科瑞证券投资基金

2014 半年度报告摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:二〇一四年八月二十七日

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。

基金托管人交通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。

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。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达科瑞封闭
基金主代码	500056
交易代码	500056
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002年3月12日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	2002年3月12日至2017年3月11日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2002年3月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于价值被市场绝对或相对低估的股票。本基金的投资目标是在控制股票投资组合的风险的前提下,追求基金资产的长期稳定的增值。
投资策略	基金管理人在对宏观经济和市场发展趋势进行深入分析的基础上,进行资产在股票、债券和现金间的资产配置。当判断股票市场趋势向好时,基金管理人采取积极进取的投资方式,加大股票投资比例,降低债券投资、现金的比例,力求取得较好的资本增值收益;当预测股票市场走势趋淡时,则降低股票投资比例,加大债券投资和现金比例,避免股票市场大幅下挫时引起的资产损失。基金管理人主要选择公司价值被市场相对和绝对低估的股票构建投资组合。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	王涛
	联系电话	020-38797888	95559
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38799488	021-62701216

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	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

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	-20,160,608.58
本期利润	-95,289,196.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0318
本期基金份额净值增长率	-2.89%
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	-0.0605
期末基金资产净值	3,196,652,800.41
期末基金份额净值	1.0656

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人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。

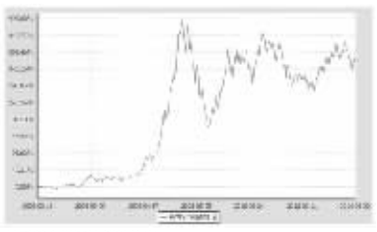
3.2 基金净值表现

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	3.86%	1.80%	-	-	-	-
过去三个月	0.85%	2.15%	-	-	-	-
过去六个月	-2.89%	2.05%	-	-	-	-
过去一年	6.36%	2.17%	-	-	-	-
过去三年	-2.36%	2.20%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	380.64%	2.74%	-	-	-	-

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

科瑞证券投资基金
份额累计净值增长率历史走势图
(2002年3月12日至2014年6月30日)



注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:

1) 本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%;

2) 本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%;

3) 本基金投资于单个上市公司股票的比例不高于基金资产净值的10%;

4) 本管理人所管理的全部基金持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%;

5) 本基金投资不超过中国证监会规定的其他比例限制;

6) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定时从其规定。

因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。

2. 本基金基金合同未规定业绩比较基准。

3. 自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为380.64%。

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

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,易方达基金管理有限公司成立于2001年4月17日,注册资本1.2亿元,旗下设有北京、广州、上海分公司和香港子公司、资产管理子公司。易方达秉承“取信于市场,取信于社会”的宗旨,坚持“在诚信规范的前提下,通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念,以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩,赢得市场认可。2004年10月,易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月,易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月,易方达获得合格境内机构投资者(QDII)资格。2008年2月,易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2014年6月30日, 易方达旗下共管理57只开放式基金、1只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务,资产管理总规模近2400亿元。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
郑希	本基金的基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金的基金经理	2012-09-28	-	8年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理。

注:1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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%的交易共有5次,为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2014年上半年A股市场整体呈现震荡格局,各类指数有一定幅度分化,尤其体现在新兴成长与传统成长之间的分化。上半年沪深300指数下跌7.08%,上证指数下跌3.2%,中小盘指数下跌3.72%,但同时创业板指数上涨7.69%,而创业板综指上涨15.31%。

上半年以来的大小盘风格分化进一步演化,创业板指数显著跑赢中小盘指数和沪深300指数。

分析原因:

(1)从宏观经济层面看,宏观经济较弱,人民币汇率出现波动,整体人民币计价的大类资产吸引力不大;

(2)从政策层面看,新政府反腐力度明显加大,对国产化的需求也明显上升,但改革过程将是一个艰难的系统工程,传统行业所面临的盈利不确定性加大。

(3)从微观行业以及企业层面看,传统蓝筹成长类行业盈利增速有一定程度放缓,例如传媒、电子、安防、消费品、医药等行业业绩均出现不同程度低于预期。新兴行业中互联网、软件信息化、新能源汽车等行业趋势向好。

(4)创业板综指与创业板指数之间出现明显分化,小权重小市值创业板出现系统性机会,大幅超越权重成长股。

本基金在上半年基本保持较高仓位,进一步调整了成长股的配置结构,增加了医疗服务、互联网、智慧城市等新兴产业的投资品种占比,降低了电子、安防等行业占比,由于之前传统成长类资产配置比例较重,导致净值受到一定损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0656元,本报告期份额净值增长率为-2.89%。

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2014年下半年,宏观经济预计依然偏弱,同时考虑到资金成本正处于明显下降通道之中,同时股票类资产整体估值水平较低,预期市场较为活跃,存在结构性机会。市场热点依然存在于与经济改革相关的主题性机会以及新兴成长的中期机会。

基于以上判断,本基金将保持仓位,立足中长期盈利成长性和稳定性的原则构建。维持以竞争优势明显、估值合理的蓝筹成长公司为核心持仓结构,保持组合的流动性和稳定性,并在中小市值股票中寻找能超越周期的个股。由于整体成长股更新换代趋势明显,本基金将加大对新兴成长股的配置比例。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有估值委员会,公司营运总监担任估值委员会主席,研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

2014年上半年度,托管人在科瑞证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2014年上半年度,易方达基金管理有限公司在科瑞证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2014年上半年度,由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关科瑞证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

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:科瑞证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	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	74,986,759.78	29,323,362.26
结算备付金	3,525,710.48	4,304,735.21
存出保证金	652,132.21	553,642.62
交易性金融资产	2,937,060,408.93	3,094,463,505.41
其中:股票投资	2,289,219,659.53	2,422,322,211.60
基金投资	-	-
债券投资	647,840,749.40	672,141,293.81
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	158,400,428.60	133,093,556.49
应收证券清算款	17,038,185.60	30,190,449.11
应收利息	17,875,724.87	11,562,467.84
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,209,539,350.47	3,303,491,718.94

负债和所有者权益	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	4,411,800.32	2,522,070.56
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,837,050.94	4,103,673.66
应付托管费	639,508.50	683,945.63
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,207,184.98	2,272,093.47
应交税费	1,307,938.86	1,307,938.86
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	483,066.46	660,000.00
负债合计	12,886,550.06	11,549,722.18
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	196,652,800.41	291,941,996.76
所有者权益合计	3,196,652,800.41	3,291,941,996.76
负债和所有者权益总计	3,209,539,350.47	3,303,491,718.94

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0656元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体:科瑞证券投资基金

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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-58,039,542.00	265,923,401.98
1.利息收入	16,390,094.05	10,775,095.90
其中:存款利息收入	437,717.61	490,532.93
债券利息收入	14,761,266.28	9,762,903.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,191,110.16	521,659.11
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	698,951.72	126,355,605.33
其中:股票投资收益	-15,357,533.42	113,566,959.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,244,943.42	241,902.98
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,811,541.72	12,546,743.15
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-75,128,587.77	128,787,184.88
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	5,515.87
减:二、费用	37,249,654.35	33,567,572.53
1.管理人报酬	24,004,062.65	22,153,007.40
2.托管费	4,000,677.01	3,692,167.86
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	8,981,914.84	7,469,648.28
5.利息支出	-	1,125.00
其中:卖出回购金融资产支出	-	1,125.00
6.其他费用	262,999.85	251,623.99
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-95,289,196.35	232,355,829.45
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-95,289,196.35	232,355,829.45

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:科瑞证券投资基金

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)	3,000,000,000.00	291,941,996.76	3,291,941,996.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-95,289,196.35	-95,289,196.35
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	3,000,000,000.00	196,652,800.41	3,196,652,800.41
	上年度可比期间 2013年1月1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)	3,000,000,000.00	-226,658,366.28	2,773,341,633.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	232,355,829.45	232,355,829.45
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	3,000,000,000.00	5,697,463.17	3,005,697,463.17

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:

基金管理人负责人:叶俊英,主管会计工作负责人:张优造,会计机构负责人:陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

科瑞证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监基金字[2001]59号文件“关于同意科瑞证券投资基金设立的批复”批准,由广东粤财信托有限公司及易方达基金管理有限公司二家发起人共同发起并向社会募集设立。本基金共募集基金份额30亿份,2002年3月12日基金合同生效,2002年3月20日正式在上海证券交易所上市。本基金管理人为易方达基金管理有限公司, 基金托管人为交通银行。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,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;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定, 自2005年6月13日起, 对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得, 按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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
易方达基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位: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1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	216,917,642.64	3.69%	210,155,149.25	4.33%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	197,479.80	3.69%	30,173.93	1.38%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	191,326.30	4.35%	4,944.82	0.24%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,004,062.65	22,153,007.40
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 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1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,000,677.01	3,692,167.86

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	20,228,928.88	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2014年1月1日至2014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
期初持有的基金份额	219,110,562.00	219,110,562.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	219,110,562.00	219,110,562.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.30%	7.30%

注:基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.4.2 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
粤财信托	7,500,000.00	0.25%	7,500,000.00	0.25%

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.5 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1月1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
交通银行	74,986,759.78	394,825.32	132,000,647.21	451,492.00

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	600089	特变电工	配股发行	726,198	5,010,766.20
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明无。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000977	浪潮信息	2014-03-12	2015-03-13	非公开发行流通受限	40.11	24.64	900,000	18,049,500.00	22,176,000.00	-
002245	澳洋顺昌	2014-04-03	2015-04-08	非公开发行流通受限	7.50	7.93	1,070,000	8,025,000.00	8,485,100.00	-
300058	蓝色光标	2013-09-16	2014-09-18	非公开发行流通受限	42.00	25.25	400,000	8,400,000.00	10,100,000.00	-
300315	掌趣科技	2014-06-30	2015-07-02	非公开发行流通受限	13.51	13.53	590,000	7,970,900.00	7,982,700.00	-
300387	富邦股份	2014-06-26	2014-07-02	新股流通受限	20.48	20.48	13,132	268,943.36	268,943.36	-

注:1.以上“可流通日”中,部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

2.北京蓝色光标品牌管理顾问股份有限公司于2014年5月30日(流通受限期内),向全体股东每10股派2.00元人民币现金(含税),同时按每10股转增10股进行资本公积金转增股本。

3.江苏澳洋顺昌股份有限公司于2014年3月5日(流通受限期内),向全体股东每10股派0.80元人民币现金(含税)。

4.浪潮电子信息产业股份有限公司于2014年5月13日(流通受限期内),向全体股东每10股派0.80元人民币现金(含税),同时按每10股转增10股进行资本公积金转增股本。

5.北京掌趣科技股份有限公司于2014年5月23日(流通受限期内),向全体股东每10股派0.56元人民币现金(含税),同时按每10股转增6股进行资本公积金转增股本。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000925	众合机电	2014-03-27	重大事项	13.40	2014-08-22	14.74	250,000	2,714,305.16	3,350,000.00	-
002019	鑫富药业	2014-06-25	重大事项	23.76	2014-07-04	26.14	362,200	8,309,874.59	8,605,872.00	-
002466	天齐锂业	2014-04-29	重大事项	43.16	2014-08-25	47.48	219,901	10,982,569.54	9,490,927.16	-
002551	尚荣医疗	2014-06-12	重大事项	34.01	-	-	977,378	36,737,102.80	33,240,625.78	-
300199	翰宇药业	2014-02-20	重大事项	24.40	2014-08-20	29.00	3,800,174	64,963,765.81	92,724,245.60	-
300253	卫宁软件	2014-05-28	重大事项	43.92	2014-08-01	37.50	2,223,643	41,144,351.95	97,662,400.56	-
300271	华宇软件	2014-06-27	重大事项	40.30	-	-	182,450	6,231,788.56	7,352,735.00	-
300295	三六五网	2014-04-11	重大事项	100.10	2014-07-08	105.00	119,960	12,846,193.00	12,007,996.00	-
600418	江淮汽车	2014-04-14	重大事项	10.24	2014-07-11	11.22	1,567,155	15,936,845.21	16,047,667.20	-
600685	广船国际	2014-04-08	重大事项	17.13	-	-	224,979	3,964,991.56	3,853,890.27	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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为0,无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.10 有助于