

# 信息披露 Disclosure

## 资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.4.2 基金托管费

8.4.3 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	71,420,229.75
卖出股票收入(成交)总额	82,204,044.20

注:“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑交易费用。

例:不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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及衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证及衍生品。

8.10 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券中包括中国平安(股票代码:601318)。

根据中国平安财产保险股份有限公司于2013年5月21日和2013年10月14日发布的公告,该上市公司的控股股东平安证券有限责任公司在保荐方民生证券(湖南)农业开发股份有限公司发行上市过程中受到中国证监会监督管理委员会的行政处罚,罚款金额为5,110万元,同时其保荐机构资格被暂停3个月。

在上述公告发布后,本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中国平安的资产价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报导编制日前一年内受到过行政处罚的情况。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成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	24,824.36
2	应收证券清算款	-
3	应收账款	-
4	应收利息	2,703.70
5	应收股息	6,225.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,753.35

7.4.4.2.1 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.4.4.2.2 期末持有的处于流通受限状态的债券

注:本基金本报告期末未持有处于流通受限状态的债券。

7.4.4.2.3 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.4.4.2.4 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

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报导期末(2014年1月6日)和上年度末均未持有本基金份额。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期无运用闲置资金投资本基金的情况。

7.4.4.5 其他关联交易的说明

注:本基金本报告期无关联交易。

7.4.4.6 报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报导期末(2014年1月6日)和上年度末均未持有本基金份额。

7.4.4.7 与关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期无与关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.4.8 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.9 各关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期无运用闲置资金投资本基金的情况。

7.4.4.10 报告期各关联方之间是否存在关联交易

注:本基金本报告期无关联交易。

7.4.4.11 股票交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.12 债券回购交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.4.13 权证交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.14 应付关联方的佣金

注:本基金管理费按一日的基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=每日基金资产净值×0.5%当年天数

H为每日应付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金

资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.5 与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期无与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.6 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.7 各关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期无运用闲置资金投资本基金的情况。

7.4.8 报告期各关联方之间是否存在关联交易

注:本基金本报告期无关联交易。

7.4.9 报告期与基金管理人及其子公司的关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的关联交易。

7.4.10 报告期与基金管理人及其子公司的重大关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的重大关联交易。

7.4.11 股票交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.12 债券回购交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.13 权证交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.14 应付关联方的佣金

注:本基金管理费按一日的基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=每日基金资产净值×0.5%当年天数

H为每日应付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金

资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.15 与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期无与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.16 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.17 各关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期无运用闲置资金投资本基金的情况。

7.4.18 报告期各关联方之间是否存在关联交易

注:本基金本报告期无关联交易。

7.4.19 报告期与基金管理人及其子公司的关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的关联交易。

7.4.20 报告期与基金管理人及其子公司的重大关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的重大关联交易。

7.4.21 基金管理费

注:本基金本报告期无基金管理费。

7.4.22 与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期无与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.23 关联方关系

注:本基金本报告期无与关联方的关系。

7.4.24 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化

注:本基金本报告期无存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.25 本报告期与基金管理人及其子公司的关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的关联交易。

7.4.26 本报告期与基金管理人及其子公司的重大关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的重大关联交易。

7.4.27 与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期无与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.28 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.29 各关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期无运用闲置资金投资本基金的情况。

7.4.30 报告期各关联方之间是否存在关联交易

注:本基金本报告期无关联交易。

7.4.31 报告期与基金管理人及其子公司的关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的关联交易。

7.4.32 报告期与基金管理人及其子公司的重大关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的重大关联交易。

7.4.33 与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期无与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.34 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.35 各关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期无运用闲置资金投资本基金的情况。

7.4.36 报告期各关联方之间是否存在关联交易

注:本基金本报告期无关联交易。

7.4.37 报告期与基金管理人及其子公司的关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的关联交易。

7.4.38 报告期与基金管理人及其子公司的重大关联交易

注:本基金本报告期无与基金管理人及其子公司的重大关联交易。

7.4.39 与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期无与关联方的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.40 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均为未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。