长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

【2014】年度报告摘要

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年3月28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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年03月26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。

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01月01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	长城久兆中小板300指数分级		
基金主代码	162010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年1月30日		
基金管理人	长城基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	48,150,552.71份		
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	2012-02-21		
下属分级基金的基金简称	长城久兆中小板300指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
下属分级基金的场内简称	长城久兆	久兆稳健	久兆积极
下属分级基金的交易代码	162010	150057	150058
报告期末下属分级基金份额总额	30,879,829.71份	6,908,289.00份	10,362,434.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资约束和数量化监控,力求实现对中小板300(价格)指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率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	本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时,本基金将运用其他方法建立实际组合,力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。		
业绩比较基准	中小板300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

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		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

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.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

§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1月30日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	10,128,545.88	4,771,698.95	120,506.95
本期利润	9,280,452.35	10,682,048.13	-4,546,366.18
加权平均基金份额本期利润	0.2887	0.2424	-0.0324
本期基金份额净值增长率	13.98%	18.58%	-11.80%
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	0.1826	0.0442	-0.1184
期末基金资产净值	54,724,004.37	75,726,821.75	71,775,194.82
期末基金份额净值	1.137	1.020	0.882

注:①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。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.89%	1.34%	-3.42%	1.36%	-0.47%	-0.02%
过去六个月	14.16%	1.13%	15.07%	1.16%	-0.91%	-0.03%
过去一年	13.98%	1.21%	15.23%	1.21%	-1.25%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.21%	1.30%	40.66%	1.32%	-21.45%	-0.02%

注:从D1到Dn时间区间的绩比较基准的收益率由D1到Dn区间每个交易日收益率的合成计算而来,计算公式如下:

从D1到Dn时间区间的绩比较基准的收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×……×(1+Dn日业绩比较基准收益率)-1

这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下:

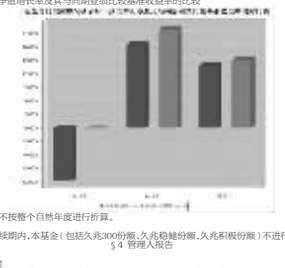
长城久兆业绩比较基准每日收益率=中小板300(价格)指数日收益率×95%+活期存款每日利率(税后)×5%。

指数收益率以当日收盘价相对于上一个交易日收盘价计算而成;计算活期存款利率收益时,如果前一日或者多日为非交易日的,考虑该非交易日。

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:本基金合同规定本基金投资组合为:本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%,其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板300(价格)指数的成份股及其备选成份股。本基金投资于股票的资产占基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,截至建仓期结束,各项投资比例均达标。

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:合同生效当年按实际存续期计算,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

注:根据本基金基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括久兆300份额、久兆稳健份额、久兆积极份额)不进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其分支机构情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司,由长城证券有限责任公司(40%)、东方证券股份有限公司(15%)、西北证券有限责任公司(15%)、北方国际信托投资股份有限公司(15%)、中原信托投资有限公司(15%)于2001年12月27日共同出资设立,当时注册资本为壹亿元人民币。2007年5月21日,经中国证监会批准,公司完成股权结构调整,现有股东为长城证券有限责任公司(47.06%)、东方证券股份有限公司(17.647%)、北方国际信托股份有限公司(17.647%)和中原信托有限公司(17.647%)。2007年10月12日,经中国证监会批准,将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司管理的基金有封闭式基金:久泰证券投资基金;开放式基金:长城久智平衡型证券投资基金、长城久泰中小板300指数证券投资基金、长城久利债券证券投资基金、长城久兆中小板300指数证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久喜核心成长股票型证券投资基金LOF、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金、长城久利债券型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久利债券型证券投资基金、长城久喜核心成长股票型证券投资基金、长城久兆中小板300指数证券投资基金、长城久利债券型证券投资基金、长城久喜核心成长股票型证券投资基金、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会成员情况

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		
余礼冰	长城久兆中小板300指数分级基金的基金经理	2012年4月17日	-	13年	女,中国籍,华中理工大学工学硕士。具有11年证券投资研究经验。曾就职于富国基金、宝盈基金,友邦华泰基金等,2007年加入长城基金管理有限公司,曾任研究部副总经理。2012年1月至2012年4月任"长城久兆中小板300指数分级证券投资基金"基金经理助理,自2012年4月至今任"长城久兆中小板300指数分级证券投资基金"基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,未因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法,严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节,本基金管理人建立和完善投资授权制度、投资对象和投资交易对手库管理制度,投资信息保密制度,保证各投资决策的独立性。在交易执行环节,本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度,按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则,保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节,本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的现象。

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

本基金在报告期内,通过投资的谨和数量化控制,以中小板300(价格)指数成分股为投资组合,采取完全复制策略,紧密跟踪指数走势,缩小跟踪误差。并采用程序化管理和人工管理的方式,处理基金日常运作中出现的基金规模流动性需求、组合偏差调整、风险平衡等事件,将本基金的跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为13.98%,本基准比较基准收益率为15.23%。本报告期内,本基金日均跟踪误差控制在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们观察到,国内经济的工业利润大幅下滑,经济反弹虚有其表;15年1月以来实体经济仅有好转迹象,汇率PMI小幅反弹,地产销量增幅扩大,电力耗煤增速大幅回升。但12月工业企业主营利润增速仍在大幅跳水,期间春节因素后显示期间反弹虚有其表,1月中采制造业PMI再创新低,实体经济依然疲弱。分项看,1月新订单较12下降0.2%,新出口订单较12月下降0.7%,显示国外需求同步走弱。1月生产指数较12环同降0.5%,与今年下半年随电力耗煤同比反弹了一下。1月原材料库存继续较前月,久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比发生保持4:6的比例不变。久兆稳健份额的折算比例与久兆积极份额相同,久兆稳健份额持有人持有的久兆稳健份额数同比减少,超出份额数将全部折算成久兆300份额的5%内份额。

不定期份额折算前后,久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比发生保持4:6的比例不变。折算所产生的场内久兆300份额不进行自动分离。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中小板300(价格)指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、资产支持证券、权证,以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于90%,其中将不低于90%的股票资产投资于中小板300(价格)指数的成份股及其备选成份股,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行,如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,进行组合资产管理。

本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于90%,将不低于90%的股票资产投资于中小板300(价格)指数的成份股及其备选成份股,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期结束准为:中小板300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1季度,财政部陆续发布了《企业会计准则第39号——公允价值计量》和《企业会计准则第30号——财务报表列报》等7项会计准则,上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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

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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,字(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份,既会导致入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3.个人所得税

个人所得税政策为20%。

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于证券市场个人投资者股息红利税有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、既会等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司("长城证券")	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司("东方证券")	基金管理人股东、基金代销机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

注:以下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

金额单位: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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长城证券	-	-	72,154,992.28	27.51%

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金不参与此项交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日				
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
长城证券	-	-	-	-	
	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日				
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
长城证券	65,691.64	27.63%	-	-	

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担费用(包括但不限于交易经手费、证券结算风险基金和证券交易所风险金)后的净额列示。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	350,939.99	431,571.55
其中:支付销售机构的客户维护费	77,942.55	149,415.51

注:①基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

②本期末本基金未支付的管理费余额人民币29,645.45元。

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	77,206.85	94,945.82

注:①基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.22%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.22%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

②本期末本基金未支付的托管费余额人民币6,522.01元。

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

注:本基金于本年度及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

注:本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金,于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

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

注:除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末未投资本基金。

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
中国建设银行	3,427,357.41	20,660.02	7,758,509.91	29,822.42

注:基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

注:本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

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

注:本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
002152	广电运通	2014年12月17日	重大事项	22.15	2015年3月11日	24.37	9,948	173,754.99	220,348.20	-
002123	荣信股份	2014年12月22日	重大事项	9.22	-	-	13,746	119,699.36	126,738.12	-
002018	华信国际	2014年11月19日	重大事项	13.99	2015年3月6日	15.39	8,901	100,140.52	124,524.99	-
002439	启明星辰	2014年12月8日	重大事项	26.24	2015年3月12日	28.86	4,714	100,035.59	123,695.36	-
002312	三泰电子	2014年12月3日	重大事项	23.89	2015年3月6日	26.28	5,167	117,731.91	123,439.63	-
002437	誉衡药业	2014年11月21日	重大事项	23.75	2015年1月26日	26.13	4,839	104,286.42	114,926.25	-
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	11,980	89,054.97	113,690.20	-
002050	三花股份	2014年10月27日	重大事项	13.57	2015年1月27日	14.93	6,960	80,813.25	94,447.20	-
002168	深圳惠程	2014年11月26日	重大事项	10.13	2015年1月28日	9.51	9,018	79,248.39	91,352.34	-
002396	星网锐捷	2014年10月20日	重大事项	27.31	2015年2月9日	30.04	2,872	72,008.10	78,434.32	-
002354	科冕木业	2014年10月31日	重大事项	57.50	2015年3月24日	63.25	1,351	67,785.38	77,682.50	-
002021	中捷资源	2014年9月5日	重大事项	7.01	-	-	10,943	70,612.89	76,710.43	-
002663	普邦园林	2014年12月9日	重大事项	14.40	2015年3月17日	15.84	5,290	74,584.32	76,176.00	-
002009	天奇股份	2014年10月20日	重大事项	16.30	2015年1月28日	17.93	4,560	60,965.45	74,328.00	-
002170	芭田股份	2014年12月25日	重大事项	9.00	2015年1月5日	9.38	7,958	57,023.61	71,622.00	-
002482	广田股份	2014年12月10日	重大事项	15.13	2015年1月6日	16.64	4,352	69,055.34	65,845.76	-
002308	威创股份	2014年12月29日	重大事项	8.25	2015年2月4日	9.08	7,595	66,051.92	62,658.75	-
002577	雷柏科技	2014年12月26日	重大事项	27.31	2015年1月9日	26.00	2,227	64,907.93	60,819.37	-
002071	长城影视	2014年12月9日	重大事项	19.38	2015年2月16日	21.32	3,127	63,114.41	60,601.26	-
002298	鑫龙电器	2014年9月30日	重大事项	8.97	-	-	6,146	46,407.86	55,129.62	-
002411	九九久	2014年9月29日	重大事项	9.79	-	-	5,080	46,090.36	49,733.20	-
002235	安妮股份	2014年11月17日	重大事项	15.77	2015年2月16日	17.35	1,721	28,534.72	27,140.17	-

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

截至本报告期末2014年12月31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为0.00元,无质押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无质押债券。

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

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

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划分为第一层次的余额为50,894,825.26元,划分为第二层次的余额为31,970,043.67元,无划分为第三层级余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初末持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(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	52,833,684.43	93.78
	其中:股票	52,833,684.43	93.78
2	固定收益投资	31,184.50	0.06
	其中:债券	31,184.50	0.06
	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	3,449,156.99	6.12
7	其他各项资产	21,773.44	0.04
8	合计	56,335,799.36	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	767,997.31	1.40
B	采矿业	548,724.84	1.00
C	制造业	37,881,778.10	69.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	188,271.43	0.34
E	建筑业	2,123,636.27	3.88
F	批发和零售业	2,397,313.58	4.38
G	交通运输、仓储和邮政业	65,077.47	0.12
H	住宿和餐饮业	279,189.27	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,859,933.52	8.88
J	金融业	1,454,976.94	2.66
K	房地产业	786,091.01	1.44
L	租赁和商务服务业	1,025,944.47	1.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	369,264.16	0.67
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	60,601.26	0.11
S	综合	-	-
	合计	52,808,799.63	96.50

8.2.2 期末积极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	-	-
C	制造业	24,884.80	0.05
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	-	-
	合计	24,884.80	0.05

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 期末指数投资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	002024	苏宁云商	139,619	1,256,571.00	2.30
2	002415	海康威视	42,153	942,962.61	1.72
3	002450	康得新	28,292	819,619.24	1.50
4	002202	金风科技	51,218	723,710.34	1.32
5	002241	歌尔声学	28,250	692,972.50	1.27
6	002304	洋河股份	8,384	662,755.20	1.21
7	002230	科大讯飞	24,366	649,353.90	1.19
8	002594	比亚迪	15,974	609,408.10	1.11
9	002081	金螳螂	34,292	576,105.60	1.05
10	002142	宁波银行	35,623	560,349.79	1.02

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.ccfund.com.cn)的年度报告正文。

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

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	002319	乐通股份	2,416	24,884.80	0.05
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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	002024	苏宁云商	2,988,117.00	3.95
2	002415	海康威视	2,467,756.17	3.26
3	002241	歌尔声学	2,042,277.12	2.70
4	002236	大华股份	1,578,397.60	2.08
5	002594	比亚迪	1,528,916.82	2.02
6	002230	科大讯飞	1,430,046.20	1.89
7	002450	康得新	1,389,544.48	1.83
8	002353	杰瑞股份	1,386,512.08	1.83
9	002081	金螳螂	1,270,721.16	1.68
10	002304	洋河股份	1,248,631.75	1.65
11	002456	欧菲光	1,247,309.60	1.65
12	002202	金风科技