

(上接B433版)

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额 占当期总成交金额的比例(%)

卖出证券 500,000,000.00 7.80

9.4.3.15 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额 占当期总成交金额的比例(%)

买入证券 1,384,603.27 8.36

卖出证券 457,266.91 5.32

佣金 234,835.26 1.42

费用 0.00 0.00

总计 1,884,603.27 8.36

金额单位:人民币元

海通证券 500,000,000.00 7.80

9.4.3.15 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额 占当期总成交金额的比例(%)

买入证券 366,697.97 2.43

卖出证券 0.00 0.00

9.4.3.16 其他与关联方相关的交易

注:上文所列金额和比例计算,在关联方公司间所发生的任何交易但不涉及买卖证券的,证券购销交易金额和占(卖)卖证券金额等,均以代理人为从关联方获得的其他服务主要,包括:为本基金提供的证券投资基金研究服务和柜台信息服务。

9.4.3.17 关联方应收款项

9.4.3.18 基金管理费

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期发生的基金应支付的管理费 14,603,386.70

9.4.3.19 费用的核算方法

注:本基金的管理费按每季1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.25% 其中:E为年基金资产总额

H为每日计价的基金资产总额

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

9.4.3.20 基金销售费用

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期发生的基金应支付的管理费 2,434,156.05

9.4.3.21 其他与关联方相关的交易

注:本基金的管理费按每季1.5%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25% 其中:E为年基金资产总额

H为每日计价的基金资产总额

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

9.4.3.22 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

9.4.3.23 各项关联交易佣金

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期发生的基金支付的佣金 0.00

9.4.3.24 公允价值变动损益

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期发生的基金公允价值变动损益 -10,000,000.00

9.4.3.25 其他收入

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期发生的利息收入 10,449,094.03

9.4.3.26 其他费用

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期发生的费用 5,074,547.01

9.4.3.27 海通证券

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期利息收入 52,651,651.85

9.4.3.28 其他收入

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期利息收入 1,300,760.67

9.4.3.29 其他费用

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期利息收入 60,009.00

9.4.3.30 其他收入

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期利息收入 21,002,028.29

9.4.3.31 其他费用

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期利息收入 1,035

9.4.3.32 转型前最近一日基金资产净值情况

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期利息收入 2,032,051.72

9.4.3.33 其他费用

金额单位:人民币元

项目 本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日 成交金额

当期利息收入 100.00

9.4.3.34 转型前最近一日为2014年4月29日

9.4.3.35 转型前最近一日按公允价值占基金资产净值比例排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号 股东代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 000233 富国银行 8,791,200.00 0.44

2 001086 广发银行 - -

3 000039 交通银行 783,906,000.00 38.88

4 000037 中国银行 783,906,000.00 38.88

5 000036 中国建设银行 17,679,941.10 0.88

6 000035 中国工商银行 17,679,941.10 0.88

7 000028 中信银行 204,292.26 0.01

8 其他 - -

9 合计 810,581,433.36 40.20

注:转型前的最近一日为2014年4月29日。

9.4.3.36 转型前最近一日按公允价值占基金资产净值比例排序的五只债券投资金额明细

金额单位:人民币元

序号 股东代码 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000233 富国银行 31,511,919.20 3.20

2 001033 广发银行 31,157,256.61 3.17

3 000039 交通银行 31,067,882.18 3.16

4 000032 中国银行 30,926,122.99 3.14

5 000033 中国建设银行 30,922,269.60 3.14

6 000028 中信银行 29,432,825.36 2.99

7 000015 东方航空 29,394,117.47 2.99

8 航天电子 29,241,564.72 2.97

9 合计 50,065,000.00 5.09

注:转型前的最近一日为2014年4月29日。

9.4.3.37 转型前最近一日按公允价值占基金资产净值比例排序的五只货币市场基金金额明细

金额单位:人民币元

序号 股东代码 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000233 富国银行 31,511,919.20 3.20

2 001033 广发银行 31,157,256.61 3.17

3 000039 交通银行 31,067,882.18 3.16

4 000032 中国银行 30,926,122.99 3.14

5 000033 中国建设银行 30,922,269.60 3.14

6 000028 中信银行 29,432,825.36 2.99

7 000015 东方航空 29,394,117.47 2.99

8 航天电子 29,241,564.72 2.97

9 合计 50,065,000.00 5.09

注:转型前的最近一日为2014年4月29日。

9.4.3.38 购买股票的成交金额

金额单位:人民币元

序号 股东代码 股票名称 成交金额(元) 占当期总成交金额的比例(%)

1 000233 富国银行 2,143,000,000.00 99.99

2 001033 广发银行 2,057,542.00 0.01

3 000039 交通银行 1,000,000.00 0.00

4 000032 中国银行 1,000,000.00 0.00

5 000033 中国建设银行 1,000,000.00 0.00

6 000028 中信银行 1,000,000.00 0.00

7 000015 东方航空 1,000,000.00 0.00

8 航天电子 1,000,000.00 0.00

9 000066 宁波银行 1,000,000.00 0.00

10 000240 四川成渝 1,000,000.00 0.00

11 000065 大秦铁路 1,000,000.00 0.00

12 000067 中国神华 1,000,000.00 0.00

13 000068 中国国航 1,000,000.00 0.00

14 000069 中国银行 1,000,000.00 0.00

15 000070 中国平安 1,000,000.00 0.00

16 000071 中国太保 1,000,000.00 0.00

17 000072 中国人寿 1,000,000.00 0.00

18 000073 中国石油 1,000,000.00 0.00

19 000074 中国铁建 1,000,000.00 0.00

20 000075 中国中铁 1,000,000.00 0.00

21 000076 中国交建 1,000,000.00 0.00

22 000077 中国