

信息披露 disclosure

(上接B383版)

提,逐日累计至每月月底,按月支付给宝盈基金公司,再由宝盈基金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×15%/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:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间市场交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期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投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度期末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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 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	133,759,172.53	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 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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 因购新发/增发证券于期末持有的流通受限证券

本基金本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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300044	赛为智能	2013年11月19日	重大资产重组	9.13	2014年2月25日	10.04	1,000,000	9,256,313.50	9,130,000.00	-

注:本基金截至2013年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.7 期末债券正回购交易作为抵押的债券

7.4.9.7.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.7.2 交易所市场债券正回购

本基金本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款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(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(如取自价格)或间接(如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据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)。

(ii)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(2012年12月31日:第一层级82,046,924.96元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii)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(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一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(v)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
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	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	99,640,169.82	5.82
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	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	36,337,993.54	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、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	35.63
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	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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002368	太极股份	4,750,000	154,660,000.00	9.12
2	600518	康美药业	7,800,878	140,415,804.00	8.28
3	300059	东方财富	8,007,740	121,557,493.20	7.17
4	600998	九州通	8,022,287	120,254,082.13	7.09
5	300322	硕贝德	3,500,000	106,470,000.00	6.28
6	300182	捷成股份	2,580,278	102,643,458.84	6.05
7	300253	卫士软件	1,380,000	100,201,800.00	5.91
8	000725	京东方A	31,259,841	67,208,658.15	3.96
9	600536	中国软件	1,600,000	60,272,000.00	3.56
10	300168	万达信息	1,999,872	55,956,418.36	3.30

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于宝盈基金管理有限公司http://www.pyfund.com网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300059	东方财富	341,649,904.63	382.36
2	601989	中国重工	309,599,299.66	346.49
3	600837	海通证券	278,207,469.93	311.36
4	002368	太极股份	270,415,185.85	302.64
5	600518	康美药业	253,311,056.05	283.30
6	300322	硕贝德	223,317,498.45	249.93
7	000725	京东方A	207,143,333.65	231.83
8	002230	科大讯飞	184,254,460.89	206.21
9	300253	卫士软件	154,564,275.29	172.98
10	601318	中国平安	145,967,591.26	163.36
11	002429	兆驰股份	131,286,676.13	146.93
12	300182	捷成股份	126,387,433.64	141.45
13	002549	凯美特气	111,923,431.06	125.26
14	600998	九州通	101,412,955.02	113.50
15	600536	中国软件	97,739,515.24	109.39
16	600030	中信证券	95,110,299.09	106.44
17	601766	中国南车	91,424,878.57	102.32
18	601299	中国北车	85,617,568.09	95.82
19	300348	长亮科技	82,318,938.28	92.13
20	002405	四维图新	76,044,780.25	85.11
21	002241	歌尔声学	73,906,390.06	82.71
22	002017	东信和平	66,409,797.10	74.32
23	300168	万达信息	62,395,118.52	69.83
24	600000	浦发银行	61,855,215.37	69.23
25	600893	航空动力	60,016,616.21	67.17
26	300101	国腾电子	57,893,385.21	64.79
27	002690	美亚光电	57,575,431.06	64.44
28	600050	中国联通	53,270,518.74	59.62
29	600048	保利地产	52,948,994.67	59.26
30	300006	康美药业	51,311,976.01	57.43
31	002439	朗明星	51,275,221.90	57.39
32	300197	联辰生态	47,284,869.40	52.92
33	002049	同方国芯	45,569,812.44	51.00
34	002005	德豪润达	44,516,711.41	49.82
35	600960	创维电子	42,213,015.19	47.24
36	300273	佳佳股份	40,936,132.15	45.81
37	300077	国民技术	40,676,658.97	45.52
38	601600	中国铝业	40,538,519.72	45.37
39	300218	安利股份	38,799,885.43	43.42
40	002149	西部材料	34,322,787.87	38.41
41	002064	华峰超纤	34,267,421.20	38.35
42	002073	牧神股份	31,489,514.14	35.24
43	600016	民生银行	30,562,275.65	34.20

44	300115	长盈精密	30,092,353.54	33.68
45	300353	东土科技	29,032,612.68	32.49
46	000768	中航飞机	28,527,542.74	31.93
47	000001	平安银行	28,390,734.50	31.77
48	600519	贵州茅台	28,072,216.49	31.42
49	600703	三安光电	28,015,250.05	31.35
50	000024	招商地产	26,993,474.32	30.21
51	600089	特变电工	26,431,714.12	29.58
52	600059	古越龙山	26,112,380.72	29.22
53	601186	中国铁建	25,695,428.13	28.76
54	600369	西南证券	25,613,722.62	28.67
55	601788	光大证券	25,360,451.33	28.38
56	000651	格力电器	24,127,290.12	27.00
57	002183	怡亚通	23,381,386.42	26.17
58	002106	莱宝高科	22,739,076.80	25.45
59	002396	星网锐捷	22,106,133.46	24.74
60	000050	深天马A	21,847,027.89	24.45
61	300187	永清环保	21,811,251.15	24.41
62	002296	辉耀电子	21,644,011.61	24.22
63	300229	拓尔思	21,392,661.08	23.94
64	002138	顺络电子	21,088,239.50	23.60
65	601336	新华保险	20,999,309.72	23.50
66	300078	中瑞思创	20,612,374.24	23.07
67	601688	华泰证券	20,529,191.06	22.98
68	601216	内蒙君正	20,443,754.96	22.88
69	600718	东软集团	20,415,045.43	22.85
70	300181	佐力药业	20,321,090.71	22.74
71	002063	远光软件	20,201,470.11	22.61
72	600443	航天动力	19,918,580.75	22.29
73	002273	水晶光电	19,837,617.17	22.20
74	300177	中海达	19,798,123.50	22.16
75	601601	中国太保	19,147,561.15	21.43
76	600887	伊利股份	19,126,261.68	21.41
77	600196	复星医药	18,676,603.82	20.90
78	300330	华虹计通	18,619,317.06	20.84
79	600104	上汽集团	18,390,339.40	20.58
80	300044	赛为智能	18,257,131.61	20.43
81	002331	皖通科技	18,155,566.49	20.32
82	002261	拓维信息	17,242,583.34	19.30
83	600791	京能置业	16,431,568.37	18.39
84	002421	达实智能	16,100,636.84	18.02
85	300310	宜通世纪	15,964,957.72	17.87
86	300094	国联水产	15,260,800.28	17.08
87	000063	中兴通讯	14,651,799.50	16.40
88	600118	中国卫星	14,633,423.60	16.38
89	300288	朗玛信息	13,994,665.49	15.56
90	000338	潍柴动力	13,532,190.20	15.14
91	600976	武汉健民	12,942,556.80	14.48
92	600999	招商证券	12,898,213.00	14.44
93	600739	江铃汽车	12,607,076.50	14.11
94	600888	用友软件	12,419,069.77	13.90
95	600329	中新药业	12,409,143.55	13.89
96	601866	中海集运	12,293,018.09	13.76
97	300274	阳光电源	11,942,767.83	13.37
98	300205	天喻信息	11,790,281.47	13.20
99	000562	宏源证券	11,585,041.21	12.97
100	600707	*ST彩虹	11,499,055.94	12.87
101	002371	七星电子	10,924,818.85	12.23
102	600388	龙净环保	10,899,740.46	12.19
103	600169	太原重工	10,564,810.50	11.82
104	300150	世纪瑞尔	10,561,019.90	11.82
105	600184	光电股份	10,466,924.12	11.65
106	300336	新文化	10,083,144.44	11.28
107	600066	宇通客车	9,850,189.51	11.02
108	300079	数码视讯	9,777,657.19	10.94
109	600316	洪都航空	9,708,314.94	10.87
110	600705	中航投资	9,415,300.00	10.54
111	600584	长电科技	9,302,010.04	10.41
112	600383	金地集团	8,671,636.21	9.71
113	002250	联化科技	8,107,937.92	9.07
114	600879	航天电子	8,085,304.19	9.05
115	600123	兰花科创	7,787,728.00	8.72
116	000977	浪潮信息	7,614,553.31	8.52
117	300136	信维通信	7,447,410.80	8.33
118	600325	华发股份	7,402,719.22	8.28
119	300002	神州泰丰	7,280,510.29	8.15
120	600547	山东黄金	7,080,517.44	7.92
121	300178	腾邦国际	6,937,647.20	7.76
122	000630	铜陵有色	6,828,542.79	7.64
123	600489	中金黄金	6,616,084.74	7.40
124	300323	华灿光电	6,307,429.99	7.06
125	600403	大有能源	6,145,377.42	6.88
126	600162	香江控股	6,085,034.00	6.81
127	601899	紫金矿业	6,012,675.05	6.73
128	600571	信维达	5,822,056.92	6.32
129	002065	东华软件	5,656,684.04	6.33
130	000733	振华科技	5,583,670.34	6.25
131	000637	百视通	5,495,461.96	6.15
132	002376	新南洋	5,437,486.99	6.09
133	002450	康得新	5,312,880.15	5.95
134	002148	北纬通信	5,243,503.94	5.87
135	300032	金龙机电	5,240,759.40	5.87
136	002618	丹邦科技	5,178,879.78	5.80
137	600372	中航电子	4,980,652.69	5.57
138	300088	长信科技	4,862,350.57	5.44
139	002268	卫士通	4,834,948.70	5.41
140	300021	大禹节水	4,796,817.27	5.37
141	600446	金证股份	4,557,925.30	5.10
142	300050	世纪鼎利	4,541,537.01	5.08
143	600261	阳光照明	4,502,508.44	5.04
144	600073	上海梅林	4,382,844.14	4.91
145	300299	富春通信	4,352,633.70	4.87
146	002406	远东传动	3,951,004.08	4.42
147	001628	中国人寿	3,856,248.00	4.32
148	300314	戴维医疗	3,634,557.60	4.07
149	002185	华科科技	3,616,872.94	4.05
150	600804	鹏博士	3,515,007.00	3.93
151	300137	先河环保	3,510,457.60	3.93
152	002698	博实股份	3,049,889.52	3.41
153	300027	华谊兄弟	2,917,730.42	3.27
154	601699	潞安环能	2,914,782.29	3.26
155	000049	德赛电池	2,832,712.36	3.17
156	002635	安洁科技	2,734,801.37	3.06
157	000960	锡业股份	2,672,856.76	2.99
158	600362	江西铜业	2,625,098.00	2.94
159	600038	哈飞股份	2,575,673.27	2.88
160	600138	中青旅	2,523,167.00	2.82
161	300302	同有科技	2,518,256.00	2.82
162	002456	欧菲光	2,475,741.39	2.77
163	002651	中国重汽	2,461,032.12	2.75
164	000964	青青稞酒	2,231,812.82	2.50
165	002467	二六三	2,074,860.31	2.35
166	300275	梅安森	1,831,910.10	2.02
167	000674	川路能源	1,813,864.86	2.03