

(上接B372版)

2、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 期末债券正回购未持有有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未持有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
本基金本报告期末未持有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工具中属于第一层次的余额为1,335,899,794.96元,属于第二层次的余额为68,715,499.83元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次的余额为44,227,696.93元,属于第二层次的余额为832,921.28元,无属于第三层次的余额)。

(ii)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	1,340,522,257.19	89.06
	其中:股票	1,340,522,257.19	89.06
2	固定收益投资	54,093,027.60	3.59
	其中:债券	54,093,027.60	3.59
	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	69,329,980.18	4.64
7	其他资产	42,285,796.07	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	1,065,204.84	0.07
B	采矿业	27,790,146.73	1.94
C	制造业	817,310,275.59	36.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	197,067,583.24	13.74
E	建筑业	14,225,428.00	0.93
F	批发和零售业	46,735,019.68	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	78,985,477.16	5.60
H	住宿和餐饮业	216,726.00	0.02
I	信息技术、软件和信息技术服务业	116,725,367.61	8.14
J	金融业	164,382,438.77	11.46
K	房地产业	144,375,753.92	10.06
L	租赁和商务服务业	1,708,179.46	0.12
M	科学研究和技术服务业	1,035,467.30	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	12,176,823.64	0.85
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	293,061.88	0.02
S	综合	14,690,011.27	1.02
8	合计	1,340,522,257.19	92.44

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	2,844,077	75,794,705.36	5.29
2	002228	大亚股份	2,194,897	47,510,489.15	3.31
3	002467	二六三	1,889,885	23,541,549.06	1.71
4	601039	建设银行	3,496,446	23,544,541.58	1.64
5	601009	南京银行	1,595,062	20,377,682.30	1.43
6	601986	中国银行	2,535,600	20,639,794.00	1.64
7	000726	鲁 泰 A	1,646,300	19,730,137.00	1.38
8	600015	华夏幸福	1,461,500	19,671,790.00	1.37
9	600340	华夏幸福	436,351	19,024,003.00	1.33
10	000629	粤电力 A	2,412,262	18,912,230.88	1.32

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站(<http://www.msfund.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	89,960,882.11	10.93
2	002228	大亚股份	54,029,219.69	10.14
3	002467	二六三	20,260,894.92	94.80
4	601039	建设银行	24,267,403.39	45.38
5	601009	南京银行	23,626,797.39	44.00
6	600636	招商局	21,306,052.26	39.85
7	600660	福耀玻璃	19,756,534.08	36.96
8	002415	海康威视	19,166,200.10	35.84
9	000742	广日股份	18,466,670.61	34.54
10	000726	鲁 泰 A	18,354,898.66	34.32
11	000448	宁波银行	18,310,296.46	34.26
12	600741	华鲁恒升	18,069,096.17	32.79
13	000639	粤电力 A	17,762,977.23	32.22
14	000626	福耀玻璃	17,754,962.90	32.20
15	000625	长安汽车	17,738,860.83	32.17
16	600177	雅戈尔	17,582,614.18	32.08
17	600674	川仪股份	17,559,000.10	32.04
18	600104	上汽集团	17,526,350.49	32.05
19	000318	雅化集团	16,663,988.63	31.15
20	002440	广日股份	16,555,538.02	30.96
21	600198	中国银行	16,461,628.06	30.78
22	600015	华夏幸福	16,240,425.48	30.68
23	600426	华鲁恒升	15,873,988.29	29.69
24	601006	大秦铁路	15,477,066.13	29.95
25	600141	兴发集团	15,354,100.54	29.71
26	600340	华夏幸福	15,256,622.88	29.61
27	600056	悦达投资	15,209,446.49	29.44
28	600660	福耀玻璃	14,831,555.93	27.74
29	000637	广宇发展	14,735,646.49	27.56
30	600662	浙江龙盛	14,038,697.83	26.25
31	600660	福耀玻璃	13,867,432.18	25.99
32	000639	粤电力 A	13,775,587.68	25.76
33	000651	格力电器	13,685,683.12	25.59
34	600811	东方电机	13,621,307.97	25.47
35	000643	联创光电	13,493,693.97	25.24
36	600686	海康威视	13,396,034.19	25.05
37	600012	皖通高速	13,222,342.09	24.17
38	600678	滨康电力	12,502,142.00	23.38
39	000011	深物业 A	12,481,612.99	23.31
40	600011	深物业 A	12,151,794.44	22.72
41	600418	小天鹅 A	11,779,326.38	22.02
42	002029	黔源电力	11,285,750.59	21.29
43	600777	宁波韵升	11,216,176.00	21.16
44	002244	浙江广厦	11,305,675.67	21.14
45	600000	长江电力	10,996,626.21	20.57
46	600027	华电国际	10,686,002.66	19.99
47	600686	海康威视	10,281,124.96	19.24
48	601088	中国神华	9,912,406.17	18.54
49	600663	内蒙华电	9,891,944.70	18.50
50	000669	华鲁恒升	9,886,034.22	18.42

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(%)
52	600652	泰达股份	9,702,977.31	18.15
53	000027	深圳能源	9,307,659.60	17.41
54	600848	鲁南制药	9,145,917.10	17.11
55	002189	中国国旅	8,414,179.89	15.74
56	600833	海通工程	8,409,717.27	15.73
57	300017	网宿科技	8,068,066.13	15.09
58	601908	中海油服	7,434,778.43	13.90
59	600216	浙江医药	7,281,852.20	13.64
60	600680	青岛海尔	7,069,932.16	13.22
61	600897	伊泰股份	7,038,227.77	13.16
62	600724	重庆啤酒	6,764,576.54	12.66
63	600000	浦发银行	6,761,000.00	12.64
64	601166	兴业银行	6,751,463.78	12.63
65	601117	中国化学	6,541,461.52	12.23
66	000668	五 粮 液	6,529,899.32	12.21
67	600004	白云机场	6,471,583.43	12.10
68	601328	交通银行	6,109,394.00	11.43
69	600662	浙江龙盛	6,084,795.11	11.37
70	600163	建发股份	5,882,016.94	11.07
71	600665	天地股份	5,795,116.68	10.94
72	600801	华新水泥	5,736,413.53	10.73
73	601318	中国平安	5,674,039.88	10.61
74	601398	工商银行	5,561,756.00	10.40
75	000100	TCL 集团	5,456,710.00	10.20
76	600795	国投电力	5,345,189.29	10.03
77	600608	阳光股份	5,139,676.09	9.81
78	601018	光大银行	4,969,591.00	9.28

80	000631	鹏都酒店 A	4,741,732.74	8.97
81	002142	宁波银行	4,689,543.56	8.79
82	000641	佛山照明	4,660,327.36	8.72
83	600469	烽火通信	4,642,700.69	8.68
84	000650	江铃汽车	4,617,115.89	8.63
85	000333	德盛集团	4,601,187.27	8.60
86	600261	阳光照明	4,472,558.10	8.56
87	002304	洋河股份	4,415,988.00	8.46
88	600667	东方特钢	4,306,201.00	8.06
89	600777	宁波韵升	4,210,580.79	7.97
90	601169	北京银行	4,194,022.27	7.94
91	002043	伟星股份	4,119,122.00	7.79
92	600641	万业企业	4,070,066.89	7.61
93	000921	海信科龙	3,981,064.89	7.46
94	600658	电子城	3,966,985.27	7.42
95	600652	浙江广厦	3,911,692.08	7.32
96	000692	康大核电	3,847,043.60	7.19
97	600048	保利地产	3,814,366.20	7.13
98	600785	新华百货	3,752,684.63	7.07
99	600280	中远海能	3,774,448.49	7.04
100	600816	安信信托	3,761,966.89	7.02

序号	600101	中国铝业	3,709,985.84	6.94
102	600028	中国石化	3,708,516.00	6.77
103	600693	东百集团	3,611,201.40	6.75
104	000653	沙隆达A	3,599,846.91	6.73
105	000600	建投能源	3,588,479.00	6.71
106	600720	祁连山	3,562,504.23	6.66
107	600131	顺江水电	3,531,484.93	6.60
108	002233	塔牌集团	3,489,945.47	6.53
109	000657	中通客车	3,480,980.15	6.51
110	600761	安徽合力	3,477,375.34	6.50
111	000651	鄂武商A	3,475,695.90	6.50
112	600020	中国高速	3,440,105.36	6.43
113	000899	赣能股份	3,431,343.00	6.42
114	002146	荣盛发展	3,427,759.00	6.41
115	000789	万年青	3,415,072.00	6.39
116	601107	四川成渝	3,414,877.00	6.39
117	000001	平安银行	3,389,962.66	6.28
118	600376	首开股份	3,350,348.00	6.27
119	600748	上海发展	3,344,152.00	6.25
120	601857	中国石油	3,325,377.00	6.22
121	600382	广东明珠	3,316,405.89	6.20
122	000966	长源电力	3,248,694.44	6.07
123	600703	三安光电	3,168,220.60	5.93
124	600336	国机汽车	3,158,094.84	5.91
125	600694	大商股份	3,125,451.22	5.85
126	002261	拓维信息	3,122,796.32	5.84
127	600548	滨康股份	3,053,401.89	5.71
128	000926	鑫鼎环境	2,951,485.96	5.52
129	000543	海虹控股	2,943,993.21	5.51
130	600540	中天城投	2,890,492.52	5.35
131	002227	富安娜	2,828,897.23	5.29
132	000895	双汇发展	2,827,753.81	5.29
133	601668	中国建筑	2,812,699.00	5.26
134	300047	天源迪科	2,777,968.78	5.20
135	600388	龙净环保	2,691,897.00	5.03
136	601669	中国电建	2,652,070.00	4.98
137	002289	卓翼科技	2,567,039.00	4.76
138	000725	京东方A	2,532,719.00	4.72
139	600030	中信证券	2,425,461.00	4.54
140	600995	文山电力	2,408,649.00	4.50
141	600663	陆家嘴	2,401,760.82	4.49
142	002454	歌普光	2,389,529.53	4.47
143	000002	万科A	2,366,156.00	4.43
144	600068	贵州茅台	2,303,122.00	4.31
145	300083	欧陆精密	2,300,884.76	4.30
146	601380	中国中铁	2,266,129.50	4.24
147	600837	海通证券	2,263,272.00	4.23
148	000561	威孚高科	2,259,339.03	4.23
149	300200	高盟新材	2,246,718.71	4.20
150	601188	龙江交通	2,229,909.00	4.17