

信息披露 disclosure

招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)

2014年度报告摘要

报告正文

R4.2 积极投资期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	HUNAN NON-METALS	湖南有色金矿股份有限公司	2626 HK	香港证券交易所	HK	150,000	459,122.34	0.96

注:以上证券均采用当地市场价格。

R5 报告期内权益投资期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	BANK OF COMMUNICATIONS	交通银行	3328 HK	1,566,847.79	2.03
2	CHINA MINSHENG BANKING	民生银行	1988 HK	785,515.39	1.02
3	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	农业银行	1288 HK	737,461.79	0.96
4	CTICC LTD	中远集团	267 HK	528,272.73	0.69
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	建设银行	939 HK	478,494.46	0.62
6	HUNAN AIRBUS	湖南航空	2626 HK	457,788.11	0.59
7	CHINA TELECOM CORP LTD	中国电信	728 HK	434,716.79	0.56
8	TATA MOTORS LTD	塔塔集团	TTM US	411,863.67	0.53
9	LENOVO GROUP LTD	联想集团	992 HK	397,660.38	0.52
10	PING AN INSURANCE GROUP CO	平安保险	2318 HK	351,764.75	0.46
11	ICBC BANK LTD	工商银行	IBN US	302,666.67	0.39
12	LUXOR LTD	卢浮集团	LKOD US	219,848.04	0.29
13	RELANCE INDS	印度信实	RIOD IN	102,366.46	0.13

注:以上“买入金额”按买入成交金额(或成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

R5.2 累计买入金额占期初基金资产净值2%或20%的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	BANK OF COMMUNICATIONS	3328 HK	2,846,880.87	3.70
2	CHINA CONSTRUCTION BANK	939 HK	2,236,122.67	2.89
3	TAU UNIBANCO HLDING	ITUB US	1,030,597.89	1.34
4	BAIDU INC	BDU US	1,924,859.08	2.50
5	CHINA MOBILE LTD	941 HK	1,744,172.79	2.26
6	BANCO BRASILEIRO	BBUS US	1,438,404.08	1.87
7	AMERICA	ABUS US	1,295,689.40	1.67
8	INDIA COMB BK OF CHINA	1398 HK	1,292,222.00	1.67
9	GAZPROM OAO	OGZD US	1,352,673.35	1.76
10	LUXOR LTD	LKOD US	1,244,192.11	1.62
11	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1288 HK	761,746.89	1.25
12	PETROLEO BRASILEIRO S.A.	PBR US	404,226.25	1.22
13	PETROCHINA CO LTD	857 HK	919,735.40	1.19
14	INFOSYS TECHNOLOGIES	INFY US	875,139.24	1.14
15	VALE SA	VALE US	859,917.62	1.12
16	CNOCCT LTD	883 HK	801,999.27	1.04
17	CHINA MINSHENG BANKING	1988 HK	733,522.28	0.95
18	SBERBANK	SBER US	699,388.22	0.91
19	BRFS SA	BRFS US	686,913.19	0.89
20	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL	386 HK	614,377.95	0.80

注:以上“卖出金额”按卖出成交金额(或成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

R5.2 累计卖出金额占期初基金资产净值2%或20%的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	2,846,880.87	3.70
2	CHINA CONSTRUCTION BANK	939 HK	2,236,122.67	2.89
3	TAU UNIBANCO HLDING	ITUB US	1,030,597.89	1.34
4	BAIDU INC	BDU US	1,924,859.08	2.50
5	CHINA MOBILE LTD	941 HK	1,744,172.79	2.26
6	BANCO BRASILEIRO	BBUS US	1,438,404.08	1.87
7	AMERICA	ABUS US	1,295,689.40	1.67
8	INDIA COMB BK OF CHINA	1398 HK	1,292,222.00	1.67
9	GAZPROM OAO	OGZD US	1,352,673.35	1.76
10	LUXOR LTD	LKOD US	1,244,192.11	1.62
11	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1288 HK	761,746.89	1.25
12	PETROLEO BRASILEIRO S.A.	PBR US	404,226.25	1.22
13	PETROCHINA CO LTD	857 HK	919,735.40	1.19
14	INFOSYS TECHNOLOGIES	INFY US	875,139.24	1.14
15	VALE SA	VALE US	859,917.62	1.12
16	CNOCCT LTD	883 HK	801,999.27	1.04
17	CHINA MINSHENG BANKING	1988 HK	733,522.28	0.95
18	SBERBANK	SBER US	699,388.22	0.91
19	BRFS SA	BRFS US	686,913.19	0.89
20	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL	386 HK	614,377.95	0.80

注:以上“卖出金额”按卖出成交金额(或成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

R5.2 累计卖出金额占期初基金资产净值2%或20%的权益投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	DIREXION DAILY BRAZIL	ETF	交易型开放式	Direxion Investments	619,944.49	1.29

R1.1 投资组合中前两位

R1.1.1 投资组合中前两位的十位证券中,存在未披露前10日内买入到公告前10日,或于报告期内

R1.1.2 本基金投资组合中前两位的十位证券中,没有超出合同规定的备选股票范围的股票。

R1.1.3 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.7 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.8 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.10 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.11 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.12 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.13 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.14 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.15 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.16 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.17 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.18 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.19 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.20 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.21 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.22 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.23 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.24 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.25 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.26 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.27 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.28 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.29 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.30 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.31 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.32 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.33 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.34 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.35 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.36 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.37 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.38 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.39 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.40 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.41 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.42 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.43 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.44 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.45 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.46 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.47 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.48 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.49 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.50 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.51 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.52 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.53 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.54 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.55 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.56 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.57 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.58 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.59 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.60 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.61 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.62 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.63 期末其他未披露资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,795.13
4	应收股利	488.49
5	应收申购款	332,108.08
6	其他应收款	284,993.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	424,045.73

R1.1.64 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

R1.1.65 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.66 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

R1.1.67 期末非指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明