

信息披露 Disclosure

上能能源交易型开放式指数发起式证券投资基金

2013 年度 报 告 摘 要

基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下,本基金收益每年最多分配2次,每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的50%;且基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。本基金收益分配方式为现金方式,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若基金份额持有人事先未作选择,本基金默认的收益分配方式为现金红利。本基金收益分配方式为现金方式,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若基金份额持有人事先未作选择,本基金默认的收益分配方式为现金红利。本基金收益分配方式为现金方式,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若基金份额持有人事先未作选择,本基金默认的收益分配方式为现金红利。

交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.1.17 关联交易
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.18 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.19 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.20 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.21 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.22 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.23 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.24 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.25 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.26 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.27 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.28 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.29 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.30 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.31 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.32 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.33 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.34 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.35 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.36 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.37 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.38 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.39 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.40 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.41 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.42 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.43 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.44 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.45 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.46 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.47 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.48 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.49 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.50 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.51 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.52 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.53 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.54 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.55 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.56 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.57 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.58 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.59 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.60 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.61 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.62 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

7.1.63 关联方关系
本基金管理人及关联方未发生关联交易。

告文
8.4 报告期末股票投资组合的重大变动
8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	55,589,939.95	38.72
2	600028	中国石化	46,313,099.69	32.26
3	601099	鑫茂环保	28,491,370.00	19.85
4	600348	阳泉铝业	25,194,921.75	17.58
5	600266	广汇能源	24,788,612.34	17.27
6	601887	中国石药	23,583,436.70	16.43
7	600683	海油工程	22,812,216.16	15.89
8	601898	中煤能源	18,296,487.73	12.74
9	600188	兖州煤业	17,411,302.35	12.13
10	601808	中海油服	17,288,734.18	12.04
11	601095	鑫江股份	12,040,846.69	8.39
12	600997	开滦股份	10,135,266.15	7.06
13	600043	大有能源	8,902,092.47	6.20
14	601101	昊华能源	8,592,963.98	5.99
15	601001	大同煤业	8,264,031.63	5.76
16	601918	国投证券	7,969,778.51	5.55
17	600977	海能达	7,901,469.21	5.50
18	600988	新华水泥	7,848,071.76	5.46
19	600958	上海能源	6,620,038.52	4.61
20	601057	华鲁能源	5,617,793.92	3.91
21	600740	山西焦化	5,117,532.93	3.56
22	600333	长春燃气	4,306,898.45	3.04
23	600023	兰花科创	3,986,991.86	2.78

注:“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600121	郑州煤电	4,463,993.12	3.11
2	601887	中国神华	3,822,787.10	2.66
3	600028	中国石化	3,373,077.07	2.35
4	601798	蓝盾高新	2,332,745.82	1.62
5	601099	鑫茂环保	1,446,327.72	1.01
6	600348	阳泉铝业	1,349,129.74	0.94
7	601808	中海油服	1,327,810.39	0.91
8	601898	中煤能源	1,250,875.14	0.87
9	600387	海能达	1,046,913.53	0.73
10	600123	兰花科创	1,037,980.96	0.72
11	601666	平煤股份	872,964.95	0.61
12	600721	百花村	693,738.82	0.48
13	600174	金瑞矿业	584,767.55	0.41
14	600188	兖州煤业	559,116.60	0.39
15	600395	鑫江股份	544,923.13	0.38
16	601101	昊华能源	535,130.55	0.37
17	600403	大有能源	508,187.27	0.35
18	600971	恒源煤电	480,726.43	0.33
19	600997	开滦股份	476,029.39	0.33
20	600508	上海能源	471,821.87	0.29

注:“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3 买入股票的成本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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600121	郑州煤电	4,463,993.12	3.11
2	601887	中国神华	3,822,787.10	2.66
3	600028	中国石化	3,373,077.07	2.35
4	601798	蓝盾高新	2,332,745.82	1.62
5	601099	鑫茂环保	1,446,327.72	1.01
6	600348	阳泉铝业	1,349,129.74	0.94
7	601808	中海油服	1,327,810.39	0.91
8	601898	中煤能源	1,250,875.14	0.87
9	600387	海能达	1,046,913.53	0.73
10	600123	兰花科创	1,037,980.96	0.72
11	601666	平煤股份	872,964.95	0.61
12	600721	百花村	693,738.82	0.48
13	600174	金瑞矿业	584,767.55	0.41
14	600188	兖州煤业	559,116.60	0.39
15	600395	鑫江股份	544,923.13	0.38
16	601101	昊华能源	535,130.55	0.37
17	600403	大有能源	508,187.27	0.35
18	600971	恒源煤电	480,726.43	0.33
19	600997	开滦股份	476,029.39	0.33
20	600508	上海能源	471,821.87	0.29

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.4 买入股票的成本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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600121	郑州煤电	4,463,993.12	3.11
2	601887	中国神华	3,822,787.10	2.66
3	600028	中国石化	3,373,077.07	2.35
4	601798	蓝盾高新	2,332,745.82	1.62
5	601099	鑫茂环保	1,446,327.72	1.01
6	600348	阳泉铝业	1,349,129.74	0.94
7	601808	中海油服	1,327,810.39	0.91
8	601898	中煤能源	1,250,875.14	0.87
9	600387	海能达	1,046,913.53	0.73
10	600123	兰花科创	1,037,980.96	0.72
11	601666	平煤股份	872,964.95	0.61
12	600721	百花村	693,738.82	0.48
13	600174	金瑞矿业	584,767.55	0.41
14	600188	兖州煤业	559,116.60	0.39
15	600395	鑫江股份	544,923.13	0.38
16	601101	昊华能源	535,130.55	0.37
17	600403	大有能源	508,187.27	0.35
18	600971	恒源煤电	480,726.43	0.33
19	600997	开滦股份	476,029.39	0.33
20	600508	上海能源	471,821.87	0.29

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.5 买入股票的成本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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600121	郑州煤电	4,463,993.12	3.11
2	601887	中国神华	3,822,787.10	2.66
3	600028	中国石化	3,373,077.07	2.35
4	601798	蓝盾高新	2,332,745.82	1.62
5	601099	鑫茂环保	1,446,327.72	1.01
6	600348	阳泉铝业	1,349,129.74	0.94
7	601808	中海油服	1,327,810.39	0.91
8	601898	中煤能源	1,250,875.14	0.87
9	600387	海能达	1,046,913.53	0.73
10	600123	兰花科创	1,037,980.96	0.72
11	601666	平煤股份	872,964.95	0.61
12	600721	百花村	693,738.82	0.48
13	600174	金瑞矿业	584,767.55	0.41
14	600188	兖州煤业	559,116.60	0.39
15	600395	鑫江股份	544,923.13	0.38
16	601101	昊华能源	535,130.55	0.37
17	600403	大有能源	508,187.27	0.35
18	600971	恒源煤电	480,726.43	0.33
19	600997	开滦股份	476,029.39	0.33
20	600508	上海能源	471,821.87	0.29

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.6 买入股票的成本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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600121	郑州煤电	4,463,993.12	3.11
2	601887	中国神华	3,822,787.10	2.66
3	600028	中国石化	3,373,077.07	2.35
4	601798	蓝盾高新	2,332,745.82	1.62
5	601099	鑫茂环保	1,446,327.72	1.01
6	600348	阳泉铝业	1,349,129.74	0.94
7	601808	中海油服	1,327,810.39	0.91
8	601898	中煤能源	1,250,875.14	0.87
9	600387	海能达	1,046,913.53	0.73
10	600123	兰花科创	1,037,980.96	0.72
11	601666	平煤股份	872,964.95	0.61
12	600721	百花村	693,738.82	0.48
13	600174	金瑞矿业	584,767.55	0.41
14	600188	兖州煤业	559,116.60	0.39
15	600395	鑫江股份	544,923.13	0.38
16	601101	昊华能源	535,130.55	0.37
17	600403	大有能源	508,187.27	0.35
18	600971	恒源煤电	480,726.43	0.33
19	600997	开滦股份	476,029.39	0.33
20	600508	上海能源	471,821.87	0.29

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.7 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价