(上接B156版)

9.3 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	601607	上海医药	8,393,082	103,990,285.98	3.80
2	600583	海油工程	13,039,395	96,361,129.05	3.52
3	601318	中国平安	1,499,905	59,156,253.20	2.16
4	002557	洽洽食品	3,108,520	52,844,840.00	1.93
5	002594	比亚迪	1,069,210	51,215,159.00	1.87
6	600511	国药股份	2,044,484	45,939,555.48	1.68
7	002331	皖通科技	3,615,464	40,746,279.28	1.49
8	601601	中国太保	1,999,961	35,519,307.36	1.30
9	600240	华业地产	7,111,456	33,779,416.00	1.23
10	002241	歌尔声学	1,107,919	30,024,604.90	1.10

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http://www.nffund.com的年度报告正文。

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 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	002557	洽洽食品	65,260,648.86	2.32
2	002242	九阳股份	63,439,899.02	2.26
3	002405	四维图新	59,514,068.59	2.12
4	002331	皖通科技	45,731,340.04	1.63
5	601318	中国平安	41,494,618.38	1.48
6	600240	华业地产	33,031,058.95	1.17
7	300098	高新兴	23,252,298.99	0.83
8	002327	富安娜	22,584,241.48	0.80
9	300030	阳普医疗	21,822,297.00	0.78
10	600028	中国石化	21,236,102.73	0.76
11	002433	太安堂	18,555,696.37	0.66
12	601601	中国太保	17,998,811.05	0.64
13	002303	美盈森	16,137,110.62	0.57
14	601088	中国神华	15,330,946.18	0.55
15	601628	中国人寿	15,077,390.83	0.54
16	600446	金证股份	13,961,197.70	0.50
17	300295	三六五网	12,874,035.41	0.46
18	600600	青岛啤酒	12,620,735.11	0.45
19	300155	安居宝	11,293,151.88	0.40
20	002396	星网锐捷	10,912,355.23	0.39

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

9.4.2 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	002570	贝因美	73,648,395.41	2.62
2	002405	四维图新	71,724,847.19	2.55
3	002185	华天科技	63,445,933.18	2.26
4	600036	招商银行	52,378,483.32	1.86
5	600518	康美药业	48,811,851.92	1.74
6	600030	中信证券	46,832,536.71	1.67
7	600875	东方电气	45,735,850.12	1.63
8	300177	中海达	43,165,083.45	1.53
9	600703	三安光电	42,908,855.13	1.53
10	600240	华业地产	41,379,596.93	1.47
11	601318	中国平安	40,348,598.82	1.43
12	600872	中炬高新	39,678,427.71	1.41
13	002396	星网锐捷	39,430,604.04	1.40
14	601299	中国北车	38,603,490.99	1.37
15	002242	九阳股份	36,101,135.45	1.28
16	002429	兆驰股份	32,693,376.60	1.16
17	601800	中国交建	30,464,347.29	1.08
18	601668	中国建筑	29,858,986.00	1.06
19	002594	比亚迪	28,400,227.77	1.01
20	601028	玉龙股份	25,806,401.43	0.92

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

9.4.3 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	781,534,569.38
卖出股票收入(成交)总额	1,462,859,401.31

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,不考虑相关交易费用。

9.5 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	1,308,447,000.00	47.81
	其中:政策性金融债	1,308,447,000.00	47.81
4	企业债券	30,327,000.00	1.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,758,463.20	0.21
8	其他	-	-
9	合计	1,344,532,463.20	49.13

9.6 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	130428	13农发28	2,500,000	250,450,000.00	9.15
2	140208	14国开08	2,000,000	203,060,000.00	7.42
3	120204	12国开04	2,000,000	199,100,000.00	7.27
4	130236	13国开36	1,800,000	180,036,000.00	6.58
5	130227	13国开27	1,600,000	160,016,000.00	5.85

9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金报告期末未持有资产支持证券。

9.8 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

9.9 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

9.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货

9.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货

9.12 投资组合报告附注

9.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

9.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

9.12.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	675,483.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,953,057.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,628,540.42

9.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	5,758,463.20	0.21

9.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

9.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§10 投资组合报告(转型后)

10.1 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	861,628,764.66	83.85
	其中:股票	861,628,764.66	83.85
2	固定收益投资	2,883,000.00	0.28
	其中:债券	2,883,000.00	0.28
	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	162,551,827.51	15.82
7	其他资产	538,539.74	0.05
8	合计	1,027,602,131.91	100.00

10.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,726.86	0.00
B	采矿业	12,980,000.00	1.36
C	制造业	300,168,137.07	31.35
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	53,858,104.19	5.63
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	28,686,511.83	3.00
J	金融业	192,596,034.82	20.12
K	房地产业	226,669,654.14	23.68
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	30,419,596.75	3.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,393,000.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	11,856,000.00	1.24
	合计	861,628,764.66	90.00

10.3 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(转型后)

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	600036	招商银行	3,076,786	51,043,879.74	5.33
2	600240	华业地产	4,781,812	47,770,301.88	4.99
3	600000	浦发银行	2,863,470	44,927,844.30	4.69
4	000718	苏宁环球	6,258,911	42,122,471.03	4.40
5	601607	上海医药	2,324,626	38,356,329.00	4.01
6	600185	格力地产	1,699,969	37,399,318.00	3.91
7	000709	河北钢铁	8,000,000	30,640,000.00	3.20
8	601318	中国平安	400,059	29,888,407.89	3.12
9	000625	长安汽车	1,614,940	26,533,464.20	2.77
10	002658	雪迪龙	961,241	26,472,577.14	2.77

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http://www.nffund.com的年度报告正文。

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	62,823,187.96	6.56
2	600690	青岛海尔	61,642,779.37	6.44
3	600036	招商银行	41,955,004.16	4.38
4	000718	苏宁环球	38,339,973.14	4.00
5	000838	国兴地产	27,469,320.83	2.87
6	600158	中体产业	26,968,418.09	2.82
7	600000	浦发银行	24,090,000.00	2.52
8	000709	河北钢铁	23,599,107.55	2.46
9	600185	格力地产	23,257,801.23	2.43
10	300131	英唐智控	22,520,309.90	2.35
11	601318	中国平安	21,802,340.00	2.28
12	000031	中粮地产	21,267,514.07	2.22
13	600016	民生银行	19,795,209.00	2.07
14	001696	宗申动力	19,520,223.96	2.04
15	600030	中信证券	19,333,920.44	2.02
16	000063	中兴通讯	18,768,111.32	1.96
17	600837	海通证券	16,980,182.00	1.77
18	600466	迪康药业	16,330,491.76	1.71
19	000069	华侨城A	15,397,551.30	1.61
20	000592	平潭发展	15,018,885.70	1.57

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

10.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600583	海油工程	101,019,044.71	10.55
2	601607	上海医药	77,157,805.52	8.06
3	601318	中国平安	62,950,358.35	6.58
4	600690	青岛海尔	62,650,406.96	6.54
5	002557	洽洽食品	57,228,198.24	5.98
6	002594	比亚迪	51,329,446.13	5.36
7	600511	国药股份	49,259,229.94	5.15
8	002230	科大讯飞	48,082,783.62	5.02
9	002331	皖通科技	41,339,547.00	4.32
10	000592	平潭发展	40,006,060.92	4.18
11	300131	英唐智控	32,231,949.37	3.37
12	002241	歌尔声学	30,432,531.64	3.18
13	600388	龙净环保	29,672,308.66	3.10
14	601601	中国太保	29,451,798.82	3.08
15	000838	国兴地产	27,843,223.57	2.91
16	600036	招商银行	27,768,256.01	2.90
17	002327	富安娜	27,338,130.49	2.86
18	600875	东方电气	26,001,867.35	2.72
19	600030	中信证券	25,219,691.93	2.63
20	601808	中海油服	24,944,677.01	2.61
21	601336	新华保险	24,256,996.78	2.53
22	600028	中国石化	22,244,562.34	2.32
23	600240	华业地产	21,163,868.33	2.21
24	601166	兴业银行	20,180,042.81	2.11
25	600518	康美药业	19,951,454.67	2.08

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

10.4.3 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	1,000,543,463.39
卖出股票收入(成交)总额	1,564,779,321.60

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,不考虑相关交易费用。

10.5 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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,883,000.00	0.30
8	其他	-	-
9	合计	2,883,000.00	0.30

10.6 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	110030	格力转债	28,830	2,883,000.00	0.30

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

10.8 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

10.9 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

10.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货

10.12 投资组合报告附注

10.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

10.12.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	505,918.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,665.59
5	应收申购款	3,955.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	538,539.74

10.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600240	华业地产	47,770,301.88	4.99%	重大资产重组

10.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§11 基金份额持有人信息(转型前)

11.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
39,569	75,816.93	1,943,833,170.00	64.79%	1,056,166,830.00	35.21%

11.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险(集团)公司	441,696,614.00	14.72%
2	中国人寿保险股份有限公司	298,301,251.00	9.94%
3	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002深	200,341,821.00	6.68%
4	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	119,686,328.00	3.99%
5	伦敦市投资管理有限公司-客户资金	61,621,128.00	2.05%
6	中国财产再保险股份有限公司	51,209,352.00	1.71%
7	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-银保分红	50,000,000.00	1.67%
8	中国大地财产保险股份有限公司	47,067,343.00	1.57%
9	泰康人寿保险股份有限公司-万能-个险万能	46,013,696.00	1.53%
10	中国再保险(集团)股份有限公司	45,944,870.00	1.53%

11.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本公司从业人员未持有本基金份额。

11.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理未持有本基金份额。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
30,849	24,566.47	248,347,305.00	32.77%	509,503,578.97	67.23%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	南方基金管理有限公司	41,475,711.00	6.06%
2	宝钢集团有限公司	38,336,627.00	5.60%
3	中国人寿再保险股份有限公司	35,562,255.00	5.19%
4	新华人寿保险股份有限公司	19,956,330.00	2.91%
5	太平人寿保险有限公司	17,606,762.00	2.57%
6	光大证券-光大银行-光大阳光基中宝(阳光2号二期)集合资	8,334,058.00	1.22%
7	幸福人寿保险股份有限公司-自有资金	7,820,148.00	1.14%
8	上海电气集团财务有限责任公司	4,520,090.00	0.66%
9	程梦茜	3,990,000.00	0.58%
10	上海国有资产经营有限公司	3,954,155.00	0.48%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	999.50	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理未持有本基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年7月3日)基金份额总额	3,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,355,913.58
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,060,993,080.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-193,511,949.00
报告期期末基金份额总额	757,850,883.97

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

基金合同生效日(2014年7月3日)基金份额总额

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,因中国工商银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。 本报告期内,本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

根据天元证券投资基金份额持有人大会决议,本基金投资策略修改为:"本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的"。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用137,000.00元,该审计机构提供审计服务的第1年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融有限公司	1	772,181,600.28	30.10%	683,304.25	29.65%	-
中投证券	1	565,919,593.10	22.06%	515,212.86	22.36%	-
平安证券	2	404,606,445.90	15.77%	359,689.37	15.61%	-
方正证券	1	401,111,898.70	15.64%	365,172.91	15.85%	-
浙商证券	1	163,966,600.30	6.39%	149,275.69	6.48%	-
国泰君安	1	114,020,934.40	4.44%	103,804.25	4.50%	-
广州证券	1	90,101,677.35	3.51%	79,730.96	3.46%	-
国信证券	2	53,414,035.10	2.08%	48,408.62	2.10%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融有限公司	-	-	300,000,000.00	27.27%	-	-
中投证券	6,063,780.30	46.01%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	7,116,788.00	53.99%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	800,000,000.00	72.73%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-

注:交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

A:选择标准

1.公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;

2.公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

3.公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

4.建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B:选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

1.服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2.研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

3.资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	553,343,032.29	24.83%	489,654.41	24.48%	-
中投证券	1	518,956,484.56	23.29%	472,458.97	23.62%	-
中金公司	1	269,318,167.34	12.09%	238,320.59	11.92%	-
中银证券	1	259,918,428.23	11.66%	236,631.87	11.83%	-
长江证券	1	253,125,746.77	11.36%	230,446.53	11.52%	-
兴业证券	1	228,553,487.36	10.26%	202,247.90	10.11%	-
广州证券	1	41,541,760.94	1.86%	36,760.26	1.84%	-
国泰君安	1	38,790,867.27	1.74%	35,315.12	1.77%	-
申银万国	2	35,837,927.29	1.61%	31,713.16	1.59%	-
银河证券	2	29,142,780.31	1.31%	26,531.47	1.33%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

注:交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

A:选择标准

1.公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;

2.公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

3.公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

4.建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B:选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

1.服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2.研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

3.资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

(上接B158版)

公式为:

对应级别日销售服务费=前一日对应类别基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

7.8.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.8.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.8.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.8.7.5 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

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月14日(基金合同失效前日)	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	139,963.41	16,285.34
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,033,560.51	61,612.78

注:本基金的活期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。

7.8.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.8.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.8.8 期末(2014年12月14日(基金合同失效前日))本基金持有的流通受限证券

7.8.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.8.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.8.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.8.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月14日(基金合同失效前日)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20,999,789.50元,是以如下债券作为抵押:

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
041458003	14圣农CP001	2015-01-05	99.96	100,000	9,996,220.84
071438004	14湘财证券CP004	2015-01-05	99.91	100,000	9,991,082.50
041464062	14欧亚CP002	2015-01-05	99.97	50,000	4,998,562.69