

(上接B223版)

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	占当期债券成交金额的比例	2012年1月1日至2012年12月31日	占当期债券成交金额的比例
中国银河证券股份有限公司	9,831,100.00	100.00%	39,575,821.78	94.86%

债券回购交易 金额单位: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	占当期债券回购成交金额的比例	2012年1月1日至2012年12月31日	占当期债券回购成交金额的比例
中国银河证券股份有限公司	142,000,000.00	100.00%	267,540,000.00	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易
注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。
7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期				上年度可比期间			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
中国银河证券股份有限公司	3,351,144.30	89.71%	1,638,034.00	91.63%				
关联方名称	本期				上年度可比期间			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
中国银河证券股份有限公司	731,757.59	67.73%	268,126.78	100.00%				

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买卖经手费、证券结算风险基金和买卖经手费)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为基金提供的证券交易研究成果和 market 信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	4,341,368.02	1,876,694.89
其中:支付给销售机构的客户服务费	361,453.97	346,729.51

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.50%/当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	723,561.36	313,115.95

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.25%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

注:无。

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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

份额单位:份

项目	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
基金合同生效日(2008年5月26日)持有的基金份额	-	-
期间申购的基金份额	10,024,301.21	10,024,301.21
期间赎回的基金份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回及卖出总额	10,024,301.21	-
期末持有的基金份额	-	10,024,301.21
占基金总份额比例	-	8.72%

注:期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度末均未投资本基金。

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
中国银行股份有限公司	178,461,873.62	584,527.29
期末余额	584,527.29	9,304,351.28
当期利息收入	-	139,827.38

7.4.8.6 本基金在承销期内参与认购证券的情况
注:本基金本报告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的证券。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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	复牌成交价格	数量(股)	期末账面成本	期末估值总额	备注
000625	长安汽车	2013年12月13日	持续停牌	11.45	2014年1月31日	11.72	2,599,813	32,996,142.11	29,757,868.85	-
300071	华星股份	2013年11月21日	重大事项	29.00	-	-	193,306	4,805,036.86	5,605,874.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	1,034,472,252.06	68.23
	其中:股票	1,034,472,252.06	68.23
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	299,032,709.89	19.78
6	银行存款和结算备付金合计	179,968,920.15	11.87
7	其他各项资产	1,790,241.07	0.11
8	合计	1,516,472,252.06	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	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	80,578,477.57	5.54
C	制造业	666,798,418.38	41.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,240,000.00	3.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,658,073.50	2.04
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	121,946,604.05	8.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,576,000.00	0.11
L	租赁和商务服务业	49,104,216.50	3.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	79,042,428.06	5.44
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	21,528,034.00	1.48
S	综合	-	-
	合计	1,034,472,252.06	71.18

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	002353	杰瑞股份	1,072,847	85,181,866.39	5.86
2	300005	探路者	3,612,972	57,446,254.80	3.95
3	300075	数字政通	1,356,923	50,884,612.50	3.50
4	000826	奥德赛	68,713,352.20	2,335.20	3.35
5	000895	汇金股份	954,233	44,925,289.64	3.03
6	000900	长江电力	2,000,000	42,200,000.00	3.04
7	002400	广汇股份	1,199,888	43,494,852.50	2.99
8	600597	光明乳业	1,899,992	42,179,822.40	2.90
9	002241	歌尔声学	1,179,675	41,382,999.00	2.85
10	300070	普米斯	739,914	30,399,474.86	2.09

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人公司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

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 (%)
601398	工商银行	105,241,393.00	83.33
601288	农业银行	104,100,000.00	82.43
600028	中国石化	89,104,847.27	70.55
002353	杰瑞股份	83,671,459.89	66.25
600900	长江电力	64,410,112.25	51.00
300075	数字政通	60,215,413.17	47.68
000895	汇金股份	54,021,382.75	42.77
300005	探路者	51,701,708.31	40.94
002241	歌尔声学	50,688,741.62	40.13
600597	光明乳业	50,450,031.07	39.95
000826	奥德赛	50,389,717.78	39.90
300133	华策影视	40,465,748.83	32.04
002400	广汇股份	40,163,708.34	31.80
300157	恒誉文普	36,568,845.28	28.95
000625	长安汽车	32,996,142.11	26.13
300070	普米斯	31,141,175.36	24.66
002456	欧普光	30,578,715.70	24.21
000651	格力电器	29,492,112.89	23.35
600518	康美药业	28,392,484.44	22.48
300182	捷成股份	25,504,914.88	20.19
601808	中海油服	24,167,896.30	19.14
600585	海螺水泥	24,088,928.31	19.07
300090	盛运股份	22,852,351.09	18.09
300071	华联鑫信	22,765,821.59	18.03
300168	万法信息	22,390,861.26	17.73
600060	海信电器	21,380,339.48	16.93
300115	长盈精密	21,172,261.66	16.76
600436	片仔癀	20,709,921.77	16.40
000028	国药一致	19,496,702.23	15.44
601601	中国太保	19,195,061.42	15.20
002605	领益智造	18,687,872.89	14.80
600048	保利地产	17,760,185.21	14.07
600157	永泰能源	17,420,583.98	13.79
000024	招商地产	17,392,999.90	13.77
002148	北信通信	17,059,644.34	13.51
000848	承德露露	16,318,105.63	12.92
600887	伊利股份	16,299,546.68	12.91
600594	蓝焰股份	16,154,636.86	12.79
000998	隆平高科	15,825,193.43	12.53
002683	宏大爆破	15,715,106.56	12.44
300026	红日药业	15,571,239.59	12.33
300027	华谊兄弟	15,326,675.47	12.14
600298	安琪酵母	15,038,042.23	11.91
600517	国电电气	15,015,080.97	11.89
600292	中电远达	14,935,230.39	11.83
002470	金正大	14,347,330.74	11.36
002618	丹邦科技	14,146,577.84	11.20
002368	天能股份	13,938,924.12	11.04
600600	青岛海尔	13,881,212.84	10.99
002146	荣盛发展	13,851,540.00	10.97
601633	长城汽车	13,629,568.02	10.79
000963	华鲁能源	13,542,544.85	10.72
300303	聚飞光电	13,408,208.76	10.62
300287	飞信信	13,331,775.08	10.56
300323	华信国际	13,168,870.56	10.54
600867	通化东安	13,132,101.87	10.54
600199	安钢股份	13,260,000.00	10.48
600426	华鲁恒升	13,191,679.00	10.45
002482	广田股份	12,659,798.14	10.02
300164	通源石油	11,970,651.32	9.48
600546	山鹰国际	11,712,617.00	9.27
002292	奥飞动漫	11,578,690.80	9.17
600557	康缘药业	11,318,249.22	8.96
002415	海康威视	11,225,517.39	8.89
600587	新华医疗	10,963,655.42	8.68
601688	华泰证券	10,949,950.00	8.67
002138	顺络电子	10,324,149.76	8.17
300113	顺网科技	10,251,151.05	8.12
002244	滨江集团	9,962,198.95	7.89
300206	博瑞仪器	9,860,918.08	7.81
600780	通宝能源	9,657,986.48	7.65
002085	万丰奥康	9,600,431.44	7.60
601018	亚盛集团	9,418,818.29	7.46
300253	卫宁软件	9,347,587.11	7.40
300295	三六五网	9,300,142.95	7.36
601918	国投新集	9,241,459.41	7.32
601318	中国平安	9,228,764.00	7.31
600805	信达投资	9,063,967.35	7.18
000409	德普电池	8,389,161.84	6.80
600709	人福医药	8,439,252.00	6.68
601336	新华保险	8,386,866.24	6.64
002081	金 融 街	8,254,415.08	6.52
002587	金 融 街	8,133,516.42	6.44
005238	云南白药	8,087,436.45	6.40
002440	同士股份	8,028,847.81	6.36
603438	阿诺德	7,971,564.00	6.31
300058	蓝色光标	7,984,108.03	6.29
300047	天源迪科	7,775,733.00	6.16
002090	美亚光电	7,705,857.35	6.10
000561	隆大电力	7,687,115.60	6.09
600340	华夏幸福	7,663,709.83	6.07
000669	金洲能源	7,625,521.65	6.04
600309	万华化学	7,623,814.46	6.04
300205	天喻信息	7,616,535.83	6.03
002410	广 联 达	7,551,496.94	5.98
300337	银邦股份	7,427,458.04	5.88
600809	山西的森	7,267,428.49	5.75
601311	德邦股份	7,163,224.98	5.67
600315	上海家化	7,128,799.25	5.64
002038	双鹭药业	6,863,681.31	5.43
000400	许继电气	6,748,310.65	5.34
002465	海科通信	6,728,943.13	5.33
002041	登海种业	6,699,120.06	5.30
600804	鹏博士	6,627,223.00	5.25
600162	香江控股	6,353,699.95	5.03
000006	深振业A	6,276,715.08	4.97
200217	东方热电	6,234,708.68	4.94
000100	TCL 集团	6,225,933.36	4.93
000656	金科股份	6,202,573.64	4.91
600352	浙江龙盛	6,161,564.67	4.88
600667	冠城大通	6,140,686.63	4.86
600318	鲁东股份	6,060,493.90	4.80
600300	人民同庆	5,761,339.00	4.56
000338	雅戈尔	5,732,758.06	4.54
300326	凯利泰	5,717,842.66	4.53
600570	恒生电子	5,702,475.00	4.52
002296	博瑞科技	5,663,351.85	4.48
000938	新 华 大	5,475,848.90	4.34
600199	金 子 王	5,379,690.00	4.26
000571	恒康达	5,372,301.02	4.17
600702	冠脉医疗	5,151,107.46	4.08
600027	华电国际	5,150,580.00	4.08
002139	拓邦股份	4,906,809.18	3.89
000200	新源药业	4,893,999.22	3.88
002688	雷迪欧	4,771,438.54	3.73
002375	爱康医疗	4,709,630.20	3.73
600526	泰达环保	4,647,254.22	3.68
300251	光讯科技	4,598,475.00	3.64
601117	中国化学	4,597,453.00	3.64
000731	四川美丰	4,570,289.00	3.62
600406	国电南瑞	4,486,676.75	3.55
600000	浦发银行	4,334,179.00	3.43
600104	上汽集团	4,328,678.25	3.43
300296	利 亚 德	4,301,994.20	3.41
002022	科华生物	4,294,427.90	3.40
002630	华药集团	4,147,799.00	3.28
600509	天富热电	4,118,729.98	3.26
002385	大北农	3,993,004.00	3.16
300421	邦 基 电	3,963,759.00	3.14
300048	合康变频	3,890,249.32	3.08
300001	特 尔 索	3,790,538.14	3.00
002255	海陆重工	3,730,826.63	2.95
002335	科华恒盛	3,602,593.20	2.92
000423	东阿阿胶	3,689,527.85	2.92
002064	华峰铝业	3,632,298.00	2.88
600718	东软集团	3,553,833.00	2.81
600383	金地集团	3,517,000.00	2.78
002610	爱康科技	3,367,335.78	2.68
601928	凤凰传媒	3,357,331.00	2.66
600837	海康证券	3,322,200.00	2.63
300145	南方铝业	3,299,974.00	2.61
600422	恒明股份	3,277,583.19	2.60
600535	天 力 锂	3,261,500.00	2.58
002443	金 融 街	3,250,685.00	2.56
002444	金利来	3,251,736.00	2.55
002023	同 益 康	3,201,523.00	2.52
000888	峨边山A	3,186,271.92	2.52
002331	恒通科技	3,145,297.94	2.49
002325	普济药业	3,139,892.92	2.49
001233	阿 里 山	3,077,666.00	2.44
300059	杭州华富	3,004,540.18	2.38
600519	贵州茅台	2,999,662.30	2.38
300032	国 有 科	2,999,544.97	2.38
002153	云富信息	2,961,293.00	2.34
300271	宇 通 科	2,911,262.00	2.31
002421	达 智 能	2,897,357.72	2.28
600739	辽宁成大	2,888,443.00	2.26
300037	新 田 矿	2,716,897.49	2.17
000661	农 产 品	2,715,000.00	2.15
000430	张家界	2,675,164.92	2.12
000970	中科三环	2,658,318.00	2.10
002140	东华科技	2,621,864.88	2.08
002557	洽 洽 食	2,611,043.72	2.07
600511	国药股份	2,594,345.11	2.05
300224	正海磁材	2,577,256.00	2.04
300074	华 平 股	2,555,813.60	2.02
300267	尔康制药	2,531,397.00	2.00