

(上接B383版)

提,逐日累计至每月月底,按月支付给宝盈基金管理公司,再由宝盈基金管理公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费 = 前一日C类基金份额资产净值 × 1% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金报告期内上年度可比期间未发生过关联交易进行银行间市场交易。

7.4.8.4 各类投资及资金运用情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况

本基金在报告期末及上年度期未除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方 名称	本期			上年度可比期间		
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	133,759,173.53	625,847.55	4,928,402.77	140,148.81		

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间未发生过关联交易承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.5 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金在报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.6 期末持有的暂时停牌或者流通受限股票

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	复牌时 数量(股)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
300044	赛为智能	2013年1月19日	重大资产重组	9.13	2013年2月5日	10,000	9,256	9,130.00	-

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间未发生过关联交易承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.5 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金在报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.6 期末持有的暂时停牌或者流通受限股票

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	复牌时 数量(股)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
300044	赛为智能	2013年1月19日	重大资产重组	9.13	2013年2月5日	10,000	9,256	9,130.00	-

注:本基金截至2013年12月31日止持有以上因公告的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将不在此公布所占的百分比。

7.4.9.7 期末持有的暂时停牌或者流通受限股票

7.4.9.8 本报告期及上年度可比期间无其他银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.9 交易所市场债券正回购

本基金在报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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账款和其他金融负债,其账面价值

与公允价值相差不多。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级

可分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级: 直接或(以公允价值)或间接(根据价格推算的)可观察到的、除第一层级

中的市场价格以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 可以观察到的市场价格以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可

观察输入值)。

(i) 各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

中属于第一层级的余额为1,230,085,067.11元,属于第二层级的余额为206,871,000.00

元,无属于第三层级的余额。

(ii) 各层级金融工具公允价值的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃),或属于非公开发行等情况,本基金不会停牌且交易恢复活跃后期间,交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(v) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

元。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,175,123,567.11	68.59
其中:股票		1,175,123,567.11	68.59
2	固定收益投资	261,832,500.00	15.28
其中:债券		261,832,500.00	15.28
3	货币市场基金投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	99,640,169.82	5.82
5.1	银行存款和结算备付金合计	140,426,363.03	8.20
6	其他各项资产	36,337,935.14	2.12
7	合计	1,713,360,535.10	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	15,392,800.50	0.91
B	采矿业	-	-
C	制造业	414,959,508.22	24.48
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	120,254,082.13	7.09
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	604,421,170.60	35.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,096,005.66	1.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		1,175,123,567.11	69.31

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

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	002368	太极股份	4,750,000	0.14
2	000918	康美药业	1,205,284,897.00	8.28
3	000909	东方财富	8,007,740	0.77
4	000998	九州通	8,022,287	0.79
5	000322	硕贝德	3,500,000.00	0.60
6	300182	捷顺科技	2,580,278	0.65
7	300253	卫宁软件	1,380,000	0.51
8	000725	京东方A	31,259,841	67,086,585.15
9	600536	中国软件	1,600,000	3.56
10	300168	万达信息	1,999,872	