8	600688	上海石化	1,045,100	3,438,379.00	3.12
9	601699	潞安环能	438,921	3,331,410.39	3.02
10	600348	阳泉煤业	575,141	3,243,795.24	2.95

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600688	上海石化	2,855,319.36	1.99
2	601857	中国石油	1,438,248.80	1.00
3	601088	中国神华	1,235,430.00	0.86
4	601225	陕西煤业	966,556.00	0.67
5	600207	安彩高科	702,672.99	0.49
6	600740	山西焦化	569,907.00	0.40
7	601001	大同煤业	553,052.00	0.39
8	600028	中国石化	493,925.01	0.34
9	600348	阳泉煤业	441,862.00	0.31
10	600256	广汇能源	392,618.25	0.27
11	600403	大有能源	322,225.96	0.22
12	601798	蓝科高新	267,008.60	0.19
13	600397	安源煤业	208,495.42	0.15
14	601011	宝泰隆	127,787.00	0.09
15	601699	潞安环能	104,850.46	0.07
16	600188	兖州煤业	101,917.00	0.07
17	600583	海油工程	81,899.00	0.06
18	601898	中煤能源	45,771.00	0.03
19	600971	恒源煤电	40,927.00	0.03
20	600792	云煤能源	34,527.00	0.02

注:"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	831,077.67	0.58
2	600121	郑州煤电	739,616.53	0.52
3	600583	海油工程	622,021.00	0.43
4	600792	云煤能源	436,132.00	0.30
5	601918	国投新集	360,212.00	0.25
6	600256	广汇能源	257,724.00	0.18
7	601808	中海油服	230,473.29	0.16
8	600157	永泰能源	228,497.00	0.16
9	600348	阳泉煤业	178,629.74	0.12
10	601898	中煤能源	144,029.00	0.10
11	600028	中国石化	138,963.00	0.10
12	601666	平煤股份	115,807.00	0.08
13	600688	上海石化	108,718.00	0.08
14	600123	兰花科创	88,110.00	0.06
15	600387	海越股份	87,117.00	0.06
16	600333	长春燃气	69,666.00	0.05
17	600188	兖州煤业	51,504.00	0.04
18	600997	开滦股份	48,573.00	0.03
19	600395	盘江股份	46,019.00	0.03
20	600403	大有能源	43,246.53	0.03

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	11,212,832.80
卖出股票收入(成交)总额	5,050,290.76

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费