泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

2014 年度报告摘要

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2014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	泰信蓝筹精选股票
基金主代码	290006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月22日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,150,608,491.60份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于在中国经济可持续发展过程中具有核心竞争优势、在其所属行业内占有领先地位、业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司，分享中国经济发展的成果。在严格控制投资风险的条件下，实现基金资产的稳健持续增长。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置和“自下而上”的精选证券相结合的投资策略。充分发挥投资管理人的研究优势，通过投资具有核心竞争优势、在其所属行业内占有领先地位、业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司，在严格控制投资风险的条件下实现基金资产的稳健持续增长。
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。

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		泰信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡阔	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942

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	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	341,492,428.01	150,903,405.35	-87,824,255.65
本期利润	360,099,564.12	78,115,618.51	90,600,891.28
加权平均基金份额本期利润	0.3686	0.0752	0.0870
本期基金份额净值增长率	42.17%	8.69%	16.56%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.2266	-0.1372	-0.2231
期末基金资产净值	1,411,331,208.04	1,067,991,169.47	877,971,229.28
期末基金份额净值	1.2266	0.8628	0.7938

注:1.本基金合同于2009年4月22日正式生效。

2.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.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。

4.期末可供分配利润是指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

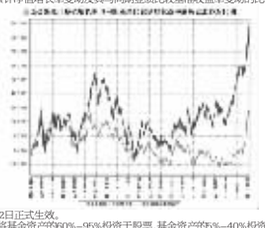
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.84%	1.49%	32.27%	1.23%	-21.43%	0.26%
过去六个月	34.22%	1.26%	45.64%	0.99%	-11.42%	0.27%
过去一年	42.17%	1.32%	38.62%	0.91%	3.55%	0.41%
过去三年	80.12%	1.30%	41.15%	0.97%	38.97%	0.33%
过去五年	42.18%	1.34%	5.77%	1.02%	36.41%	0.32%
自基金合同生效起至今	76.39%	1.36%	32.71%	1.09%	43.68%	0.27%

注:本基金业绩比较基准为:75%*沪深300指数+25%上证国债指数

1.沪深300指数以沪深两市的A股股票中流通市值大、流动性好的蓝筹股为选股基础构建,大约覆盖市场65%的流通市值,行业覆盖均衡,能够较全面地反映国内A股市场的总体趋势。指数通过沪深两个交易所发布,具有权威性和公正性,投资者能方便获得。

2.上证国债指数涵盖了上海证券交易所交易的所有固定利率国债,能够较全面地反映国内债券市场的情况。

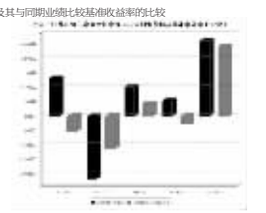
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金基金合同于2009年4月22日正式生效。

2.本基金的建仓期为六个月。本基金将基金资产的60%-95%投资于股票,基金资产的5%-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券（其中,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,资产支持证券不高于基金资产净值的20%。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

2012年度,2013年度本基金未进行利润分配。本基金的基金管理人于2015年1月6日宣告2014年度第一次分红,向截至2015年1月8日止在本基金注册登记入泰信基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.25元。利润分配合计27,591,295.48元其中,现金形式发放19,889,279.47元,再投资形式发放7,702,016.08元。符合基金合同的约定。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信蓝筹精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申赎赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2015)第20712号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信蓝筹精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰信蓝筹精选股票型证券投资基金(以下简称“泰信蓝筹精选股票基金”)的财务报表,包括2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信蓝筹精选股票基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述泰信蓝筹精选股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰信蓝筹精选股票基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	张赫 / 周伟
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼
审计报告日期	2015年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

报告截止日: 2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	94,720,788.50	63,146,084.88
结算备付金	8,276,317.79	726,258.02
存出保证金	960,724.12	430,435.21
交易性金融资产	1,063,188,065.29	917,580,710.69
其中:股票投资	1,063,188,065.29	917,580,710.69
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	280,000,000.00	90,000,000.00
应收证券清算款	719,899.39	800,645.25
应收利息	42,721.33	20,472.78
应收股利	-	-
应收申购款	320,239.17	24,191.99
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,448,228,755.59	1,072,728,798.82
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31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	27,685,250.33	459,508.50
应付赎回款	1,567,682.50	477,308.51
应付管理人报酬	1,808,572.34	1,156,011.63
应付托管费	301,428.70	192,668.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,141,943.48	2,070,387.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	392,670.20	381,945.11
负债合计	36,897,547.55	4,737,629.35
所有者权益:		
实收基金	1,150,608,491.60	1,237,875,823.11
未分配利润	260,722,716.44	-169,884,653.64
所有者权益合计	1,411,331,208.04	1,067,991,169.47
负债和所有者权益总计	1,448,228,755.59	1,072,728,798.82

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.2266元,基金份额总额1,150,608,491.60份。

7.2 利润表

会计主体:泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

本报告期: 2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一.收入	391,793,342.98	106,297,085.89
1.利息收入	3,836,560.27	2,850,192.58
其中:存款利息收入	603,415.56	529,112.89
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	3,233,174.81	2,321,079.61
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	368,362,853.19	175,869,277.70
其中:股票投资收益	365,972,237.10	172,162,755.65
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	-	-
股利收益	2,390,616.09	3,706,522.05
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	18,607,136.11	-72,787,786.84
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	986,783.31	365,402.53
减:二.费用	31,693,778.86	28,181,467.38
1. 管理人报酬	14,473,164.50	13,204,348.46
2. 托管费	2,412,194.06	2,200,724.66
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	14,378,463.31	12,359,360.06
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	429,956.99	417,034.20
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	360,099,564.12	78,115,618.51
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)	360,099,564.12	78,115,618.51

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信蓝筹精选股票型证券投资基

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	1,237,875,823.11	-169,884,653.64	1,067,991,169.47
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	360,099,564.12	360,099,564.12
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)	-87,267,331.51	70,507,805.96	-16,759,525.55
其中:1.基金申购款	1,103,428,324.51	61,629,325.13	1,165,057,649.64
2.基金赎回款	-1,190,695,656.02	8,878,480.83	-1,181,817,175.19
四.本期向基金分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)	1,150,608,491.60	260,722,716.44	1,411,331,208.04
	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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)	1,106,055,300.79	-228,084,071.51	877,971,229.28
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	78,115,618.51	78,115,618.51
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)	131,820,522.32	-19,916,200.64	111,904,321.68
其中:1.基金申购款	649,074,384.75	-95,653,228.56	553,421,126.19
2.基金赎回款	-517,253,834.43	75,737,027.92	-441,516,806.51
四.本期向基金分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)	1,237,875,823.11	-169,884,653.64	1,067,991,169.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____葛航_____ _____韩波_____ _____蔡海成_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基本会计假设

泰信蓝筹精选股票型证券投资基金以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第103号《关于核准泰信蓝筹精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,075,066,130.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第075号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》于2009年4月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,075,266,237.12份基金份额,其中认购资金利息折合200,107.12份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》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各类股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:股票资产占基金资产的60%-95%,债券、现金类资产及权证、资产支持证券占基金资产的5%-40%,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,资产支持证券不高于基金资产净值的20%。本基金的业绩比较基准为:75% ×沪深300指数 + 25% ×上证国债指数。

本报告期末由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于2015年3月26日批准报出。

7.4.2 会计科目及其主要核算方法

本基金的财务报表按照财政部于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”),中国证监会颁布的《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》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金合同》和在财务报表附注7.4.6所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布了以下新会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2014年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
山东省国际信托有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司（“青岛国信”）	基金管理人的股东
上海悦盛资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联交易单元进行股票交易。

债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,473,164.50	13,204,348.46
其中:支付销售机构的客户维护费	1,488,496.04	1,792,467.80

注:支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,412,194.06	2,200,724.66

注:支付基金托管人中国银行的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。其计算公式为:日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期本基金未发生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券含回购交易

本期末及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	49,485,160.18	49,485,160.18
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	14,000,000.00	-
期末持有的基金份额	35,485,160.18	49,485,160.18
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.0800%	4.0000%

注:基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度赎回本基金的交易委托中国银行办理,无赎回费。

7.4.8.4.2 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

关联方名称	本期末 2014年12月31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
山东国托	5,456,120.94	0.4700%	-	-

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国银行	94,720,788.50	384,980.48	63,146,084.88	345,249.39

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行间业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 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无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.9.2 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
600725	云维股份	2014年12月18日	重大事项	5.02	-	-	6,195,716	29,895,401.95	31,102,494.32	-
000009	中国宝安	2014年12月29日	重大事项	12.95	2015年1月7日	13.88	2,016,179	29,433,613.52	26,109,518.05	-
300278	华昌达	2014年9月22日	重大事项	16.46	2015年2月3日	18.11	751,100	12,265,016.28	12,363,106.00	-
002070	众和股份	2014年9月5日	重大事项	9.49	2015年3月11日	10.00	823,650	5,616,726.51	7,816,438.50	-

注:本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为985,796,508.42元,属于第二层次的余额为77,391,556.87 元,无属于第三层次的余额2013年12月31日:第一层次880,380,710.69元,第二层次37,200,000.00元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的转入变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停导致的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间,交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	1,063,188,065.29	73.41
	其中:股票	1,063,188,065.29	73.41
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	280,000,000.00	19.33
	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	102,997,106.29	7.11
7	其他各项资产	2,043,584.01	0.14
8	合计	1,448,228,755.59	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	33,591,539.01	2.38
C	制造业	569,234,076.94	40.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,495,116.00	4.64
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	61,902,410.60	4.39
G	交通运输、仓储和邮政业	123,752,997.44	8.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,545,571.20	1.95
J	金融业	60,960.00	0.00
K	房地产业	52,222,883.07	3.70
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	69,932,392.72	4.96
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	59,449,118.41	4.21
	合计	1,063,188,065.29	75.33

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	600018	上港集团	10,190,632	65,423,857.44	4.64
2	600388	龙净环保	1,859,200	65,072,000.00	4.61
3	601989	中国重工	6,290,000	57,930,900.00	4.10
4	002573	国电清新	1,489,182	41,220,657.76	2.92
5	600021	上海电力	4,810,000	37,566,100.00	2.66
6	600895	张江高科	2,502,973	33,339,600.36	2.36
7	600725	云维股份	6,195,716	31,102,494.32	2.20
8	600316	洪都航空	1,069,200	29,905,524.00	2.12
9	600292	中电远达	1,288,682	28,771,834.96	2.03
10	000777	中核科技	999,600	28,328,664.00	2.01

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	601318	中国平安	146,767,910.04	13.65
2	601989	中国重工	98,327,168.99	9.21
3	600028	中国石化	92,674,688.85	8.68
4	600018	上港集团	82,240,289.95	7.70
5	000009	中国宝安	65,371,757.43	6.12
6	601618	中国中冶	61,858,480.88	5.79
7	600388	龙净环保	60,577,824.18	5.67
8	600808	马钢股份	54,794,150.00	5.13
9	601328	交通银行	54,580,671.06	5.11
10	600369	西南证券	51,369,192.48	4.81
11	600316	洪都航空	51,038,159.44	4.78
12	000659	万向钱潮	50,823,284.77	4.76
13	000768	中航飞机	48,537,511.39	4.54
14	601018	宁波港	46,870,322.57	4.39
15	000733	振华科技	46,332,676.21	4.34
16	600895	张江高科	45,468,566.20	4.26
17	600406	国电南瑞	43,949,166.01	4.12
18	300147	香雪制药	43,283,326.94	4.05
19	600016	民生银行	41,932,074.96	3.93
20	601668	中国建筑	41,341,014.48	3.87
21	601800	中国交建	40,383,445.67	3.78
22	600663	陆家嘴	40,227,887.32	3.77
23	300024	机器人	39,963,513.93	3.74
24	600765	中航重机	39,761,931.30	3.72
25	601600	中国铝业	39,350,604.61	3.68
26	600372	中航电子	39,267,639.90	3.68