

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF） 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 30 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 30 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 31 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 31 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 33 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 34 |
| 7.6 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..... | 35 |
| 7.7 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..... | 35 |
| 7.8 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..... | 35 |
| 7.9 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..... | 35 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 35 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 35 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 36 |
| §8 基金份额持有人信息 | 37 |

| | |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 37 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 37 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 37 |
| 8.4 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..... | 38 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 38 |
| §10 重大事件揭示..... | 38 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 38 |
| 10.2 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..... | 38 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 39 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 39 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 39 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 39 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 39 |
| 10.8 其他重大事件..... | 41 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 43 |
| §12 备查文件目录..... | 43 |
| 12.1 备查文件目录..... | 43 |
| 12.2 存放地点..... | 43 |
| 12.3 查阅方式..... | 43 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|----------------------|
| 基金名称 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | 景顺长城鼎益股票（LOF） |
| 场内简称 | 景顺鼎益 |
| 基金主代码 | 162605 |
| 前端交易代码 | 162605 |
| 后端交易代码 | 162606 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2005 年 3 月 16 日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,331,619,634.22 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 | 2005-05-25 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。 |
| 投资策略 | 本基金依据以宏观经济分析模型 MEM 为基础的资产配置模型决定基金的资产配置，并运用景顺长城股票研究数据库（SRD）及 GVI 等选股模型作为行业配置和个股选择的依据。与此同时，本基金运用多因素模型等分析工具，结合基金管理人的主观判断，根据风险收益最优化的原则进行投资组合的调整。 |
| 业绩比较基准 | 富时中国 A200 指数×80%+同业存款利率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金严格控制证券市场中的非系统性风险，是风险程度适中的投资品种。 |

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 | 景顺长城基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨皞阳 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com |
| 客户服务电话 | 4008888606 | 95566 |
| 传真 | 0755-22381339 | 010-66594942 |
| 注册地址 | 深圳市福田区中心四路 1 | 北京市西城区复兴门内大街 1 |

| | | |
|-------|------------------------------|------------------|
| | 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 号 |
| 办公地址 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | 518048 | 100818 |
| 法定代表人 | 赵如冰 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -89,805,289.07 |
| 本期利润 | -208,084,892.37 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0463 |
| 本期加权平均净值利润率 | -4.61% |
| 本期基金份额净值增长率 | -4.41% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -880,074,682.33 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2032 |
| 期末基金资产净值 | 4,313,577,741.27 |
| 期末基金份额净值 | 0.996 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2014 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 294.65% |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

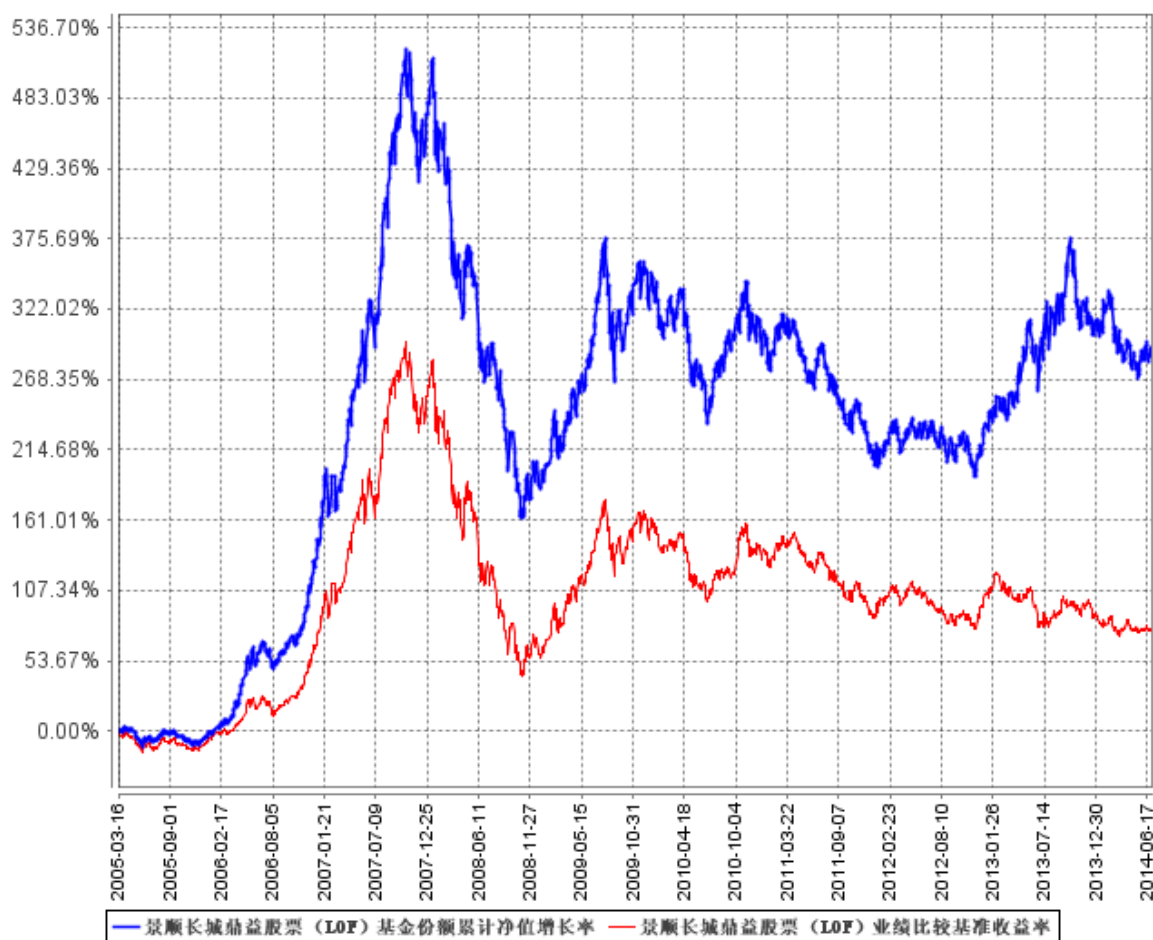
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 2.15% | 1.01% | 0.40% | 0.62% | 1.75% | 0.39% |
| 过去三个月 | 3.11% | 0.94% | 1.05% | 0.70% | 2.06% | 0.24% |
| 过去六个月 | -4.41% | 1.15% | -6.23% | 0.82% | 1.82% | 0.33% |
| 过去一年 | 4.40% | 1.44% | -2.13% | 0.93% | 6.53% | 0.51% |
| 过去三年 | 3.11% | 1.27% | -22.84% | 1.03% | 25.95% | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 294.65% | 1.49% | 78.51% | 1.44% | 216.14% | 0.05% |

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：本基金的资产配置比例为：对于股票的投资不少于基金财产的 60%；持有现金和到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2005 年 3 月 16 日合同生效日起至 2005 年 6 月 15 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

§ 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003

年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止 2014 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 33 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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 | | |
| 张继荣 | 本基金基金经理，景系列基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城动力平衡证券投资基金），景顺长城优质成长股票型证券投资基金基金经理，股票投资 | 2009 年 9 月 19 日 | - | 14 | 工学博士。曾担任大鹏证券行业分析师，融通基金研究员、研究策划部总监助理、基金经理，银华基金投资管理部策略分析师、基金经理等职务。2009 年 3 月加入本公司，自 |

| | | | | | |
|--|--------|--|--|--|--------------------|
| | 部投资副总监 | | | | 2009 年 8 月起担任基金经理。 |
|--|--------|--|--|--|--------------------|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公
司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任
后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运
作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律
法规及各项实施准则、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法
规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为
基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的
行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011
年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执
行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

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

上半年 A 股市场持续走低，1 季度下跌明显，2 季度维持低位震荡，沪深 300 指数下跌了 7.08%。
上半年行业继续分化，计算机、通信等新兴产业仍然表现较好，而煤炭、非银行金融等传统行业
表现较差。风格方面以创业板为代表的小市值成长股表现仍然较好。主题投资盛行，去 IOE 概念、
京津冀区域概念、在线教育和电动汽车概念股表现突出。

本基金上半年保持中性偏低的股票仓位，行业方面主要配置家用电器、计算机、电子元器件、
医药等行业，低配传统的周期性行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年上半年，本基金份额净值增长率为-4.41%，高于业绩比较基准收益率 1.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济的动能比较弱，PMI 和工业增加值等数据出现回落，特别是关键指标房价开始出现拐点的迹象。展望下半年，我们认为国家将持续推出“稳增长”措施，以对冲经济下行风险。而 CPI 数据将保持平稳，给宏观政策适当宽松提供较好的条件。海外经济依然强劲，这将利好国内出口相关行业。整体来看，宏观的不确定性在减弱，整体经济还将处于“下行有底、上行无力”的状态。

在下半年股市整体呈现箱体震荡的大背景下，本基金投资方面将继续保持自下而上精选个股，侧重于寻找优质成长的结构化机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期内本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 421,406,670.85 | 79,431,740.77 |
| 结算备付金 | | 20,054,945.51 | 7,839,414.85 |
| 存出保证金 | | 1,113,416.82 | 1,651,710.63 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,374,817,609.71 | 4,179,219,380.01 |
| 其中：股票投资 | | 3,274,582,609.71 | 3,880,714,380.01 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 100,235,000.00 | 298,505,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 534,403,135.90 | 599,000,348.50 |
| 应收证券清算款 | | 6,859,163.57 | 12,714,235.77 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 3,128,361.93 | 5,346,587.43 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 9,325.62 | 40,674.73 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 4,361,792,629.91 | 4,885,244,092.69 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014年6月30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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 34,290,127.61 | 31,384,747.50 |
| 应付赎回款 | | 6,250,449.78 | 4,286,957.75 |
| 应付管理人报酬 | | 5,279,750.38 | 6,182,165.09 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付托管费 | | 879,958.40 | 1,030,360.85 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,422,477.17 | 5,430,670.17 |
| 应交税费 | | 8,092.80 | 8,092.80 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 84,032.50 | 225,817.49 |
| 负债合计 | | 48,214,888.64 | 48,548,811.65 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 4,331,619,634.22 | 4,643,942,276.93 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -18,041,892.95 | 192,753,004.11 |
| 所有者权益合计 | | 4,313,577,741.27 | 4,836,695,281.04 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,361,792,629.91 | 4,885,244,092.69 |

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.996 元，基金份额总额 4,331,619,634.22 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至 2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日 |
|-----------------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | | -157,969,384.99 | 648,641,335.76 |
| 1.利息收入 | | 10,646,999.30 | 4,648,108.91 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 2,292,926.26 | 2,128,337.06 |
| 债券利息收入 | | 4,708,038.00 | 105,287.67 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 3,646,035.04 | 2,414,484.18 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -50,386,775.67 | 478,040,620.11 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -80,440,248.71 | 456,863,949.83 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 1,193,900.00 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 28,859,573.04 | 21,176,670.28 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -118,279,603.30 | 165,936,593.46 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 49,994.68 | 16,013.28 |
| 减：二、费用 | | 50,115,507.38 | 62,875,907.77 |

| | | | |
|---------------------|------------|-----------------|----------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 33,653,625.50 | 36,109,409.92 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 5,608,937.59 | 6,018,234.97 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 10,579,559.83 | 20,487,186.18 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 273,384.46 | 261,076.70 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -208,084,892.37 | 585,765,427.99 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -208,084,892.37 | 585,765,427.99 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30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） | 4,643,942,276.93 | 192,753,004.11 | 4,836,695,281.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -208,084,892.37 | -208,084,892.37 |
| 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） | -312,322,642.71 | -2,710,004.69 | -315,032,647.40 |
| 其中：1.基金申购款 | 51,421,092.44 | 1,290,041.03 | 52,711,133.47 |
| 2.基金赎回款 | -363,743,735.15 | -4,000,045.72 | -367,743,780.87 |
| 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） | 4,331,619,634.22 | -18,041,892.95 | 4,313,577,741.27 |
| 项目 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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） | 5,425,776,037.84 | -838,690,968.74 | 4,587,085,069.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净 | - | 585,765,427.99 | 585,765,427.99 |

| | | | |
|--|------------------|-----------------|------------------|
| 值变动数（本期利润） | | | |
| 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） | -283,161,045.27 | 18,308,834.66 | -264,852,210.61 |
| 其中：1.基金申购款 | 19,469,760.09 | -1,421,169.87 | 18,048,590.22 |
| 2.基金赎回款 | -302,630,805.36 | 19,730,004.53 | -282,900,800.83 |
| 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） | 5,142,614,992.57 | -234,616,706.09 | 4,907,998,286.48 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| _____ | _____ | _____ |
| 许义明 | 吴建军 | 邵媛媛 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]7 号文《关于同意景顺长城鼎益股票型开放式证券投资基金募集的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2005 年 3 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 445,627,301.07 份基金份额。本基金为契约型上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A200 指数*80%+同业存款利率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----------------|----------------|
| | 2014年6月30日 |
| 活期存款 | 421,406,670.85 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 421,406,670.85 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|---------------|------------------|------------------|----------------|------------|
| | 2014年6月30日 | | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 3,033,354,078.53 | 3,274,582,609.71 | 241,228,531.18 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | |
| | 银行间市场 | 99,824,850.00 | 100,235,000.00 | 410,150.00 |
| | 合计 | 99,824,850.00 | 100,235,000.00 | 410,150.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |
| 合计 | 3,133,178,928.53 | 3,374,817,609.71 | 241,638,681.18 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | |
|------------|----------------|-----------|
| | 2014年6月30日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 534,403,135.90 | - |
| 合计 | 534,403,135.90 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 142,911.61 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 8,128.79 |
| 应收债券利息 | 2,881,383.57 |
| 应收买入返售证券利息 | 95,486.84 |
| 应收申购款利息 | 0.22 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 450.90 |
| 合计 | 3,128,361.93 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,404,769.57 |
| 银行间市场应付交易费用 | 17,707.60 |
| 合计 | 1,422,477.17 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,579.72 |
| 预提费用 | 82,452.78 |
| 合计 | 84,032.50 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,643,942,276.93 | 4,643,942,276.93 |
| 本期申购 | 51,421,092.44 | 51,421,092.44 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -363,743,735.15 | -363,743,735.15 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 4,331,619,634.22 | 4,331,619,634.22 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|------------------|-----------------|
| 上年度末 | -850,776,045.56 | 1,043,529,049.67 | 192,753,004.11 |
| 本期利润 | -89,805,289.07 | -118,279,603.30 | -208,084,892.37 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 60,506,652.30 | -63,216,656.99 | -2,710,004.69 |
| 其中：基金申购款 | -9,724,573.47 | 11,014,614.50 | 1,290,041.03 |
| 基金赎回款 | 70,231,225.77 | -74,231,271.49 | -4,000,045.72 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -880,074,682.33 | 862,032,789.38 | -18,041,892.95 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| | 活期存款利息收入 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 116,419.17 |
| 其他 | 11,311.22 |
| 合计 | 2,292,926.26 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 3,609,387,784.77 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,689,828,033.48 |
| 买卖股票差价收入 | -80,440,248.71 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 257,175,000.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 248,806,100.00 |
| 减：应收利息总额 | 7,175,000.00 |
| 债券投资收益 | 1,193,900.00 |

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本期贵金属投资收益发生额为零。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期衍生工具收益项目发生额为零。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|---------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 28,859,573.04 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 28,859,573.04 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -118,279,603.30 |
| ——股票投资 | -118,636,553.30 |
| ——债券投资 | 356,950.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |

| | |
|---------|-----------------|
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -118,279,603.30 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 49,994.68 |
| 合计 | 49,994.68 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 10,579,284.83 |
| 银行间市场交易费用 | 275.00 |
| 合计 | 10,579,559.83 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 债券托管账户维护费 | 9,326.92 |
| 上市月费 | 29,752.78 |
| 银行划款手续费 | 26,031.68 |
| 合计 | 273,384.46 |

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

于 2014 年上半年，并无对本基金存在控制关系或重大影响关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|--------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人、基金发起人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券有限责任公司（“长城证券”） | 基金管理人股东、基金销售机构 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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 | 779,168,340.71 | 11.44% | 1,898,755,302.35 | 14.20% |

6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------------------|---------------------------------|----------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比 例 |
| 长城证券 | 4,122,400,000.00 | 43.61% | - | - |

6.4.10.1.3 权证交易

本基金于本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.4 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6月30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 | 709,355.45 | 11.44% | 234,526.01 | 16.69% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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 | 1,718,771.25 | 14.22% | 1,376,719.71 | 25.69% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------------|---------------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 33,653,625.50 | 36,109,409.92 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,302,576.53 | 7,859,302.36 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2014年1月1日至2014年6月30日 | 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,608,937.59 | 6,018,234.97 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间与关联方未进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 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6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 421,406,670.85 | 2,165,195.87 | 339,518,629.42 | 2,023,494.76 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603168 | 莎普爱思 | 2014 年 6 月 24 日 | 2014 年 7 月 2 日 | 新股流通受限 | 21.85 | 21.85 | 6,056 | 132,323.60 | 132,323.60 | - |
| 002727 | 一心堂 | 2014 年 6 月 25 日 | 2014 年 7 月 2 日 | 新股流通受限 | 12.20 | 12.20 | 8,968 | 109,409.60 | 109,409.60 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

为有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末及上年度末，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险，并由独立于投资部门的风险管理人员设定流动性风险控制指标，并进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易。除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金管理人每日预测本基金申购赎回情况以控制基金发生大幅申购赎回的风险。而且，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的组合资产损失或收益变动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2014年6月30 日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|-------|-------|--------|------|------|-----|----|
| 资产 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------------------------|------------------|--------|----------------|-------|-------|-------------------|------------------|
| 银行存款 | 421,406,670.85 | - | - | - | - | - | 421,406,670.85 |
| 结算备付金 | 20,054,945.51 | - | - | - | - | - | 20,054,945.51 |
| 存出保证金 | 1,113,416.82 | - | - | - | - | - | 1,113,416.82 |
| 交易性金融资产 | 49,995,000.00 | - | 50,240,000.00 | - | - | -3,274,582,609.71 | 3,374,817,609.71 |
| 买入返售金融资产 | 534,403,135.90 | - | - | - | - | - | 534,403,135.90 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 6,859,163.57 | 6,859,163.57 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 3,128,361.93 | 3,128,361.93 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 9,325.62 | 9,325.62 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,026,973,169.08 | - | 50,240,000.00 | - | - | -3,284,579,460.83 | 4,361,792,629.91 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 34,290,127.61 | 34,290,127.61 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 6,250,449.78 | 6,250,449.78 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 5,279,750.38 | 5,279,750.38 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 879,958.40 | 879,958.40 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,422,477.17 | 1,422,477.17 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 8,092.80 | 8,092.80 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 84,032.50 | 84,032.50 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 48,214,888.64 | 48,214,888.64 |
| 利率敏感度缺口 | 1,026,973,169.08 | - | 50,240,000.00 | - | - | - | - |
| 上年度末 2013 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 79,431,740.77 | - | - | - | - | - | 79,431,740.77 |
| 结算备付金 | 7,839,414.85 | - | - | - | - | - | 7,839,414.85 |
| 存出保证金 | 1,651,710.63 | - | - | - | - | - | 1,651,710.63 |
| 交易性金融资产 | - | - | 298,505,000.00 | - | - | -3,880,714,380.01 | 4,179,219,380.01 |
| 买入返售金融资产 | 599,000,348.50 | - | - | - | - | - | 599,000,348.50 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 12,714,235.77 | 12,714,235.77 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 5,346,587.43 | 5,346,587.43 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 40,674.73 | 40,674.73 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 687,923,214.75 | - | 298,505,000.00 | - | - | -3,898,815,877.94 | 4,485,244,092.69 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 31,384,747.50 | 31,384,747.50 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 4,286,957.75 | 4,286,957.75 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 6,182,165.09 | 6,182,165.09 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,030,360.85 | 1,030,360.85 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 5,430,670.17 | 5,430,670.17 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 8,092.80 | 8,092.80 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 225,817.49 | 225,817.49 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|-----------------|---|---|---------------|---------------|
| 负债总计 | - | - | - | - | 48,548,811.65 | 48,548,811.65 |
| 利率敏感度缺口 | 687,923,214.75 | -298,505,000.00 | - | - | - | - |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|---------------------------------|-------------------|
| 假设 | 在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2014年6月30日） | 上年度末（2013年12月31日） |
| | 市场利率上升25个基点 | -92,674.33 | -288,927.74 |
| | 市场利率下降25个基点 | 92,981.75 | 289,762.78 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资不少于基金总资产的60%；持有现金和到期在1年以内政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。于2014年6月30日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年6月30日 | | 上年度末 2013年12月31日 | |
|---------------|-------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 3,274,582,609.71 | 75.91 | 3,880,714,380.01 | 80.23 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 100,235,000.00 | 2.32 | 298,505,000.00 | 6.17 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----|------------------|-------|------------------|-------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 3,374,817,609.71 | 78.24 | 4,179,219,380.01 | 86.41 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|-----------------|---|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2014年6月30日） | 上年度末（2013年12月31日） |
| | 沪深300指数×80%上升5% | 198,424,576.10 | 229,743,025.85 |
| 沪深300指数×80%下降5% | -198,424,576.10 | -229,743,025.85 | |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于2014年8月22日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 3,274,582,609.71 | 75.07 |
| | 其中：股票 | 3,274,582,609.71 | 75.07 |
| 2 | 固定收益投资 | 100,235,000.00 | 2.30 |
| | 其中：债券 | 100,235,000.00 | 2.30 |
| | 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 | 534,403,135.90 | 12.25 |
| | 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 | 441,461,616.36 | 10.12 |
| 7 | 其他各项资产 | 11,110,267.94 | 0.25 |
| 8 | 合计 | 4,361,792,629.91 | 100.00 |

7.2 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,885,493,612.49 | 43.71 |
| 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 | 109,409.60 | 0.00 |
| 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 | 635,416,574.12 | 14.73 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 220,307,706.68 | 5.11 |
| L | 租赁和商务服务业 | 307,434,786.38 | 7.13 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 132,307,812.00 | 3.07 |
| 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 | 93,512,708.44 | 2.17 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,274,582,609.71 | 75.91 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 000333 | 美的集团 | 10,235,513 | 197,750,111.16 | 4.58 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 5,771,419 | 169,968,289.55 | 3.94 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 3 | 002415 | 海康威视 | 9,439,913 | 159,912,126.22 | 3.71 |
| 4 | 300020 | 银江股份 | 4,904,271 | 150,070,692.60 | 3.48 |
| 5 | 300058 | 蓝色光标 | 5,519,658 | 146,491,723.32 | 3.40 |
| 6 | 300070 | 碧水源 | 4,523,344 | 132,307,812.00 | 3.07 |
| 7 | 002456 | 欧菲光 | 5,600,000 | 120,008,000.00 | 2.78 |
| 8 | 300075 | 数字政通 | 3,552,455 | 114,850,870.15 | 2.66 |
| 9 | 300168 | 万达信息 | 6,164,606 | 113,120,520.10 | 2.62 |
| 10 | 300017 | 网宿科技 | 1,721,365 | 109,823,087.00 | 2.55 |
| 11 | 300303 | 聚飞光电 | 5,550,036 | 102,065,162.04 | 2.37 |
| 12 | 300212 | 易华录 | 3,227,067 | 101,071,738.44 | 2.34 |
| 13 | 002400 | 省广股份 | 4,013,957 | 98,663,063.06 | 2.29 |
| 14 | 300147 | 香雪制药 | 3,486,176 | 94,126,752.00 | 2.18 |
| 15 | 000541 | 佛山照明 | 9,328,356 | 92,910,425.76 | 2.15 |
| 16 | 000002 | 万科A | 10,775,149 | 89,110,482.23 | 2.07 |
| 17 | 300043 | 互动娱乐 | 4,701,772 | 87,170,852.88 | 2.02 |
| 18 | 600196 | 复星医药 | 4,039,234 | 81,552,134.46 | 1.89 |
| 19 | 600872 | 中炬高新 | 7,181,471 | 76,626,295.57 | 1.78 |
| 20 | 002475 | 立讯精密 | 2,089,082 | 68,480,107.96 | 1.59 |
| 21 | 300026 | 红日药业 | 2,242,806 | 65,714,215.80 | 1.52 |
| 22 | 600703 | 三安光电 | 2,781,356 | 65,167,171.08 | 1.51 |
| 23 | 600340 | 华夏幸福 | 2,587,285 | 65,121,963.45 | 1.51 |
| 24 | 600373 | 中文传媒 | 4,610,484 | 64,546,776.00 | 1.50 |
| 25 | 300071 | 华谊嘉信 | 4,000,000 | 62,280,000.00 | 1.44 |
| 26 | 601877 | 正泰电器 | 2,741,121 | 60,057,961.11 | 1.39 |
| 27 | 002104 | 恒宝股份 | 2,922,058 | 57,272,336.80 | 1.33 |
| 28 | 600594 | 益佰制药 | 1,331,760 | 54,775,288.80 | 1.27 |
| 29 | 601515 | 东风股份 | 4,572,210 | 54,317,854.80 | 1.26 |
| 30 | 600690 | 青岛海尔 | 3,579,220 | 52,829,287.20 | 1.22 |
| 31 | 002368 | 太极股份 | 1,387,867 | 46,479,665.83 | 1.08 |
| 32 | 000402 | 金融街 | 8,363,694 | 45,582,132.30 | 1.06 |
| 33 | 002555 | 顺荣股份 | 945,522 | 44,515,175.76 | 1.03 |
| 34 | 600352 | 浙江龙盛 | 2,200,037 | 35,530,597.55 | 0.82 |
| 35 | 300083 | 劲胜精密 | 1,363,257 | 29,528,146.62 | 0.68 |
| 36 | 601098 | 中南传媒 | 2,005,951 | 28,965,932.44 | 0.67 |
| 37 | 600525 | 长园集团 | 2,195,367 | 24,236,851.68 | 0.56 |
| 38 | 002236 | 大华股份 | 891,184 | 24,017,408.80 | 0.56 |
| 39 | 002219 | 恒康医疗 | 1,057,129 | 23,235,695.42 | 0.54 |
| 40 | 600566 | 洪城股份 | 958,014 | 22,130,123.40 | 0.51 |
| 41 | 600885 | 宏发股份 | 966,313 | 21,229,896.61 | 0.49 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 42 | 002305 | 南国置业 | 3,387,294 | 20,493,128.70 | 0.48 |
| 43 | 002726 | 龙大肉食 | 8,771 | 149,633.26 | 0.00 |
| 44 | 603168 | 莎普爱思 | 6,056 | 132,323.60 | 0.00 |
| 45 | 002727 | 一心堂 | 8,968 | 109,409.60 | 0.00 |
| 46 | 002497 | 雅化集团 | 5,690 | 56,331.00 | 0.00 |
| 47 | 603006 | N 联明 | 1,892 | 27,055.60 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 300017 | 网宿科技 | 225,781,388.14 | 4.67 |
| 2 | 300020 | 银江股份 | 126,946,065.52 | 2.62 |
| 3 | 300212 | 易华录 | 117,731,029.03 | 2.43 |
| 4 | 600703 | 三安光电 | 115,253,554.48 | 2.38 |
| 5 | 002038 | 双鹭药业 | 114,008,956.03 | 2.36 |
| 6 | 000541 | 佛山照明 | 98,860,091.14 | 2.04 |
| 7 | 002400 | 省广股份 | 98,840,836.61 | 2.04 |
| 8 | 600196 | 复星医药 | 94,776,835.79 | 1.96 |
| 9 | 002594 | 比亚迪 | 91,939,533.62 | 1.90 |
| 10 | 000002 | 万科A | 89,964,907.47 | 1.86 |
| 11 | 300147 | 香雪制药 | 89,824,429.86 | 1.86 |
| 12 | 300043 | 互动娱乐 | 86,717,713.50 | 1.79 |
| 13 | 600872 | 中炬高新 | 85,102,214.91 | 1.76 |
| 14 | 600557 | 康缘药业 | 79,166,328.94 | 1.64 |
| 15 | 000413 | 东旭光电 | 78,392,233.73 | 1.62 |
| 16 | 000851 | 高鸿股份 | 75,770,190.65 | 1.57 |
| 17 | 600690 | 青岛海尔 | 74,204,201.65 | 1.53 |
| 18 | 600166 | 福田汽车 | 72,907,201.00 | 1.51 |
| 19 | 002104 | 恒宝股份 | 72,609,274.38 | 1.50 |
| 20 | 600340 | 华夏幸福 | 68,650,385.68 | 1.42 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 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 | 300002 | 神州泰岳 | 200,669,955.09 | 4.15 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 156,805,993.86 | 3.24 |
| 3 | 300017 | 网宿科技 | 146,153,315.05 | 3.02 |
| 4 | 000625 | 长安汽车 | 144,292,703.02 | 2.98 |
| 5 | 002570 | 贝因美 | 135,007,542.57 | 2.79 |
| 6 | 002038 | 双鹭药业 | 131,504,914.50 | 2.72 |
| 7 | 000671 | 阳光城 | 129,561,543.24 | 2.68 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 113,650,635.30 | 2.35 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 108,413,566.93 | 2.24 |
| 10 | 300026 | 红日药业 | 104,759,417.93 | 2.17 |
| 11 | 002305 | 南国置业 | 98,058,939.65 | 2.03 |
| 12 | 002701 | 奥瑞金 | 92,051,337.11 | 1.90 |
| 13 | 000413 | 东旭光电 | 81,511,946.61 | 1.69 |
| 14 | 600718 | 东软集团 | 80,438,349.54 | 1.66 |
| 15 | 002594 | 比亚迪 | 79,835,328.70 | 1.65 |
| 16 | 600079 | 人福医药 | 78,815,637.33 | 1.63 |
| 17 | 600518 | 康美药业 | 68,006,909.37 | 1.41 |
| 18 | 600166 | 福田汽车 | 66,848,039.07 | 1.38 |
| 19 | 600557 | 康缘药业 | 66,413,524.33 | 1.37 |
| 20 | 002450 | 康得新 | 65,866,573.21 | 1.36 |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 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 | 3,202,332,816.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,609,387,784.77 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 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 | 100,235,000.00 | 2.32 |
| | 其中：政策性金融债 | 100,235,000.00 | 2.32 |

| | | | |
|---|---------|----------------|------|
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 100,235,000.00 | 2.32 |

7.6 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 | 140404 | 14 农发 04 | 500,000 | 50,240,000.00 | 1.16 |
| 2 | 130314 | 13 进出 14 | 500,000 | 49,995,000.00 | 1.16 |

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

1、银江股份有限公司（下称“银江股份”，股票代码：300020）于2013年11月8日收到浙江证监局对其下达的《关于对银江股份有限公司采取责令整改措施的决定》，决定书称浙江证监局在对该公司进行现场检查时发现其在信息披露和财务会计方面存在问题，并责令其进行改正。

2013年11月13日银江股份召开了第二届董事会第三十一次会议和第二届监事会第三十次会议，审议通过了《关于浙江证监局对公司采取责令改正措施决定的整改报告的议案》，并于2013年11月14日披露了《关于浙江证监局对公司采取责令改正措施决定的整改报告》。整改报告针对浙江证监局提出的信息披露和财务会计方面的问题一一提出了整改措施。

本基金投研人员分析认为，该事件确实反映了银江股份信息披露、收入成本核算方面存在问题，关联交易累计收到金额和累计支出金额分别占银江股份2012年营业收入的3.16%、4.36%，累计占用资金占2012年底货币资金为0.21%，收入和成本不准确对2012年净利润的影响为0.74%，对银江股份目前的生产经营尚不构成实质性影响，不会对银江股份的价值判断发生重大影响。

本基金投研人员认为，银江股份进行的一系列整改措施有利于完善公司治理和促进公司长期健康发展。考虑到其业绩增长较快，估值合理，维持“持有”评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对银江股份进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,113,416.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,859,163.57 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,128,361.93 |
| 5 | 应收申购款 | 9,325.62 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|---------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,110,267.94 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 220,183 | 19,672.82 | 7,951,944.27 | 0.18% | 4,323,667,689.95 | 99.82% |

8.2 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 | 张同燕 | 501,595.00 | 0.63% |
| 2 | 张萍 | 500,747.00 | 0.63% |
| 3 | 李喜仪 | 460,000.00 | 0.58% |
| 4 | 张爱招 | 415,100.00 | 0.52% |
| 5 | 牟德武 | 387,465.00 | 0.49% |
| 6 | 郭文飞 | 376,691.00 | 0.47% |
| 7 | 王华安 | 367,946.00 | 0.46% |
| 8 | 关少兰 | 317,200.00 | 0.40% |
| 9 | 张燕 | 294,044.00 | 0.37% |
| 10 | 叶郁菀 | 278,000.00 | 0.35% |

注：持有人为场内持有人。

8.3 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 | 2,521.45 | 0.00% |
|------------------|----------|-------|

8.4 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

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2005年3月16日）基金份额总额 | 445,627,301.07 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,643,942,276.93 |
| 本报告期基金总申购份额 | 51,421,092.44 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 363,743,735.15 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,331,619,634.22 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

1、本基金管理人于2014年2月14日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任王鹏辉先生担任本公司副总经理，并向中国证券投资基金业协会备案。

2、本基金管理人于2014年3月28日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意邓体顺先生辞去本公司副总经理一职。

3、本基金管理人于2014年7月9日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任周伟达先生担任本公司副总经理，并向中国证券投资基金业协会备案。

以上有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

4、2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任中国银行行长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 长江证券股份有限公司 | 1 | 2,281,717,678.03 | 33.50% | 2,077,280.25 | 33.50% | - |
| 海通证券股份有限公司 | 2 | 902,218,295.66 | 13.25% | 821,381.26 | 13.25% | - |
| 长城证券有限责任公司 | 3 | 779,168,340.71 | 11.44% | 709,355.45 | 11.44% | - |
| 中国国际金融有限公司 | 1 | 658,182,050.25 | 9.66% | 599,207.95 | 9.66% | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | 451,296,130.53 | 6.63% | 410,858.30 | 6.63% | - |
| 宏源证券股份有限公司 | 1 | 389,419,028.84 | 5.72% | 354,529.49 | 5.72% | - |
| 招商证券股份有限公司 | 2 | 346,284,778.12 | 5.08% | 315,256.94 | 5.08% | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|----------------|-------|------------|-------|----|
| 有限公司 | | | | | | |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | 321,137,929.81 | 4.71% | 292,364.87 | 4.71% | - |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | 267,753,600.95 | 3.93% | 243,762.87 | 3.93% | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | 227,794,418.10 | 3.34% | 207,384.24 | 3.34% | - |
| 平安证券有限责任公司 | 1 | 186,401,961.40 | 2.74% | 169,699.25 | 2.74% | 新增 |
| 英大证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | 已退 |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 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 |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------------|---|---|-------------------|--------|---|---|
| 长江证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份 有限公司 | - | - | -2,380,000,000.00 | 25.18% | - | - |
| 长城证券有限 责任公司 | - | - | -4,122,400,000.00 | 43.61% | - | - |
| 中国国际金融 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份 有限公司 | - | - | -1,250,000,000.00 | 13.22% | - | - |
| 宏源证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券有限 责任公司 | - | - | -1,700,000,000.00 | 17.98% | - | - |
| 英大证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券有限 公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-----------------------------|-----------------|
| 1 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2013 年第 4 季度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 1 月 20 日 |
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 1 月 29 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-----------------|
| | 情况的公告 | | |
| 3 | 景顺长城基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 2 月 14 日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券手机客户端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 3 月 14 日 |
| 5 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2013 年年度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 3 月 26 日 |
| 6 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2013 年年度报告摘要 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 3 月 26 日 |
| 7 | 景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 3 月 28 日 |
| 8 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2014 年第 1 季度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 4 月 22 日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中金公司基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 4 月 23 日 |
| 10 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2014 年第 1 号更新招募说明书 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 4 月 30 日 |
| 11 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2014 年第 1 号更新招募说明书摘要 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2014 年 4 月 30 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2014年8月25日