天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）

【2014】年度报告摘要

基金管理人：天弘基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2015年3月26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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月20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。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘深证成份指数(LOF)
场内简称	天弘深成
基金主代码	164205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月12日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,846,489.83
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年9月17日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，实现对深证成份指数的有效跟踪，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。 当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况（如成份股停牌、成份股流动性受限等）导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金产品中高风险、高收益的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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		天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	蒋松云
	联系电话	022-83310208	010-66105799
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007109999	95588
传真		022-83865569	010-66105798

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	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§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	-9,649,589.79	-10,663,609.69	-4,276,453.47
本期利润	16,533,914.15	-6,974,535.17	1,939,839.78
加权平均基金份额本期利润	0.1939	-0.0723	0.0182
本期基金份额净值增长率	33.49%	-10.12%	2.56%
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	-0.2972	-0.3523	-0.2793
期末基金资产净值	68,170,922.48	58,722,274.03	74,644,094.68
期末基金份额净值	0.865	0.648	0.721

注：1、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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

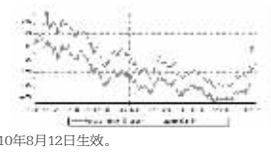
3.2 基金净值表现

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	34.11%	1.53%	34.28%	1.53%	-0.17%	0.00%
过去六个月	46.61%	1.26%	47.10%	1.28%	-0.49%	-0.02%
过去一年	33.49%	1.20%	33.74%	1.21%	-0.25%	-0.01%
过去三年	23.04%	1.31%	22.74%	1.31%	0.30%	0.00%
自基金合同生效日起至今(2010年08月12日-2014年12月31日)	-13.50%	1.27%	2.51%	1.35%	-16.01%	-0.08%

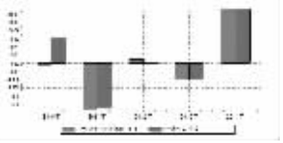
注：天弘深证成份指数（LOF）业绩比较基准：深证成份指数收益率×95%＋银行同业存款利率×5%。本基金是以深证成份指数为标的指数的被动式、指数型基金，以此为业绩比较基准，能够准确地反映本基金的投资绩效。

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、本基金合同于2010年8月12日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：本基金合同于2010年8月12日生效。基金合同生效当年2010年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称"公司"或"本公司"）经中国证监会证监基字[2004]164 号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为1.8亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州设有分公司。公司股东为天津信托有限责任公司（持股比例48%）、内蒙古君正能源化工股份有限公司（持股比例36%）、芜湖高新投资有限公司（持股比例16%）。截至2014年12月31日，本基金管理人共管理16只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘增利宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金。

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		
李蕴炜	本基金基金经理,股票研究部副总经理。	2012年3月	-	8年	男，经济学硕士。历任亚洲证券有限责任公司股票分析师、Orbedge investment services运营分析师。2007年加盟本公司，历任交易员、行业研究员、高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理、天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理。

注：1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。
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

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地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。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他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

本基金按照合同约定对深证成份指数进行等权重配置。除一季度受经济低迷影响有所下跌外，本基金在其他三个季度均实现正增长。在上市公司大规模并购重组，国企改革预期及货币政策宽松的影响下，本基金在2014年度业绩增长率表现良好。截至2014年12月31日，本基金份额净值为0.865元，本报告期份额净值增长率33.49%，本基金日平均跟踪误差为0.0926%，年化跟踪误差为1.4283%。实现了基金管理人力求将本基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内、年跟踪误差控制在4%的目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日，本基金份额净值为0.865元。本报告期本基金份额净值增长率33.49%，同期业绩比较基准增长率33.74%。报告期内，日均跟踪误差为0.0926%，年化跟踪误差为1.4283%。

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2015年，我们认为经济仍将逐步下行，在此基础上国家会进一步出台货币宽松及财政刺激等政策，同时，降息和降准等政策也会择机出台。因此，从宏观上看，上述支持性因素会不断刺激市场走强。同时，在中国经济结构性改革的时代，结构性行情及创新板块仍将表现抢眼，预计本基金在2015年全年仍将取得正回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及监察稽核人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

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，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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，本基金托管人在对天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）的管理人--天弘基金管理有限公司在天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）2014年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，该所出具了"无保留意见的审计报告"，且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	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		4,774,391.21	3,399,879.21
结算备付金		609.58	-
存出保证金		2,370.75	1,790.99
交易性金融资产		64,358,340.88	55,570,049.96
其中：股票投资		64,358,340.88	55,570,049.96
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		-	-
应收证券清算款		-	274,148.90
应收利息		1,082.34	754.39
应收股利		-	-
应收申购款		59,669.23	9,340.75
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		69,196,463.99	59,255,964.20
负债和所有者权益	附注号	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		-	-
应付赎回款		412,390.76	102,246.11
应付管理人报酬		40,930.62	38,314.85
应付托管费		8,186.09	7,662.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,909.29	2,580.29
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		561,124.75	382,885.99
负债合计		1,025,541.51	533,690.17
所有者权益：			
实收基金		78,846,489.83	90,667,414.79
未分配利润		-10,675,567.35	-31,945,140.76
所有者权益合计		68,170,922.48	58,722,274.03
负债和所有者权益总计		69,196,463.99	59,255,964.20

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值0.865元，基金份额总额78,846,489.83份。

7.2 利润表

会计主体：天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	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		17,781,011.01	-5,867,842.16
1.利息收入		28,975.74	28,924.05
其中：存款利息收入		28,975.74	28,924.05
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-8,439,687.31	-9,592,204.90
其中：股票投资收益		-9,502,737.64	-10,636,709.24
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		1,063,050.33	1,044,504.34
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		26,183,503.94	3,689,074.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)			
5.其他收入(损失以"-"号填列)		8,218.64	6,364.17
减：二、费用		1,247,096.86	1,106,693.01
1.管理人报酬		402,240.59	500,479.33
2.托管费		80,448.13	100,095.78
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		48,301.03	60,412.96
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		716,107.11	445,704.94
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		16,533,914.15	-6,974,535.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		16,533,914.15	-6,974,535.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）

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)	90,667,414.79	-31,945,140.76	58,722,274.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,533,914.15	16,533,914.15
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)	-11,820,924.96	4,735,659.26	-7,085,265.70
其中：1.基金申购款	15,555,288.00	-4,886,137.29	10,669,150.71
2.基金赎回款	-27,376,212.96	9,621,796.55	-17,754,416.41
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）	78,846,489.83	-10,675,567.35	68,170,922.48
项 目	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)	103,568,905.76	-28,924,811.08	74,644,094.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,974,535.17	-6,974,535.17
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)	-12,901,490.97	3,954,205.49	-8,947,285.48
其中：1.基金申购款	7,482,640.23	-2,399,159.74	5,083,480.49
2.基金赎回款	-20,384,131.20	6,353,365.23	-14,030,765.97
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）	90,667,414.79	-31,945,140.76	58,722,274.03

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：

项 目	韩海潮 主管会计工作负责人	曹贺龙 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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

（1）财政部于2014年颁布《企业会计准则第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》，要求除《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及上年度可比期间无重大影响。

（2）本基金本报告期会计报表所采用的会计估计与最近一期年度报告会计报表所采用的会计估计一致。

7.4.2 关联方关系

7.4.2.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.2.2 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
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(下中国工商银行)	基金托管人、基金代销机构
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
北京天地方中资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 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	402,240.59	500,479.33
其中：支付销售机构的客户维护费	182,453.07	230,734.32

注：1.支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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X0.75%/当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.3.2.2 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	80,448.13	100,095.78

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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X0.15%/当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.3.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.5 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
中国工商银行	4,774,391.21	28,813.06	3,399,879.21	28,552.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.3.7 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。

7.4.4 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
000562	宏源证券	2014-12-10	重大资产重组	36.38		-	82,354	726,492.32	2,996,038.52

注：根据宏源证券股份有限公司(以下简称"宏源证券")于2014年12月2日公布的《申银万国证券股份有限公司换股吸收合并宏源证券股份有限公司报告书》和《关于申银万国证券股份有限公司换股吸收合并本公司事宜的提示性公告》，申银万国证券股份有限公司将向宏源证券全体股东发行A股股票，以换股比例2.049:1取得宏源证券股东持有的宏源证券全部股票，吸收合并宏源证券；宏源证券自2014年12月10日起连续停牌。合并后的申万宏源于2015年1月26日复牌，当日复牌开盘单价为17.77元。宏源证券人民币普通股股票自2015年1月26日起终止上市并摘牌。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	64,358,340.88	93.01
	其中：股票	64,358,340.88	93.01
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	-	-
	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	4,775,000.79	6.90
7	其他各项资产	63,122.32	0.09
8	合计	69,196,463.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,318,957.39	1.93
C	制造业	31,906,511.88	46.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	739,754.40	1.09
F	批发和零售业	1,908,540.00	2.80
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	1,437,303.32	2.11
J	金融业	14,546,145.41	21.34
K	房地产业	9,004,228.73	13.21
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	2,417,048.25	3.55
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	1,079,851.50	1.58
S	综合	-	-
	合计	64,358,340.88	94.41

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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	000002	万 科A	450,042	6,255,583.80	9.18
2	000651	格力电器	118,642	4,403,991.04	6.46
3	000001	平安银行	252,212	3,995,038.08	5.86
4	000776	广发证券	146,871	3,811,302.45	5.59
5	000562	宏源证券	82,354	2,996,038.52	4.39
6	000783	长江证券	172,044	2,893,780.08	4.24
7	000333	美的集团	94,689	2,598,266.16	3.81
8	000858	五 粮 液	91,539	1,968,088.50	2.89
9	002024	苏宁云商	212,060	1,908,540.00	2.80
10	000625	长安汽车	105,755	1,737,554.65	2.55

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的年度报告报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300104	乐视网	1,601,300.55	2.73
2	002236	大华股份	1,332,513.75	2.27
3	002353	杰瑞股份	1,310,947.51	2.23
4	300070	碧水源	1,104,531.93	1.88
5	002594	比亚迪	1,099,909.18	1.87
6	300027	华谊兄弟	1,046,408.60	1.78
7	002230	科大讯飞	934,525.00	1.59
8	000581	威孚高科	841,932.84	1.43
9	002415	海康威视	278,565.00	0.47
10	000625	长安汽车	172,936.00	0.29
11	000562	宏源证券	156,264.00	0.27
12	000402	金 融 街	125,501.00	0.21
13	000725	京东方A	115,489.00	0.20
14	000629	攀钢钒钛	102,010.00	0.17
15	002142	宁波银行	93,641.00	0.16
16	002024	苏宁云商	52,425.00	0.09
17	000768	中航飞机	51,462.00	0.09
18	000538	云南白药	49,640.00	0.08
19	000783	长江证券	34,125.00	0.06
20	000776	广发证券	30,408.00	0.05

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	1,291,970.27	2.20
2	000651	格力电器	1,149,680.02	1.96
3	000001	平安银行	971,835.29	1.65
4	300104	乐视网	724,041.31	1.23
5	002024	苏宁云商	714,003.67	1.22
6	000776	广发证券	641,438.69	1.09
7	000333	美的集团	627,355.55	1.07
8	000425	徐工机械	531,966.40	0.91
9	000858	五 粮 液	529,082.51	0.90
10	000060	中金岭南	519,244.19	0.88
11	000538	云南白药	517,887.37	0.88
12	000402	金 融 街	471,131.38	0.80
13	000630	铜陵有色	467,706.45