诺安股票证券投资基金
2014年半年度报告

2014年6月30日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2014年8月26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 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.....9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....9
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的真实、准确和完整发表意见.....12
§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.....31
7.1 期末基金资产组合情况.....31
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.....32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....39
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.....39
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.....39
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.....39
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.....39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....40
7.12 投资组合报告附注.....40
§8 基金份额持有人信息.....41

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 41
8.3 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 41
§9 开放式基金份额变动 41
§10 重大事件揭示 42
10.1 基金份额持有人大会决议 42
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 42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 42
10.4 基金投资策略的改变 42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 42
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 42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 42
10.8 其他重大事件 45
§11 备查文件目录 47
11.1 备查文件目录 47
11.2 存放地点 48
11.3 查阅方式 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安股票证券投资基金
基金简称	诺安股票
基金主代码	320003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 12 月 19 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
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	12,462,900,917.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以中国企业的比较优势和全球化发展为视角,发掘最具投资价值的企业,获得稳定的中长期资本投资收益。在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在承担和控制市场风险的情况下,取得稳定的、优于业绩基准的中长期投资回报。
投资策略	本基金实施积极的投资策略。在资产类别配置层面,本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动,动态调整股票资产的配置比例;在此基础上本基金注重有中国比较优势和有国际化发展基础的优势行业的研究和投资;在个股选择层面,本基金通过对上市公司主营业务盈利能力和持续性的定量分析,挖掘具有中长期投资价值的股票;在债券投资方面,本基金将运用多种投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	80%×富时 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数
风险收益特征	本基金属于中高风险的股票型基金,通过合理的资产配置和投资组合的建立,有效地规避风险并相应地获得较高的投资收益。

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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	秦维舟	姜建清

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.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦 19-20 层

§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	-467,583,044.57
本期利润	275,064,172.89
加权平均基金份额本期利润	0.0213
本期加权平均净值利润率	2.50%
本期基金份额净值增长率	2.55%
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	-4,129,858,287.92
期末可供分配基金份额利润	-0.3314
期末基金资产净值	10,937,747,970.87
期末基金份额净值	0.8776
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	231.17%

注:①上述基金业绩指标不包括持有人申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。

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分期末余额的孰

低数。

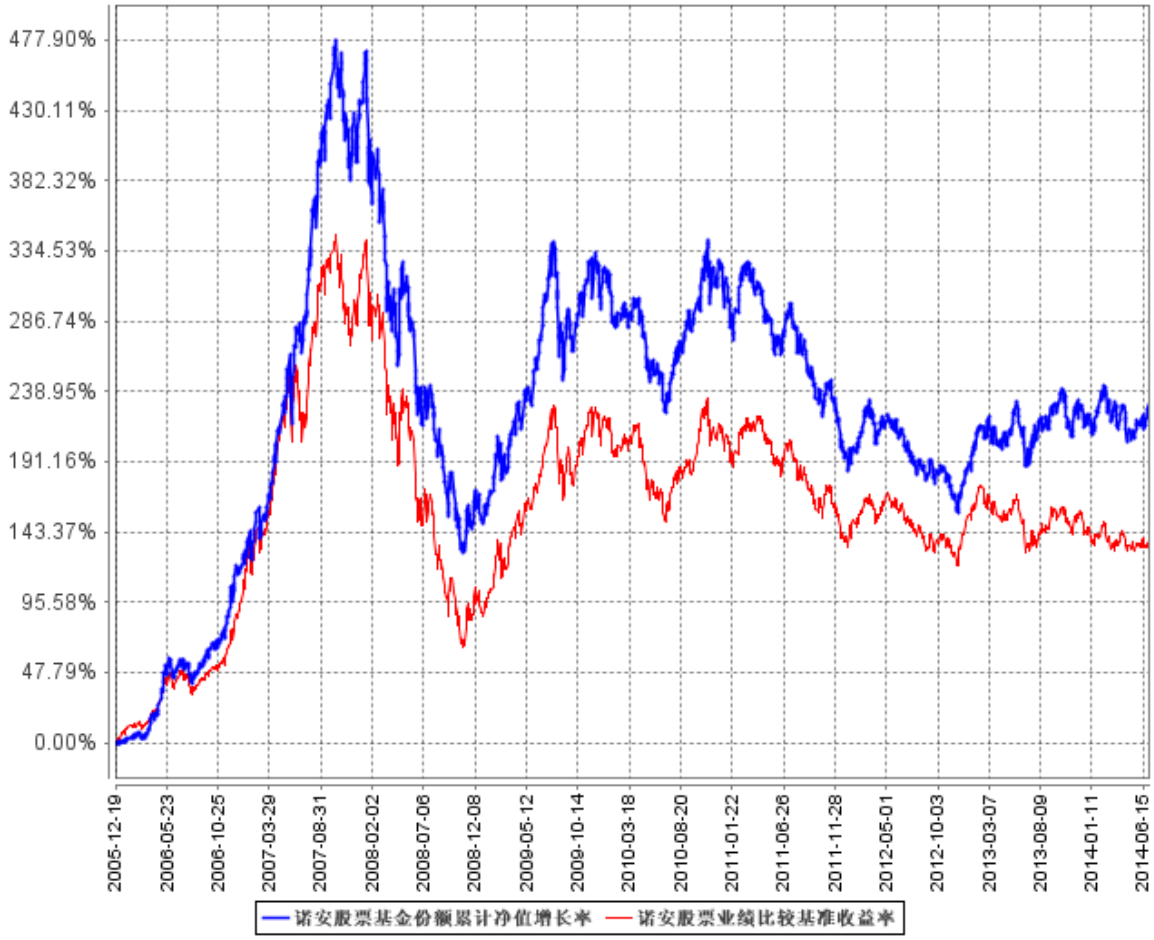
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	4.35%	0.79%	0.66%	0.63%	3.69%	0.16%
过去三个月	5.75%	0.88%	1.22%	0.70%	4.53%	0.18%
过去六个月	2.55%	1.04%	-3.99%	0.84%	6.54%	0.20%
过去一年	14.63%	1.09%	1.73%	0.94%	12.90%	0.15%
过去三年	-12.92%	1.07%	-20.18%	1.04%	7.26%	0.03%
自基金合同生效起至今	231.17%	1.49%	136.73%	1.49%	94.44%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：80%×富时中国 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数。

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：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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

截至 2014 年 6 月，本基金管理人共管理 34 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安理财宝货币市场基金。

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		
杨谷	副总经理、投资总监、 诺安股票证券投资基金基金经理、诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理、	2006 年 6 月 22 日	-	16	经济学硕士,CFA,具有基金从业资格。曾任职于平安证券公司综合研究所、西北证券公司资产管理部;2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监。曾

	诺安多策略股票型证券投资基金基金经理				于 2006 年 11 月至 2007 年 11 月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2006 年 2 月起任诺安股票证券投资基金基金经理,2010 年 9 月起任诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理,2013 年 4 月起任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。
邹翔	成长基金组投资总监兼价值基金组投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理	2010 年 10 月 14 日	-	21	经济学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于中信实业银行、华夏证券有限公司、华夏基金管理有限公司、大通证券有限公司、中国国际金融有限公司、诺德基金管理有限公司、申万巴黎基金管理有限公司。邹翔先生曾于 1999 年 7 月至 2000 年 6 月任兴和证券投资基金基金经理、2000 年 7 月至 2001 年 11 月任兴安证券投资基金基金经理、2007 年 4 月至 2008 年 5 月任诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理。2010 年 3 月加入诺安基金管理有限公司,现任公司成长基金组投资总监兼价值基金组投资总监。于 2010 年 10 月起任诺安股票证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

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》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安股票证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安股票证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级

市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、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。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合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不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况。

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

2014 年上半年市场经历了冲高—回落—震荡的过程。经济的持续下滑与政策维稳的博弈是导致市场弱势的根本原因，期间，部分品种和部分板块有一定的表现，但总体看，下跌是上半年的主流趋势。在此情况下，我们主要降低了仓位，并抓住了一些行业景气度持续走强的信息服务业加强了配置。2014 年上半年，沪深 300 指数下跌-7.80%，诺安股票基金净值上涨 2.55%，本基金

跑赢市场基准指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 0.8776 元。本报告期基金份额净值增长率为 2.55%,同期业绩比较基准收益率为-3.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年，在内外多重利空的交织下，A 股市场走出了横盘震荡的走势。

外围市场上半年在怀疑中持续上涨。欧洲将利率降低到负值，美国市场的周期股炒作开始升温，伊拉克恐怖主义已经演绎为建国力量，国际油价开始迭创新高，尽管 QE 退出扰动市场，但道琼斯指数再度创历史新高，我们坚持认为，发达国家经济体增长持续恢复显然是稳固的，且可持续的，但大国博弈以及与此导致的资本流、信息流的冲击，对资本市场的扰动也是显著的。这点，对新兴市场的影响力尤甚。从南美到中东，再从中东到中亚，风险事件频频释放，新兴市场在这轮危机后的复苏，目前看仍然遥遥无期。

国内经济数据有企稳迹象但仍然疲弱，对冲下滑的稳增长政策在上半年有所发力。6 月 PMI 继续略有回升，稳增长政策似乎起了作用。上半年的焦点事件是担心房价崩溃的恐慌性影响，背后实则是反腐败是否会导致既得利益伤筋痛骨的问题。但我们始终认为，没有危机的倒逼，改革大门无法顺利开启，这轮经济下滑的根源是经济要素效率低下的问题，在不解决效率提升的问题之前，放松带来的只会是恶果而不是成果。当然，在危机爆发之前，防范危机恐怕是影响指数的最重要的因素。

估值方面看，截止 6 月 30 日，沪深 300 的 PE 估值（TTM）为 9.03 倍（PE 历史最低估值 9.9 倍），PB 估值为 1.47 倍（PB 历史最低估值为 1.50 倍），剔除银行股的估值为 16 倍左右，相比较历史估值，全市场估值仍处在最底部的位置。

综合国内外形势，我们认为：对可持续增长的担忧是压制市场的关键因素，短期难以消除，指数级别的行情仍然难以期待，但下半年市场将出现更多结构性机会，寻找增长可持续且中报优秀的品种进行布局将是本基金投资重点所在。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人

完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本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务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约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

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下；本基金每年收益分配次数最少一次，最多为六次；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

§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，本基金托管人在对诺安股票证券投资基金的托管过程中，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，诺安股票证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安股票证券投资基金的投资运作、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，诺安股票证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安股票证券投资基金 2014 年半年度

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安股票证券投资基金
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	2,480,523,617.24	1,015,593,829.04
结算备付金		8,813,091.14	20,019,716.89
存出保证金		2,734,940.76	3,664,227.31
交易性金融资产	6.4.7.2	8,134,087,574.37	9,345,292,290.96
其中：股票投资		8,134,087,574.37	9,343,662,090.96
基金投资		-	-
债券投资		-	1,630,200.00
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	348,940,914.41	599,952,249.98
应收证券清算款		-	508,108,022.19
应收利息	6.4.7.5	3,213,449.01	305,371.46
应收股利		-	-
应收申购款		22,684.66	3,113,933.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,978,336,271.59	11,496,049,641.41
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		5,933,743.14	33,371,387.24
应付赎回款		13,856,866.43	10,456,869.13
应付管理人报酬		13,103,106.36	14,671,916.91
应付托管费		2,183,851.08	2,445,319.49

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,294,385.45	6,342,489.23
应交税费		25,000.00	25,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	191,348.26	141,274.61
负债合计		40,588,300.72	67,454,256.61
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,462,900,917.03	13,354,695,636.69
未分配利润	6.4.7.10	-1,525,152,946.16	-1,926,100,251.89
所有者权益合计		10,937,747,970.87	11,428,595,384.80
负债和所有者权益总计		10,978,336,271.59	11,496,049,641.41

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8776 元，基金份额总 12,462,900,917.03 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安股票证券投资基金

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		390,672,912.33	237,483,525.83
1.利息收入		19,142,947.55	18,879,534.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,442,777.01	9,756,989.55
债券利息收入		1,492.52	60,947.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,698,678.02	9,061,597.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-371,161,778.00	447,985,188.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-412,478,195.88	375,755,124.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	21,811.40	1,846,427.97
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	41,294,606.48	70,383,635.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	742,647,217.46	-229,438,253.19
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	44,525.32	57,055.70
减：二、费用		115,608,739.44	136,350,683.88
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	81,879,210.82	87,961,502.73

2．托管费	6.4.10.2.2	13,646,535.18	14,660,250.46
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	19,880,774.48	33,518,329.51
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	202,218.96	210,601.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		275,064,172.89	101,132,841.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		275,064,172.89	101,132,841.95

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安股票证券投资基金

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）	13,354,695,636.69	-1,926,100,251.89	11,428,595,384.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	275,064,172.89	275,064,172.89
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）	-891,794,719.66	125,883,132.84	-765,911,586.82
其中：1.基金申购款	40,019,926.05	-5,944,368.83	34,075,557.22
2.基金赎回款	-931,814,645.71	131,827,501.67	-799,987,144.04
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）	12,462,900,917.03	-1,525,152,946.16	10,937,747,970.87
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）	14,777,578,763.67	-3,525,377,334.29	11,252,201,429.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101,132,841.95	101,132,841.95
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）	-671,873,527.65	117,463,900.73	-554,409,626.92
其中：1.基金申购款	54,499,804.43	-9,884,204.63	44,615,599.80
2.基金赎回款	-726,373,332.08	127,348,105.36	-599,025,226.72
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）	14,105,705,236.02	-3,306,780,591.61	10,798,924,644.41

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：

奥成文	薛有为	薛有为
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

诺安股票证券投资基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监基金字[2005]154 号文《关于同意诺安股票证券投资基金设立的批复》批准,于 2005 年 11 月 3 日至 2005 年 12 月 13 日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,共募集资金人民币 379,115,510.80 元,折合 379,115,510.80 份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币 85,441.25 元,其中在基金设立募集期产生的利息为人民币 61,905.56 元,折合 61,905.56 份基金份额,其余利息为人民币 23,535.69 元于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为 2005 年 12 月 19 日,合同生效日基金份额为 379,177,416.36 份基金单位。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安股票证券投资基金基金合同》、《诺安股票证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于 2014 年 8 月 21 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，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，不缴纳营业税。

(2)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，暂不缴纳企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(5)对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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	2,000,523,617.24
定期存款	480,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,480,523,617.24

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		7,022,322,461.48	8,134,087,574.37	1,111,765,112.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,022,322,461.48	8,134,087,574.37	1,111,765,112.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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
交易所市场	-	-
银行间市场	348,940,914.41	-
合计	348,940,914.41	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告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	343,558.95
应收定期存款利息	2,801,166.83
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,569.31
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	64,046.20
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,107.72
合计	3,213,449.01

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	5,292,257.43
银行间市场应付交易费用	2,128.02
合计	5,294,385.45

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	2,909.16
预提费用	188,439.10
合计	191,348.26

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	13,354,695,636.69	13,354,695,636.69
本期申购	40,019,926.05	40,019,926.05
本期赎回(以"-"号填列)	-931,814,645.71	-931,814,645.71
本期末	12,462,900,917.03	12,462,900,917.03

注：本期申购含转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（金）额。

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	-3,955,625,601.13	2,029,525,349.24	-1,926,100,251.89
本期利润	-467,583,044.57	742,647,217.46	275,064,172.89
本期基金份额交易产生的变动数	293,350,357.78	-167,467,224.94	125,883,132.84
其中：基金申购款	-13,109,495.26	7,165,126.43	-5,944,368.83
基金赎回款	306,459,853.04	-174,632,351.37	131,827,501.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,129,858,287.92	2,604,705,341.76	-1,525,152,946.16

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	9,500,937.66
定期存款利息收入	2,801,166.83
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	114,737.87
其他	25,934.65
合计	12,442,777.01

注：本报告期内“其他”为申购款利息收入及保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,034,769,874.82

减：卖出股票成本总额	7,447,248,070.70
买卖股票差价收入	-412,478,195.88

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	1,544,370.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,520,000.00
减：应收利息总额	2,558.60
债券投资收益	21,811.40

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	41,294,606.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	41,294,606.48

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	742,647,217.46
——股票投资	742,757,417.46
——债券投资	-110,200.00
——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	742,647,217.46

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	44,192.84
基金转换费收入	332.48
合计	44,525.32

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	19,880,774.48
银行间市场交易费用	-
合计	19,880,774.48

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	39,671.58
信息披露费	148,767.52
汇划费	4,779.86
账户维护费	9,000.00
合计	202,218.96

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要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

本基金本报告期不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。

6.4.9.2 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
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构

注：下述关联方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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内不存在应支付关联方的佣金。

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	81,879,210.82	87,961,502.73
其中：支付销售机构的客户维护费	13,997,338.56	15,288,140.80

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提，管理费的计算方法如下：

H=E×1.5%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.10.2.2 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托管费	13,646,535.18	14,660,250.46

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

H=E×0.25%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间内无与关联方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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告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。

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
中国工商银行股份有限公司	2,000,523,617.24	9,500,937.66	2,502,878,216.07	9,522,862.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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
300386	飞天诚信	2014 年 6 月 20 日	2014 年 6 月 26 日	新股流通受限	33.13	57.73	140,850	4,666,360.50	8,131,270.50	-
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	22,420	273,524.00	273,524.00	-
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	9,892	216,140.20	216,140.20	-

6.4.12.2 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
300050	世纪鼎利	2014 年 5 月 30 日	重大资产重组	17.78	2014 年 7 月 30 日	19.56	5,930,566	90,667,334.04	105,445,463.48	-
000948	南天信息	2014 年 5 月 12 日	重大资产重组	7.88	2014 年 8 月 8 日	8.67	12,045,771	103,633,082.38	94,920,675.48	-
000009	中国宝安	2014 年 5 月 28 日	重大资产重组	10.21	2014 年 8 月 15 日	11.23	4,999,880	55,524,583.77	51,048,774.80	-
000562	宏源证券	2013 年 10 月 31 日	重大资产重组	8.22	2014 年 7 月 28 日	8.93	1,000,000	10,617,532.41	8,220,000.00	-
600637	百视通	2014 年 5 月 29 日	重大资产重组	32.03	-	-	30,000	1,031,551.85	960,900.00	-
600418	江淮汽车	2014 年 4 月 14 日	重大资产重组	10.24	2014 年 7 月 11 日	11.22	89,800	944,713.00	919,552.00	-

注：江淮汽车（600418）自 2014 年 4 月 28 日起，采用指数收益法进行估值，详见相关公告。

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 2014 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出

回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

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严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险，并设定适当的投资限额，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成：第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导；第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、监察稽核部及风险控制部所监控；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注‘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。此外，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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息， 可赎回基金份额净值（所有者权益）的合约无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并通过独立的风险管理岗位对投资组合中的证券的流动性风险进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率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市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,480,523,617.24	-	-	-	-	2,480,523,617.24
结算备付金	8,813,091.14	-	-	-	-	8,813,091.14
存出保证金	2,734,940.76	-	-	-	-	2,734,940.76
交易性金融资产	-	-	-	-	8,134,087,574.37	8,134,087,574.37
买入返售金融资产	348,940,914.41	-	-	-	-	348,940,914.41

应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	-	3,213,449.01	3,213,449.01
应收股利	-	-	-	-	-	0.00
应收申购款	248.14	-	-	-	22,436.52	22,684.66
资产总计	2,841,012,811.69	-	-	-	8,137,323,459.90	10,978,336,271.59
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	5,933,743.14	5,933,743.14
应付赎回款	-	-	-	-	13,856,866.43	13,856,866.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	13,103,106.36	13,103,106.36
应付托管费	-	-	-	-	2,183,851.08	2,183,851.08
应付交易费用	-	-	-	-	5,294,385.45	5,294,385.45
应交税费	-	-	-	-	25,000.00	25,000.00
其他负债	-	-	-	-	191,348.26	191,348.26
负债总计	-	-	-	-	40,588,300.72	40,588,300.72
利率敏感度缺口	2,841,012,811.69	-	-	-	8,096,735,159.18	10,937,747,970.87
上年度末 2013 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,015,593,829.04	-	-	-	-	1,015,593,829.04
结算备付金	20,019,716.89	-	-	-	-	20,019,716.89
存出保证金	3,664,227.31	-	-	-	-	3,664,227.31
交易性金融资产	-	1,630,200.00	-	-	9,343,662,090.96	9,345,292,290.96
买入返售金融资产	599,952,249.98	-	-	-	-	599,952,249.98
应收证券清算款	-	-	-	-	508,108,022.19	508,108,022.19
应收利息	-	-	-	-	305,371.46	305,371.46
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	3,113,933.58	3,113,933.58
资产总计	1,639,230,023.22	1,630,200.00	-	-	9,855,189,418.19	11,496,049,641.41
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	33,371,387.24	33,371,387.24
应付赎回款	-	-	-	-	10,456,869.13	10,456,869.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	14,671,916.91	14,671,916.91
应付托管费	-	-	-	-	2,445,319.49	2,445,319.49
应付交易费用	-	-	-	-	6,342,489.23	6,342,489.23
应交税费	-	-	-	-	25,000.00	25,000.00
其他负债	-	-	-	-	141,274.61	141,274.61
负债总计	-	-	-	-	67,454,256.61	67,454,256.61
利率敏感度缺口	1,639,230,023.22	1,630,200.00	-	-	9,787,735,161.58	11,428,595,384.80

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变化
	其他市场变量保持不变

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 ）
	1.市场利率下降 27 个基点	-	25,148.20
	2.市场利率上升 27 个基点	-	-25,148.20

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。本基金的投资方向界定为股票、债券以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的，具有良好流动性的 A 股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债券。现金资产主要投资于各类银行存款。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资，本基金有效降低了投资组合的其他价格风险，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比例为基金资产净值的 60%-95%，债券投资比例为基金资产净值的 0%-35%，现金和到期日在一年以内的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。本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	8,134,087,574.37	74.37	9,343,662,090.96	81.76
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	1,630,200.00	0.01
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	8,134,087,574.37	74.37	9,345,292,290.96	81.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化		
	其他市场变量保持不变		
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 ）
	1.业绩比较基准的公允价值上升 5%	509,579,147.97	573,345,592.48
	2.业绩比较基准的公允价值下降 5%	-509,579,147.97	-573,345,592.48

注：本基金的业绩比较基准为：80%×富时中国 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布,在 95%的置信度下,使用过去一年的历史数据,按照 VaR 正态算法,计算未来一个交易日里,基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	置信度：95%		
	观察期：一年		
分析	风险价值（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）
	基金投资组合的风险价值	193,199,028.02	238,504,522.56
	合计	193,199,028.02	238,504,522.56

6.4.14 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

(1)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，其账面价值接近于公允价值。

(2)以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

②各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为

7,872,082,544.41 元，属于第二层级的余额为 262,005,029.96 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日，第一层级的余额为 9,066,496,717.24 元，第二层级的余额为 278,795,573.72 元，无属于第三层级的余额)。

③公允价值所属层级间的重大变动

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、或属于非公开发行等情况，本基金分别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二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

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。

§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	8,134,087,574.37	74.09
	其中：股票	8,134,087,574.37	74.09
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	348,940,914.41	3.18
	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	2,489,336,708.38	22.67
7	其他各项资产	5,971,074.43	0.05
8	合计	10,978,336,271.59	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	51,301,031.72	0.47

B	采矿业	70,296,072.92	0.64
C	制造业	5,027,452,911.06	45.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,122,096.48	0.03
E	建筑业	22,802,711.80	0.21
F	批发和零售业	205,691,287.55	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	35,890,425.84	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,747,860,083.87	15.98
J	金融业	276,526,768.89	2.53
K	房地产业	150,366,778.19	1.37
L	租赁和商务服务业	16,042,115.90	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	64,790,583.51	0.59
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	410,895,931.84	3.76
S	综合	51,048,774.80	0.47
	合计	8,134,087,574.37	74.37

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	600879	航天电子	37,874,060	446,156,426.80	4.08
2	600776	东方通信	29,730,170	396,897,769.50	3.63
3	600271	航天信息	13,741,532	286,785,772.84	2.62
4	000503	海虹控股	14,088,123	274,718,398.50	2.51
5	603000	人民网	6,189,090	242,550,437.10	2.22
6	300238	冠昊生物	4,350,349	221,258,750.14	2.02
7	000748	长城信息	9,489,633	215,129,980.11	1.97
8	600812	华北制药	43,784,949	214,984,099.59	1.97
9	600373	中文传媒	14,989,862	209,858,068.00	1.92
10	600571	信雅达	9,246,269	180,209,782.81	1.65
11	300291	华录百纳	5,099,840	178,953,385.60	1.64

12	300010	立思辰	6,908,130	172,150,599.60	1.57
13	000566	海南海药	15,253,128	165,954,032.64	1.52
14	002412	汉森制药	10,287,042	152,968,314.54	1.40
15	000917	电广传媒	10,036,472	152,855,468.56	1.40
16	600060	海信电器	15,500,000	149,575,000.00	1.37
17	600705	中航投资	8,999,915	144,628,634.05	1.32
18	002429	兆驰股份	18,000,000	139,320,000.00	1.27
19	000538	云南白药	2,568,158	134,057,847.60	1.23
20	002481	双塔食品	9,454,828	126,694,695.20	1.16
21	600118	中国卫星	6,033,785	111,504,346.80	1.02
22	300050	世纪鼎利	5,930,566	105,445,463.48	0.96
23	600998	九州通	7,702,795	103,140,425.05	0.94
24	000716	南方食品	8,555,407	100,440,478.18	0.92
25	002025	航天电器	6,225,076	97,671,442.44	0.89
26	000948	南天信息	12,045,771	94,920,675.48	0.87
27	300104	乐视网	2,159,967	94,822,551.30	0.87
28	002339	积成电子	10,021,399	89,090,237.11	0.81
29	300296	利亚德	4,908,648	81,385,383.84	0.74
30	002521	齐峰新材	7,676,377	77,761,699.01	0.71
31	600580	卧龙电气	9,590,464	73,558,858.88	0.67
32	600872	中炬高新	6,872,909	73,333,939.03	0.67
33	600847	万里股份	4,071,940	72,643,409.60	0.66
34	601318	中国平安	1,840,973	72,423,877.82	0.66
35	000039	中集集团	5,073,797	68,293,307.62	0.62
36	002601	佰利联	3,563,444	65,923,714.00	0.60
37	002030	达安基因	3,236,820	62,956,149.00	0.58
38	002230	科大讯飞	2,357,588	62,711,840.80	0.57
39	002143	高金食品	3,285,535	60,815,252.85	0.56
40	300065	海兰信	3,500,000	59,290,000.00	0.54
41	000070	特发信息	6,000,000	56,760,000.00	0.52
42	002017	东信和平	4,220,902	56,306,832.68	0.51
43	300359	全通教育	780,000	55,637,400.00	0.51
44	300030	阳普医疗	4,429,590	55,148,395.50	0.50
45	600298	安琪酵母	3,746,326	54,621,433.08	0.50
46	600351	亚宝药业	5,800,036	53,360,331.20	0.49
47	002280	新世纪	1,676,105	52,830,829.60	0.48
48	002065	东华软件	2,599,916	52,310,309.92	0.48
49	002695	煌上煌	1,836,030	51,353,759.10	0.47
50	000009	中国宝安	4,999,880	51,048,774.80	0.47

51	000998	隆平高科	1,831,464	50,328,630.72	0.46
52	600990	四创电子	1,799,164	48,739,352.76	0.45
53	000739	普洛药业	7,505,585	47,810,576.45	0.44
54	300269	联建光电	1,383,970	47,650,087.10	0.44
55	000768	中航飞机	4,434,219	46,692,326.07	0.43
56	300020	银江股份	1,411,679	43,197,377.40	0.39
57	600007	中国国贸	4,453,408	43,019,921.28	0.39
58	600697	欧亚集团	2,399,550	42,807,972.00	0.39
59	600171	上海贝岭	5,099,687	41,613,445.92	0.38
60	300220	金运激光	1,252,987	41,035,324.25	0.38
61	600562	DR 国睿科	755,630	40,463,986.50	0.37
62	002285	世联行	4,899,629	39,246,028.29	0.36
63	300207	欣旺达	1,330,756	38,858,075.20	0.36
64	002426	胜利精密	4,090,226	37,180,154.34	0.34
65	600499	科达洁能	2,000,000	35,680,000.00	0.33
66	000848	承德露露	1,792,932	35,625,558.84	0.33
67	300033	同花顺	2,452,870	34,242,065.20	0.31
68	002450	康得新	1,500,000	34,125,000.00	0.31
69	300096	易联众	1,400,735	34,107,897.25	0.31
70	000045	深纺织Ａ	4,500,000	32,940,000.00	0.30
71	300164	通源石油	1,919,760	31,292,088.00	0.29
72	600067	冠城大通	5,678,792	28,450,747.92	0.26
73	600588	用友软件	2,000,000	28,140,000.00	0.26
74	600978	宜华木业	5,642,932	27,537,508.16	0.25
75	300024	机器人	899,829	26,454,972.60	0.24
76	600583	海油工程	3,458,990	25,492,756.30	0.23
77	300070	碧水源	859,790	25,148,857.50	0.23
78	600185	格力地产	2,824,965	23,673,206.70	0.22
79	000063	中兴通讯	1,706,813	22,393,386.56	0.20
80	601098	中南传媒	1,529,396	22,084,478.24	0.20
81	002583	海能达	802,300	21,870,698.00	0.20
82	601007	金陵饭店	2,299,905	21,458,113.65	0.20
83	002341	新纶科技	1,000,000	19,640,000.00	0.18
84	002215	诺 普 信	2,464,738	18,436,240.24	0.17
85	600511	国药股份	802,395	18,214,366.50	0.17
86	002460	赣锋锂业	500,000	18,000,000.00	0.16
87	601601	中国太保	1,000,000	17,790,000.00	0.16
88	600398	海澜之家	1,880,830	17,303,636.00	0.16
89	000816	江淮动力	3,999,916	17,279,637.12	0.16

90	000860	顺鑫农业	1,095,639	15,382,771.56	0.14
91	600054	黄山旅游	1,142,241	14,563,572.75	0.13
92	000901	航天科技	899,581	14,528,233.15	0.13
93	002567	唐人神	2,000,000	13,880,000.00	0.13
94	002474	榕基软件	1,604,228	13,844,487.64	0.13
95	600986	科达股份	2,838,805	13,512,711.80	0.12
96	002005	德豪润达	1,599,947	13,391,556.39	0.12
97	300150	世纪瑞尔	838,522	13,282,188.48	0.12
98	300232	洲明科技	511,606	11,823,214.66	0.11
99	000021	长城开发	2,000,000	11,800,000.00	0.11
100	000718	苏宁环球	2,458,900	11,089,639.00	0.10
101	600292	中电远达	577,070	10,987,412.80	0.10
102	002392	北京利尔	1,157,137	10,634,089.03	0.10
103	601336	新华保险	499,911	10,563,119.43	0.10
104	300003	乐普医疗	499,963	10,449,226.70	0.10
105	002446	盛路通信	450,320	10,447,424.00	0.10
106	002653	海思科	519,987	9,983,750.40	0.09
107	600754	锦江股份	599,764	9,842,127.24	0.09
108	600050	中国联通	3,000,000	9,690,000.00	0.09
109	000333	美的集团	500,000	9,660,000.00	0.09
110	600138	中青旅	433,155	9,434,115.90	0.09
111	600770	综艺股份	1,000,000	9,260,000.00	0.08
112	600000	浦发银行	1,000,000	9,050,000.00	0.08
113	000651	格力电器	300,000	8,835,000.00	0.08
114	000902	新洋丰	999,226	8,773,204.28	0.08
115	000562	宏源证券	1,000,000	8,220,000.00	0.08
116	300386	飞天诚信	140,850	8,131,270.50	0.07
117	002509	天广消防	774,020	8,026,587.40	0.07
118	000880	潍柴重机	825,363	7,799,680.35	0.07
119	600196	复星医药	386,076	7,794,874.44	0.07
120	000975	银泰资源	899,966	7,172,729.02	0.07
121	000826	桑德环境	299,902	6,852,760.70	0.06
122	601888	中国国旅	200,000	6,608,000.00	0.06
123	600522	中天科技	500,000	6,545,000.00	0.06
124	000541	佛山照明	650,022	6,474,219.12	0.06
125	601788	光大证券	799,987	6,351,896.78	0.06
126	000939	凯迪电力	856,554	6,338,499.60	0.06
127	300055	万邦达	200,000	6,010,000.00	0.05
128	002550	千红制药	299,915	5,803,355.25	0.05

129	600827	友谊股份	500,000	5,490,000.00	0.05
130	002573	国电清新	299,932	5,272,804.56	0.05
131	601799	星宇股份	306,462	5,246,629.44	0.05
132	300196	长海股份	316,067	4,943,287.88	0.05
133	600030	中信证券	420,200	4,815,492.00	0.04
134	300275	梅安森	299,977	4,619,645.80	0.04
135	002186	全 聚 德	261,549	4,590,184.95	0.04
136	002023	海特高新	230,980	4,411,718.00	0.04
137	300156	天立环保	300,000	4,125,000.00	0.04
138	002226	江南化工	380,110	4,032,967.10	0.04
139	002614	蒙发利	225,000	3,971,250.00	0.04
140	000561	烽火电子	500,000	3,345,000.00	0.03
141	002325	洪涛股份	400,000	3,280,000.00	0.03
142	600429	三元股份	441,272	3,190,396.56	0.03
143	300203	聚光科技	200,000	3,180,000.00	0.03
144	002276	万马股份	500,000	3,155,000.00	0.03
145	002353	杰瑞股份	75,000	3,018,750.00	0.03
146	600686	金龙汽车	330,000	2,953,500.00	0.03
147	300315	掌趣科技	160,000	2,857,600.00	0.03
148	600713	南京医药	500,000	2,825,000.00	0.03
149	600886	国投电力	528,300	2,694,330.00	0.02
150	300113	顺网科技	110,175	2,666,235.00	0.02
151	600329	中新药业	169,789	2,630,031.61	0.02
152	600237	铜峰电子	421,917	2,582,132.04	0.02
153	000786	北新建材	161,103	2,210,333.16	0.02
154	600731	湖南海利	297,500	2,156,875.00	0.02
155	002013	中航机电	138,769	2,055,168.89	0.02
156	000558	莱茵置业	432,100	2,000,623.00	0.02
157	600183	生益科技	320,726	1,975,672.16	0.02
158	600104	上汽集团	123,700	1,892,610.00	0.02
159	000895	双汇发展	51,440	1,841,037.60	0.02
160	000001	平安银行	176,200	1,746,142.00	0.02
161	002004	华邦颖泰	82,100	1,527,060.00	0.01
162	000002	万 科A	174,300	1,441,461.00	0.01
163	002043	兔 宝 宝	314,100	1,240,695.00	0.01
164	600594	益佰制药	28,180	1,159,043.40	0.01
165	002465	海格通信	67,905	1,081,726.65	0.01
166	600240	华业地产	221,200	1,079,456.00	0.01
167	000511	烯碳新材	147,400	993,476.00	0.01

168	002299	圣农发展	83,900	972,401.00	0.01
169	600637	百视通	30,000	960,900.00	0.01
170	601628	中国人寿	68,751	935,701.11	0.01
171	600418	江淮汽车	89,800	919,552.00	0.01
172	002159	三特索道	48,414	910,183.20	0.01
173	300039	上海凯宝	72,188	905,237.52	0.01
174	601231	环旭电子	28,899	891,245.16	0.01
175	002008	大族激光	51,328	890,027.52	0.01
176	600660	福耀玻璃	105,900	889,560.00	0.01
177	600557	康缘药业	27,480	788,676.00	0.01
178	002108	沧州明珠	53,771	681,278.57	0.01
179	600667	太极实业	131,800	610,234.00	0.01
180	600893	航空动力	23,400	603,018.00	0.01
181	002063	远光软件	28,561	584,072.45	0.01
182	000978	桂林旅游	77,600	536,992.00	0.00
183	300078	中瑞思创	19,500	530,595.00	0.00
184	000430	张家界	70,000	518,000.00	0.00
185	600037	歌华有线	47,875	503,645.00	0.00
186	600372	中航电子	22,000	498,740.00	0.00
187	000766	通化金马	82,300	454,296.00	0.00
188	300335	迪森股份	36,068	427,766.48	0.00
189	002726	龙大肉食	25,062	427,557.72	0.00
190	002284	亚太股份	40,000	411,200.00	0.00
191	600246	万通地产	119,900	365,695.00	0.00
192	300339	润和软件	17,300	314,860.00	0.00
193	600718	东软集团	21,800	294,082.00	0.00
194	002727	一心堂	22,420	273,524.00	0.00
195	603168	莎普爱思	9,892	216,140.20	0.00
196	300193	佳士科技	14,400	206,640.00	0.00
197	002380	科远股份	7,359	185,741.16	0.00
198	601166	兴业银行	190	1,905.70	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	000538	云南白药	157,091,185.65	1.37

2	600499	科达洁能	123,961,751.97	1.08
3	002474	榕基软件	121,048,296.53	1.06
4	300104	乐视网	118,050,841.38	1.03
5	002030	达安基因	115,048,703.04	1.01
6	603000	人民网	112,100,789.80	0.98
7	300058	蓝色光标	109,905,459.39	0.96
8	002017	东信和平	108,147,849.53	0.95
9	601318	中国平安	106,677,498.25	0.93
10	600588	用友软件	102,981,107.03	0.90
11	300065	海兰信	98,664,544.36	0.86
12	300050	世纪鼎利	95,261,851.48	0.83
13	000997	新 大 陆	94,514,383.58	0.83
14	002446	盛路通信	89,203,023.49	0.78
15	300291	华录百纳	86,463,712.89	0.76
16	600366	宁波韵升	84,130,608.60	0.74
17	600351	亚宝药业	79,230,733.22	0.69
18	300183	东软载波	73,298,739.50	0.64
19	300296	利亚德	69,630,388.82	0.61
20	600763	通策医疗	67,284,141.10	0.59

注：本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

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	600060	海信电器	251,728,608.37	2.20
2	000012	南　玻A	194,713,462.43	1.70
3	000883	湖北能源	194,648,243.77	1.70
4	000858	五 粮 液	166,868,799.28	1.46
5	002429	兆驰股份	160,410,394.57	1.40
6	601117	中国化学	160,061,971.19	1.40
7	600376	首开股份	152,771,074.13	1.34
8	601929	吉视传媒	134,722,406.35	1.18
9	300287	飞利信	121,896,337.70	1.07
10	000002	万　科A	121,280,495.97	1.06
11	000739	普洛药业	114,573,932.47	1.00
12	300065	海兰信	107,482,527.08	0.94

13	300058	蓝色光标	103,469,433.28	0.91
14	000566	海南海药	103,061,085.52	0.90
15	600143	金发科技	101,840,014.89	0.89
16	002474	榕基软件	99,587,818.71	0.87
17	000997	新 大 陆	98,209,286.11	0.86
18	000568	泸州老窖	94,385,422.75	0.83
19	002414	高德红外	93,644,442.54	0.82
20	601989	中国重工	89,419,668.24	0.78

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

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	5,521,151,136.65
卖出股票收入（成交）总额	7,034,769,874.82

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	2,734,940.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,213,449.01
5	应收申购款	22,684.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,971,074.43

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的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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
656,762	18,976.28	238,386,353.56	1.91%	12,224,514,563.47	98.09%

8.2 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	1,631,624.67	0.0131%

8.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2005 年 12 月 19 日 ）基金份额总额	379,177,416.36
本报告期期初基金份额总额	13,354,695,636.69
本报告期基金总申购份额	40,019,926.05
减:本报告期基金总赎回份额	931,814,645.71
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	12,462,900,917.03

注：总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开本基金的基金份额持有人大会,没有基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

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

本报告期内本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

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	
中投证券	2	2,503,076,539.55	20.00%	2,278,804.01	20.00%	-

招商证券	1	2,492,714,645.22	19.92%	2,269,369.15	19.92%	-
中信证券	1	2,246,348,074.61	17.95%	2,045,069.68	17.95%	-
东吴证券	1	1,196,633,466.20	9.56%	1,089,415.54	9.56%	-
国都证券	1	1,033,533,304.96	8.26%	940,926.47	8.26%	-
申银万国	1	920,848,908.33	7.36%	838,342.75	7.36%	-
华泰证券	1	675,307,020.52	5.40%	614,800.04	5.40%	-
银河证券	1	603,902,927.21	4.83%	549,793.97	4.83%	-
安信证券	1	444,660,395.18	3.55%	404,818.83	3.55%	-
国泰君安	1	329,676,421.74	2.63%	300,137.67	2.63%	-
太平洋证券	1	67,676,699.82	0.54%	61,613.64	0.54%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：本报告期租用证券公司交易单元的变更情况:

无。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为:

(1) 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于 3 亿元人民币。

(2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3) 经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

(4) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

(6) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服

务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

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
中投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	500,000,000.00	17.25%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	1,544,370.00	100.00%	1,498,100,000.00	51.69%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	900,000,000.00	31.05%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	诺安基金管理有限公司旗下基金 2013 年最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告	基金管理人网站	2014 年 1 月 3 日
2	诺安股票证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 1 月 20 日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票立思辰（300010）估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 1 月 23 日
4	诺安基金管理有限公司关于增加华侨银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 1 月 23 日
5	诺安股票证券投资基金招募说明书（更新)2013 年第 2 期	基金管理人网站	2014 年 1 月 27 日
6	诺安股票证券投资基金招募说明书(更新)摘要（2013 年第 2 期）	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 1 月 27 日
7	诺安基金管理有限公司关于增加北京展恒基金销售有限公司为旗下基金代销机构并开通基金定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 1 月 28 日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票金运激光（300220）估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 2 月 11 日
9	诺安基金管理有限公司关于增加一路财富(北京)信息科技有限公司为旗下基金代销机构并开通基金定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 2 月 20 日

10	诺安基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通基金定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 3 月 13 日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券手机客户端申购场外开放式基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 3 月 17 日
12	诺安基金管理有限公司关于增加晟视天下投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通基金定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 3 月 19 日
13	诺安股票证券投资基金 2013 年年度报告	基金管理人网站	2014 年 3 月 27 日
14	诺安股票证券投资基金 2013 年年度报告摘要	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 3 月 27 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票中文传媒(600373)估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 3 月 31 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 1 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票恒生电子(600570)估值调整报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 1 日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票赣锋锂业(002460)估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 9 日
19	诺安基金管理有限公司关于调整旗下	《中国证券报》、	2014 年 4 月 9 日

	部分基金持有的恒生电子股票估值方法的公告	《证券时报》、《上海证券报》	
20	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有的恒生电子股票估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 10 日
21	诺安基金管理有限公司关于增加宜信普泽投资顾问(北京)有限公司为旗下部分基金代销机构并开通基金定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 12 日
22	诺安股票证券投资资金 2014 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 22 日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票长城信息（000748）估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 26 日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票江淮汽车(600418)估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 4 月 29 日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票深纺织 A(000045)估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 5 月 17 日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014 年 6 月 25 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安股票证券投资基金募集的文件。

②《诺安股票证券投资基金基金合同》。

③《诺安股票证券投资基金托管协议》。

④诺安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照。

⑤《诺安基金管理有限公司开放式基金业务规则》。

⑥诺安股票证券投资基金 2014 年半年度报告正文。

⑦报告期内诺安股票证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2014 年 8 月 26 日