银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年8月27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25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

基金名称	银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金
基金简称	银华成长股债30/70指数
基金主代码	000062
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月22日
基金管理人	银华基金管理有限公司
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	56,782,043.49份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争对中证银华成长股债恒定组合30/70指数进行有效跟踪,并力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金原则上采用完全复制法,按照成份证券在标的指数中的组成及其基准权重构建投资组合,以拟合、跟踪标的指数的收益表现,并根据标的指数成份证券及其权重的变动而进行相应调整。 基金的投资组合比例为:本基金投资于中证银华成长股债恒定组合30/70指数成份证券及其备选成份证券的组合比例不低于基金资产的90%;投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%;本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	中证银华成长股债恒定组合30/70指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,属于证券投资基金中风险和预期收益较高的品种,其风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

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		银华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	田青
	联系电话	(010)58163000	(010)67595096
	电子邮箱	yhj@yhfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	(010)67595096
传真		(010)58163027	(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	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§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	3,442,943.23
本期利润	5,140,222.94
加权平均基金份额本期利润	0.0545
本期加权平均净值利润率	5.31%
本期基金份额净值增长率	4.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	2,784,054.92
期末可供分配基金份额利润	0.0490
期末基金资产净值	59,566,098.41
期末基金份额净值	1.049
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	4.90%

3.2 基金净值表现

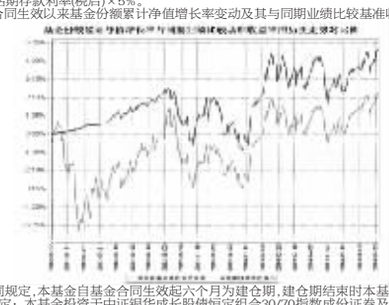
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.16%	0.26%	1.16%	0.26%	0.00%	0.00%
过去三个月	2.24%	0.32%	2.44%	0.29%	-0.20%	0.03%
过去六个月	4.27%	0.38%	4.12%	0.35%	0.15%	0.03%
过去一年	4.48%	0.32%	7.85%	0.39%	-3.37%	-0.07%
自基金合同生效起至今	4.90%	0.31%	2.43%	0.42%	2.47%	-0.11%

注:本基金业绩比较基准为:中证银华成长股债恒定组合30/70指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

由于本基金的标的指数是中证银华成长股债恒定组合30/70指数,且现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。因此,本基金将业绩比较基准定为中证银华成长股债恒定组合30/70指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定;本基金投资于中证银华成长股债恒定组合30/70指数成份证券及其备选成份证券的组合比例不低于基金资产的90%;投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%;本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2亿元人民币,公司的股东及其出资比例分别为:西南证券股份有限公司49%、第一创业证券股份有限公司29%、东北证券股份有限公司21%及山西海鑫实业股份有限公司1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至2014年6月30日,本基金管理人管理着40只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数分级证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重90指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票50指数债券型证券投资基金(LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金和银华活钱宝货币市场基金。同时,本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

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		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2013年5月22日	-	6年	硕士学位,毕业于中国人民大学。2008年7月加盟银华基金管理有限公司,曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职,自2011年9月26日起至2014年1月6日期间担任银华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,自2014年1月7日起兼任银华沪深300指数分级证券投资基金(由银华沪深300指数证券投资基金(LOF)转型)基金经理,自2012年8月23日起兼任上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2013年8月29日起兼任银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
经惠云女士	本基金的基金经理	2012年9月5日	-	5年	硕士学位,2009年7月北京大学毕业后加盟银华基金管理有限公司,曾担任固定收益类研究员,基金经理助理职务,自2013年8月5日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理,自2014年5月8日起兼任银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金及银华中证中票50指数债券型证券投资基金(LOF)基金经理。具有从业资格。国籍:中国。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金证券投资基金合同》和其他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,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人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》,制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等,并建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节,本基金管理人实行集中交易制度,按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节,本基金管理人定期对投票交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合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%的情况有9次,原因是指数型投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

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

上半年,债券市场呈现趋势性牛市行情,股市持续震荡下行。一季度受房地产销售回落以及投资增速放缓影响,宏观经济下行压力不断增大;与此同时,商业银行的风险偏好有所下降,非标业务扩张意愿降低,银行间资金价格不断降低。在基本面和资金面的共同推动下,债券牛市行情启动。进入二季度,房地产销售、投资仍然较弱,保增长、促就业成为政策的主要目标。4月份以来,央行通过定向降准以及公开市场操作等方式投放基础货币,货币政策的调整推动了债券牛市行情的延续。与此同时,以铁路建设为代表的基建项目投资力度不断加码,5月份PMI指标以及发电量数据逐渐走强,反映出经济在短期内可能逐渐走稳,至6月底债券收益率呈现陡峭化上行趋势。而股票投资者的预期分化,股市持续震荡下行。

在报告期内,我们运用自行开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的中购赎回处理、结构配比校验、风险优化等一系列事件,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

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1.049元,本报告期份额净值增长率为4.27%,同期业绩比较基准增长率为4.12%。本基金日均跟踪误差控制在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受益于全球经济复苏,出口增速有望逐渐恢复到正常水平。由于收入分配机制没有实质性改变,边际消费倾向难以提升,预计消费增长仍将维持在较低水平。由于人口红利的结束,房地产市场的供需关系悄然发生了转变,房地产投资处于下行周期的起始阶段。制造业受困于产能过剩,杠杆率过高的问题,制造业投资短期也难有起色。能够延缓经济下行的只有基建投资。我们预计针对基建投资的定向微刺激作用将继续起到维持经济增长的作用。综合以上因素,我们预计经济增长将处于较低水平,对股票市场持谨慎的态度。债券方面,定向宽松的货币政策以及结构性托底的经济政策难以转向,因此债券收益率将维持区间震荡态势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会(委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干),负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务;估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

§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

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:银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金

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	1,285,853.02	9,547,116.10
结算备付金	139,525.90	1,088,226.24
存出保证金	10,275.09	16,572.18
交易性金融资产	67,297,327.00	161,396,388.33
其中:股票投资	17,220,327.00	42,459,340.11
基金投资	-	-
债券投资	50,077,000.00	118,937,048.22
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	-	-
应收利息	1,716,807.21	2,740,899.53
应收股利	-	-
应收申购款	29,066.56	3,764.96
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	70,478,854.78	174,792,967.34

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	9,899,865.15	9,799,875.10
应付证券清算款	-	6,504,215.76
应付赎回款	727,749.18	730,579.14
应付管理人报酬	31,677.04	88,261.24
应付托管费	10,559.01	29,420.41
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	13,628.47	57,334.72
应交税费	-	-
应付利息	4,254.04	927.00
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	225,023.48	102,753.39
负债合计	10,912,756.37	17,313,366.76
所有者权益:		
实收基金	56,782,043.49	156,559,905.93
未分配利润	2,784,054.92	919,694.65
所有者权益合计	59,566,098.41	157,479,600.58
负债和所有者权益总计	70,478,854.78	174,792,967.34

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值人民币为1.049元,基金份额总额为56,782,043.49份。

6.2 利润表

会计主体:银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入	6,135,822.10	1,695,121.41
1.利息收入	2,200,043.84	1,695,117.56
其中:存款利息收入	14,854.22	38,083.74
债券利息收入	2,173,760.89	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,428.73	1,657,033.82
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,107,000.80	-
其中:股票投资收益	2,534,452.38	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-563,786.81	-
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	136,335.23	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,697,279.71	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	131,497.75	3.85
减:二、费用	995,599.16	332,339.14
1.管理人报酬	292,196.72	217,729.81
2.托管费	97,398.89	72,576.58
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	63,163.30	-
5.利息支出	247,430.18	-
其中:卖出回购金融资产支出	247,430.18	-
6.其他费用	295,410.07	42,032.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	5,140,222.94	1,362,782.27
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	5,140,222.94	1,362,782.27

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金

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)	156,559,905.93	919,694.65	157,479,600.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,140,222.94	5,140,222.94
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)	-99,777,862.44	-3,275,862.67	-103,053,725.11
其中:1.基金申购款	8,744,572.53	295,738.73	9,040,311.26
2.基金赎回款	-108,522,434.97	-3,571,601.40	-112,094,036.37
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)	56,782,043.49	2,784,054.92	59,566,098.41

项目	上年度可比期间 2013年5月22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)	339,070,719.93	-	339,070,719.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,362,782.27	1,362,782.27
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)	339,070,719.93	1,362,782.27	340,433,502.20

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:

王立新 杨清 龚飒

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和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。

6.4.2 会计政策变更和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间不涉及会计估计变更事项。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期间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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

项目	与本基金的关系
西南证券股份有限公司("西南证券")	基金管理人股东、基金代销机构
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.4 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

注:本基金本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易

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5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
西南证券	71,200,000.00	14.04%	-	-

6.4.4.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.5 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
西南证券	-	-	-	-

注:本基金本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止均无应支付关联方佣金。

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5月22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	292,196.72	217,729.81
其中:支付销售机构的客户维护费	231,619.80	181,768.80

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.60%/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,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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5月22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	97,398.89	72,576.58

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止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

注:本基金的管理人本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止均未运用固有资金投资本基金。

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

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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5月22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	1,285,853.02	10,905.97	20,502,211.71	32,339.94

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间2013年5月22日(基金合同生效日)至2013年6月30日止均无需要说明的其他关联交易事项。

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

注: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

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
002252	上海莱士	2014年6月13日	重大资产重组	63.30	-	-	2,207	54,792.22	139,703.10	-
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	11,333	87,920.73	115,596.60	-
002167	东方锆业	2014年1月2日	重大资产重组	11.39	2014年7月1日	11.10	7,803	82,091.91	88,876.17	-
000762	西藏矿业	2014年4月29日	重大资产重组	10.54	2014年7月28日	11.59	6,005	69,621.01	63,292.70	-
600490	鹏欣资源	2014年6月10日	重大资产重组	6.11	2014年7月15日	6.11	10,344	70,271.01	63,201.84	-
002340	格林美	2014年6月26日	重大事项	11.19	2014年7月24日	11.77	4,892	53,403.02	54,741.48	-
600685	广船国际	2014年4月8日	重大资产重组	17.13	-	-	3,068	32,232.24	52,554.84	-
601012	隆基股份	2014年6月19日	重大事项	15.50	2014年7月1日	15.60	2,900	43,100.00	44,950.00	-
600755	厦门国贸	2014年6月27日	实施配股	4.85	2014年7月7日	4.74	8,221	36,762.40	39,871.85	-
002638	勤上光电	2014年6月10日	筹划重大事项	14.15	2014年7月15日	14.75	2,601	29,698.22	36,804.15	-
600864	哈投股份	2014年4月11日	重大资产重组	8.68	2014年7月15日	8.30	4,145	38,283.49	35,978.60	-
600059	古越龙山	2014年6月30日	临时停牌	7.97	2014年7月1日	7.83	4,370	42,224.02	34,828.90	-
600582	天地科技	2014年6月26日	重大资产重组	7.97	-	-	4,300	38,252.00	34,271.00	-
600757	长江传媒	2014年6月17日	重大事项	8.85	-	-	3,619	27,253.78	32,028.15	-
000852	江钻股份	2014年5月28日	重大事项	15.80	-	-	2,024	29,584.23	31,979.20	-
600260	凯乐科技	2014年6月9日	重大资产重组	6.59	-	-	4,179	30,035.68	27,539.61	-
600850	华东电脑	2014年4月4日	重大事项	19.56	2014年7月11日	21.52	1,347	27,353.66	26,347.32	-
002635	安洁科技	2014年6月30日	重大事项	31.99	2014年8月5日	35.19	639	27,878.38	20,441.61	-
601777	力帆股份	2014年6月24日	重大事项	6.39	2014年7月8日	6.70	2,675	15,805.74	17,093.25	-
600507	方大特钢	2014年6月30日	重大事项	3.16	2014年7月2日	3.03	4,681	17,164.17	14,791.96	-

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人民币9,899,865.15元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
130238	13国开38	2014年7月4日	99.33	100,000	9,933,000.00
合计				100,000	9,933,000.00

-

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金并无须说明的其他重要事项。

§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	17,220,327.00	24.43
	其中:股票	17,220,327.00	24.43
2	固定收益投资	50,077,000.00	71.05
	其中:债券	50,077,000.00	71.05
	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	1,425,378.92	2.02
7	其他各项资产	1,756,148.86	2.49
8	合计	70,478,854.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.5 期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	273,327.93	0.46
B	采矿业	544,342.59	0.91
C	制造业	10,453,376.56	17.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	407,697.42	0.68
E	建筑业	456,254.79	0.77
F	批发和零售业	1,123,029.89	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	471,745.25	0.79
H	住宿和餐饮业	25,911.39	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	917,513.60	1.54
J	金融业	269,380.57	0.45
K	房地产业	1,246,989.26	2.09
L	租赁和商务服务业	258,808.96	0.43
M	科学研究和技术服务业	68,431.50	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	155,822.99	0.26
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	169,919.99	0.29
S	综合	112,390.89	0.19
	合计	16,954,943.58	28.46

7.2.6 期末积极投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-