

(上接B372版)
2. 本基金截至2014年12月31日止持有以上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,经交易所批准恢复。

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

本基金在报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金在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。

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:

第一次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二次:除第一次外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续以公允价值计量的金融工具

(c)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工具中属于第一次的余额为1,336,899,794.96元,属于第二层次的余额为58,715,499.63元,属于第二层次的余额为44,227,696.93元,属于第二层次的余额为8,921.28元,无属于第三层次的余额。

(i)公允价值所属层次间的重大变动

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(包括涨跌停时的交易不活跃),或属于非公开发行等情况,本基金不会停止买卖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。

(ii)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	权证投资	1,340,522,267.10	99.06
其中:股票	1,340,522,267.10	99.06	
2 固定收益投资	64,093,037.00	3.69	
其中:债券	64,093,037.00	3.69	
3 货币市场	—	—	
4 金融衍生品投资	—	—	
5 其他类金融资产	—	—	
其中:结构性理财产品投资	—	—	
6 银行存款和结算备付金合计	69,929,988.18	4.64	
7 其他各项资产	42,261,795.07	2.80	
8 合计	1,506,811,070.04	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	1,066,204.94	0.07	
B 采矿业	27,790,426.72	1.94	
C 制造业	517,310,276.50	36.00	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	197,057,482.24	13.74	
E 建筑业	14,225,420.00	0.99	
F 批发和零售业	46,735,155.68	3.26	
G 交通运输、仓储和邮政业	79,905,477.16	5.60	
H 餐饮和住宿业	216,260.00	0.02	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	116,725,367.61	8.14	
J 金融业	164,362,432.97	11.46	
K 房地产业	144,376,735.92	10.00	
L 租赁和商务服务业	1,708,179.46	0.12	
M 科学研究、技术服务业	1,935,457.30	0.13	
N 水、电气、燃气和公用设施管理业	12,176,232.64	0.88	
O 居民服务、修理和其他服务业	—	—	
P 教育	—	—	
Q 卫生和社会工作	929,327.00	0.06	
R 文化、体育和娱乐业	293,618.89	0.02	
S 综合	14,690,011.37	1.02	
合计	1,340,522,267.10	99.44	

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

代码	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	002230	科大讯飞	2,944,079	75,794,706.35	5.28
2	002236	大华股份	2,164,897	47,510,495.15	3.31
3	002407	二六三	1,889,865	45,511,549.00	3.17
4	001009	建设银行	3,496,446	23,545,514.00	1.64
5	601000	招商银行	1,696,062	23,367,652.00	1.63
6	601998	中行银行	2,535,600	20,638,784.00	1.44
7	000726	鲁泰A	1,366,306	19,738,137.00	1.38
8	601995	华夏银行	1,461,500	19,671,790.00	1.37
9	000340	华安幸福	436,361	19,024,900.00	1.33
10	000339	鲁商A	2,412,282	18,912,290.81	1.32

注:投资者欲了解本报期末基金投资的所有股票明细,应阅读载于基金管理人网站(<http://www.msfunds.com.cn>)的年度报告正文。

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	002230	科大讯飞	88,960,983.11	166.35
2	002236	大华股份	54,028,319.69	101.04
3	002407	二六三	29,560,894.36	54.89
4	001009	建设银行	24,367,403.30	46.38
5	601000	招商银行	23,126,797.39	44.00
6	601998	中行银行	21,306,053.20	39.95
7	000726	鲁泰A	19,766,534.00	36.96
8	002415	海康威视	19,146,209.10	36.84
9	000742	一汽富维	18,466,670.61	34.54
10	000726	鲁商A	17,662,077.23	33.22
11	002048	宁波华联	18,318,296.46	34.26
12	000741	华微电子	16,099,096.17	33.79
13	000639	紫光国芯	17,462,377.23	33.22
14	000626	福星股份	17,744,962.90	33.20
15	1360025	长安汽车	17,387,396.03	33.17
16	600177	雅戈尔	17,482,614.18	32.88
17	600674	川投能源	17,669,000.10	32.84
18	600104	上汽集团	17,426,350.49	32.78
19	000338	潍柴动力	16,963,985.13	31.15
20	002440	国阳新能	16,505,538.02	30.96
21	601998	中行银行	16,469,629.80	30.78
22	000409	海通证券	16,340,426.48	30.56
23	000426	华鲁恒升	15,973,384.20	29.69
24	601006	大秦铁路	15,477,966.13	28.95
25	600041	兴发集团	15,364,100.54	28.71
26	600340	华夏幸福	15,296,832.88	28.61
27	000805	培华股份	15,209,446.49	28.44
28	600660	海信科龙	14,831,555.03	27.74
29	000357	广宇发展	14,789,649.40	27.56
30	000352	浙江龙盛	14,039,672.83	26.25
31	000950	山东高速	13,897,433.18	26.09
32	000708	宝新能源	13,776,597.06	26.76
33	000663	格力电器	13,636,692.12	26.50
34	600111	东方电气	13,621,307.57	26.47
35	000453	航天动力	13,403,603.07	25.24
36	600685	海航科技	13,396,354.09	25.05
37	600012	航天通信	12,922,342.99	24.17
38	600768	京能电力	12,602,420.00	23.38
39	000011	深物业A	12,481,612.99	23.34
40	600011	华能国际	12,451,794.44	22.73
41	000418	小天鹅A	11,779,336.36	22.03
42	002039	粤宏远A	11,885,765.59	21.29
43	000277	宁沪高速	11,216,178.50	21.16
44	002244	浙江医药	11,306,6	