益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:益民基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
送出日期:2014年8月27日

§1 重要提示

1.1 重要提示

本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。

本基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月22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。

本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	益民服务领先混合
基金主代码	000410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月13日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	246,458,079.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在中国经济转型发展和产业升级加快的大背景下,积极把握服务业加速成长、逐渐转型成为经济发展主要动力的机会,在分享企业成长性的同时合理控制组合风险,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金管理人通过益民经济周期模型与分析师的审慎研究相结合的方式,密切跟踪全球和中国宏观经济因素变化的情况,从经济增长、国家政策、市场资金面、海外市场环境等多个方面进行深入研究,判断证券市场总体变动趋势。结合对证券市场各资产类别中长期运行趋势、风险收益特征的分析比较,确定基金大类资产配置比例和变动原则。本基金所指的服务业从服务对象上可以分为生产性服务业和生活性服务业。本基金将从这两大方面出发明确界定属于服务业的相关行业,严格遵照投资范围进行投资。同时,本基金还将密切跟踪国家政策和产业升级变化情况,研究随国民经济发展和科学技术进步带来的领导经济、产业转型升级的服务业所涵盖的行业范围的拓展和变化,适时调整投资范围,确保本基金对服务类行业和上市公司的投资比例符合服务业的界定。
业绩比较基准	65%×沪深300指数收益率+35%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金,但高于债券型基金和货币市场基金

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		益民基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘伟	张建春
	联系电话	010-63105556	010-63639180
	电子邮箱	jcb@ymfund.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-650-8808	95595
传真		010-63100588	010-63639132

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.ymfund.com
基金半年度报告备置地点	北京市西城区宣外大街10号庄胜广场中央办公楼南翼13A

§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 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-25,466,780.04
本期利润	-21,315,241.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0572
本期基金份额净值增长率	-7.49%
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	-0.0943
期末基金资产净值	228,473,065.23
期末基金份额净值	0.927

注: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。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。

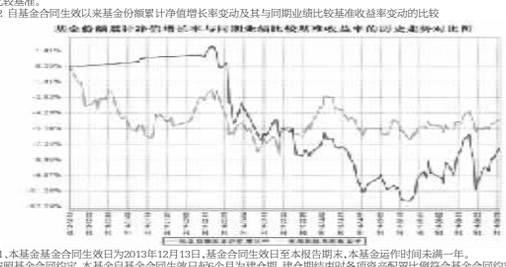
3.2 基金净值表现

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	2.66%	1.21%	0.55%	0.50%	2.11%	0.71%
过去三个月	0.87%	0.89%	1.65%	0.57%	-0.78%	0.32%
过去六个月	-7.49%	0.82%	-2.65%	0.67%	-4.84%	0.15%
自基金合同生效起至今	-7.30%	0.78%	-4.76%	0.68%	-2.54%	0.10%

注:本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则,本基金选取"60%×沪深300指数收益率+40%×中证全债指数收益率"作为本基金的比较基准。

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:1.本基金合同生效日为2013年12月13日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

2.按照基金合同约定,本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准,于2005年12月12日正式成立。公司股东由重庆国际信托有限公司(出资比例49%)、中国新纪元有限公司(出资比例31%)、中山证券有限责任公司(出资比例20%)组成,注册资本为1亿元人民币,注册地:重庆,主要办公地点:北京。截止2014年6月末,公司管理的基金共有六只,均为开放式基金。其中,益民货币市场基金于2006年7月17日成立;益民红利成长混合型证券投资基金于2006年11月21日成立;益民创新优势混合型证券投资基金于2007年7月11日成立;益民多利债券型投资基金于2008年5月21日成立;益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金于2012年8月16日成立;益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金于2013年12月13日成立。

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		
侯燕琳	投资总监、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年1月4日	-	14	曾任泰信基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理;泰信双息双利债券型基金、泰信发展主题股票型基金基金经理。自2012年8月加入益民基金管理有限公司,担任投资管理部总经理。自2013年1月4日起任益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2013年9月任投资总监,自2013年12月13日起任益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
黄祥斌	益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年12月13日	-	9	武汉大学产业经济学硕士。曾就职于美尔集服饰有限责任公司、中国未庆龄基金会、岳达证券。2012年10月加入益民基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理。自2013年12月13日起任益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:此处的"任职日期"为基金合同生效日或根据公司决定确定的聘任日期,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券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,益民基金管理有限公司作为益民服务领先混合型证券投资基金的管理人,严格按照《基金法》、《证券法》、《益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少积分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者的合法权益,避免出现不公平交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了《益民基金管理有限公司公平交易管理制度》、《益民基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,并建立了有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司严格遵守公平交易管理制度的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合。对于交易所公开竞价交易,公司均执行交易系统中的公平交易程序,即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令;因特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令,需履行事后批准程;对不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象,各投资组合经理需要在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和交易数量,公司在获配额度确定启投职价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;公司根据市场公认的第三方信息,对投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,相关投资组合经理应对交易价格异常情况进行合理性解释。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,不存在直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

本报告期内,各投资组合1日、3日、5日同向交易价差大部分通过统计检验,不存在价差显著的情况。但因投资组合规模悬殊、投资组合经理对市场判断的差异及决策时机不同,导致投资组合间七笔配对分析出现1日、3日、5日同向交易价差检验显著的情况。

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

2014年上半年市场环境较为复杂,上证指数呈现超窄幅的震荡格局,半年下跌3.2%,中小板指数下跌3.72%,创业板指数上涨7.69%。中国经济进入了一个增速的拐点,这是由经济发展规律所造成的,而以房地产发展为代表的高速发展的经济环境将以一种结构调整的形式被发展第三产业所替代。

与发达国家相比,由于我们所处的时代不同,加上信息化程度的高速发展,我们的很多变革都会比发达国家当年来得更加迅速,曲线更加陡峭,而可以肯定的是,在这个时代,加上信息化程度的高速发展,我们的很多变革都会比发达国家当年来得更加迅速,曲线更加陡峭,而且目前又有很多自身特殊的问题,比如说债务问题、资金利率问题、超发货币问题、私人部门需求疲弱的问题等等,而近期政府对GDP既线里维的加强和定向刺激的不断加码,使得经济数据有企稳回升的迹象,但要转化为内生性的增长的确有待观察。

从市场的反应看,护指在箱体下沿似乎是有一定的支撑,但每次反弹的高度又受到参与资金量的限制,而且每次以主题的形式发起,然后迅速回调,板块轮动非常频繁。另外,新股IPO也是影响市场的一个重要因素,如果说去年的市场是结构调整,成长股的牛市,其中一个很关键的因素是没有IPO,而今年IPO停停走走,最后为了保护市场把今数定为100家左右,这才使市场有所稳定,又使新股有了一定的稀缺性,出现了新股爆涨的局面。

本基金在1季度对市场的反应有些迟钝,没有敏锐抓住市场箱体震荡的特征,建仓时点在箱体的上沿,加上新基金的大幅跌回,使得基金净值出现了亏损。

2季度基金调整了组合策略,深入挖掘主题投资机会,同时把公司业绩稳定持续增长作为选股的首选条件,取得了不错的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末,本基金份额净值为0.927元。本报告期份额净值增长率为-7.49%,同期业绩比较基准收益率为-2.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在整体经济没有找到新的增长点之前,市场基本就是在犹豫的过程中,微刺激短期会使经济数据有所提升,使很多矛盾和风险弱化,长期化。但经济的高杠杆、服务业的转型没有想象中那么一帆风顺,而在这其中能看到光明的是互联网带给中国经济、中国普通人的无限活力和想象空间。互联网、尤其是移动互联网催生出来的新兴经济使每个人的生活发生了巨大改变。例如,互联网金融使我们有了真正普惠金融的雏形,每个老百姓的小资金真正享受到了以前垄断行业才有的利息。

互联网和大数据的应用改变了人类生存环境和生活的各项内容,尤其对中国这样众多人口的国家,移动互联网对人们生活的各方面有着颠覆的作用。

医药生物等高科技和医疗服务的发展使人民的生存状态和生活品质有了很大改善,环境保护成为我们长期关注和改善的重点。

中长期国家政策鼓励的行业,业绩不断释放的行业和个股也是我们投资的重点,本基金合同重点关注服务业的发展,契合中国经济转型发展的大方向,在努力防范系统风险的前提下,深入挖掘投资的主题和个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述:

根据相关规定,本基金管理人成立估值委员会,估值委员会是基金估值的最高决策机构,负责公司估值相关决策及执行。成员由公司经理、投资总监、运作保障部、金融工程部、监察稽核部、基金会计等相关人员组成。相关委与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验,熟悉相关法规和估值方法。

研究部行业研究员:研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究,参与基金组合停牌股票行业属性和国估方法的确定,并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责;相关委与人员应当具有多年的行业研究经验,能够较好的对行业发展趋势做出判断,熟悉相关法规和估值方法。

监察稽核部:监察稽核部参与估值流程的人员,应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督,发现问题及时要求整改;参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验,应当具备熟知与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法的专业能力,并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

金融工程部金融工程人员:金融工程人员负责估值相关数值的处理和计算,并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验,具备基金绩效评估专业能力,并熟悉相关法规和估值方法。

运作保障部基金会计:基金会计在估值流程中的相关工作职责是负责日常核算,并参与基金组合停牌股票估值方法的确定,复核由估值委员会提供的估值价格,并与相关托管行进行核对确认,如有不符合的情况出现,立即向估值委员会反映情况,并提出合理的调整建议。基金会计人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通,获悉的与基金估值相关的重大信息及时向公司及估值小组反馈。基金会计应当具备多年基金从业经验,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,具备熟悉及了解基金估值法规、政策和方法的专业能力。

2.基金经理参与或决定估值的程度:

基金管理公司估值委员会成员中不包括基金经理。基金经理不参与估值工作决策和执行的过程。

3.本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额净收益(可供分配利润)的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2.本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4.每一基金份额享有同等分配权;

法律法规或监管机构另有规定的,基金管理人在履行适当程序后,将对上述基金收益分配政策进行调整。

4.8.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

4.8.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更事项。

4.8.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更事项。

4.8.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错更正事项。

4.8.6 税项

印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,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、国家税务总局研究决定,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[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。

营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,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[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;

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。

个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[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、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,证券投资基金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。

根据财政部、国家税务总局财税[2006]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》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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

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
益民基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司("光大银行")	基金托管人、基金代销机构
国泓资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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债券回购交易。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 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	2,680,764.45	-
其中:支付销售机构的客户维护费	434,783.64	-

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计算,计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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	446,794.05	-

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计算,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。经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

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

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金管理人本报告期及上年度可比期间均未持有本基金份额。

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
国泓资产管理有限公司	19,999,800.00	8.11%	19,999,800.00	1.84%

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
光大银行	12,678,337.31	268,457.13	-	-

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

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
300379	东方通	2014年6月23日	重大资产重组	62.17	2014年8月15日	67.39	53,800	3,549,603.50	3,344,746.00	-
300271	华宇软件	2014年6月27日	重大资产重组	40.30	-	-	31,600	1,183,118.00	1,273,480.00	-
300137	先河环保	2014年6月16日	重大资产重组	20.86	2014年8月15日	14.31	60,000	1,271,699.41	1,251,600.00	-
600832	东方明珠	2014年5月29日	重大资产重组	10.98	-	-	108,300	1,193,466.00	1,189,134.00	-
600485	中创信测	2014年6月25日	重大资产重组	18.21	2014年7月3日	20.03	38,900	715,760.00	708,369.00	-
600418	江淮汽车	2014年4月14日	重大资产重组	10.20	2014年7月11日	11.22	26,700	270,204.00	272,340.00	-

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

§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	199,544,787.22	85.69
	其中:股票	199,544,787.22	85.69
2	固定收益投资	13,048,100.00	5.60
	其中:债券	13,048,100.00	5.60
	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	19,804,363.36	8.50
7	其他各项资产	461,506.84	0.20
8	合计	232,858,757.42	100.00

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	1,675,832.40	0.73
B	采矿业	1,317,500.00	0.58
C	制造业	97,628,664.34	42.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,134,125.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	5,194,018.00	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,247,303.82	25.93
J	金融业	11,676,000.00	5.11
K	房地产业	4,710,281.73	2.06
L	租赁和商务服务业	2,654,000.00	1.16
M	科学研究和技术服务业	1,395,671.10	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	2,417,487.75	1.06
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	10,493,903.08	4.59
S	综合	-	-
	合计	199,544,787.22	87.34

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	300273	和佳股份	305,920	9,391,744.00	4.11
2	600037	歌华有线	873,196	9,186,021.92	4.02
3	600446	金证股份	262,850	8,080,009.00	3.54
4	600570	恒生电子	258,950	7,613,130.00	3.33
5	000748	长城信息	312,615	7,086,982.05	3.10
6	002104	恒宝股份	345,439	6,770,604.40	2.96
7	002236	大华股份	239,894	6,465,143.30	2.83
8	000001	平安银行	600,000	5,946,000.00	2.60
9	600030	中信证券	500,000	5,730,000.00	2.51
10	002008	大族激光	308,170	5,343,667.80	2.34

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	000002	万 科A	23,378,780.64	2.15
2	601998	中信银行	18,540,604.15	1.71
3	000001	平安银行	17,428,031.84	1.60
4	600446	金证股份	15,484,758.97	1.43
5	002390	信邦制药	12,827,427.32	1.18
6	000748	长城信息	12,161,789.15	1.12
7	002241	歌尔声学	10,795,514.71	0.99
8	002456	欧菲光	10,655,865.06	0.98
9	300273	和佳股份	10,522,322.24	0.97
10	600570	恒生电子	10,110,404.56	0.93
11	600835	上海机电	9,726,203.33	0.90
12	600000	浦发银行	9,465,147.00	0.87
13	600037	歌华有线	9,200,156.82	0.85
14	300017	网宿科技	9,175,706.90	0.84
15	600585	海螺水泥	9,149,689.64	0.84
16	600708	海博股份	9,046,115.59	0.83
17	300058	蓝色光标	9,045,353.47	0.83
18	600845	宝信软件	8,824,135.44	0.81
19	300124	汇川技术	8,703,833.08	0.80
20	600718	东软集团	8,468,750.72	0.78

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	000002	万 科A	20,677,449.94	1.90
2	601998	中信银行	18,128,286.12	1.67
3	002390	信邦制药	12,638,596.28	1.16
4	000001	平安银行	11,738,236.21	1.08
5	002241	歌尔声学	10,162,876.47	0.94
6	600000	浦发银行	9,381,814.00	0.86
7	600845	宝信软件	9,189,653.97	0.85
8	600446	金证股份	9,181,354.37	0.85
9	600585	海螺水泥	9,126,945.54	0.84
10	600835	上海机电	8,580,676.76	0.79
11	600708	海博股份	8,505,491.33	0.78
12	600718	东软集团	7,763,067.33	0.71
13	300017	网宿科技	7,402,390.59	0.68
14	002368	大银股份	7,359,165.07	0.68
15	600683	京投银泰	6,861,805.79	0.63
16	600109	国金证券	6,820,592.16	0.63
17	002207	准油股份	6,799,595.38	0.63
18	000671	阳 光 城	6,795,964.16	0.63
19	002456	欧菲光	6,450,425.15	0.59
20	002594	比亚迪	6,227,425.89	0.57

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	836,267,144.29
卖出股票收入(成交)总额	611,991,749.41

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,048,100.00	5.71
	其中:政策性金融债	13,048,100.00	5.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	13,048,100.00	5.71

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发29	130,000	13,048,100.00	5.71

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期未未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期未未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	315,518.04
2	应收证券清算款	-
2	应收股利	-
4	应收利息	145,988.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	461,506.84

7.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: