

C237

本基金报告期内与上年度可比期间发生承继期内参与关联方证券承继的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告基金本报告发生其他关联交易事项。本基金基金合同自2012年11月15日起生效,无上年可比期间。

6.4.9 报告期内(2013年5月30日)本基金发生的流通受限情况

6.4.9.1 因认购/申购/赎回发生证券并于期末持有流通受限或受限证券

本基金本报告期末未持有因认购/赎回发生证券而未流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时性流通受限证券

本基金本报告期末未持有暂时性流通受限证券。

6.4.9.3 期末持有的长期停牌股票

6.4.9.3.1 期末持有长期停牌交易方式中质押的证券

6.4.9.3.1.1 银行间市场债券正回购

本基金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440,649,120.32元,是以如下条件作为抵押:

债券代码	债券名称	到期兑付日	期末估值占市值	数量 (张)	期末估值总额
120414	12发14	2013年7月1日	99.52	850,000	84,592,000.00

金额单位:人民币元

2013年6月30日

20214	13月14日	2013年7月1日	100.16	1,000,000	100,160,000.00
120015	12月04日附息15	2013年7月1日	98.89	2,000,000	217,558,000.00
130205	13月05月05	2013年7月1日	101.83	530,000	53,960,900.00
合计	-	-	-	-	456,279,900.00

6.4.3.3.2 交易所市场公允价值确定

截至本报告期末2013年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币1,607,005,533.90元,于2013年7月1日:7月5日:7月22日止分别回购,该款项与基金卖出回购期内购入的在相同期间内买入相同类型的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易余额。

6.4.4 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(a) 公允价值

(i) 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不多。

(ii) 以公允价值计量的金融工具

金融工具公允价值计量的方法

根据公允价值计量时对于金融工具具有重大意义的最低层次的输入值,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中的报价(未经调整的,即可观察到)

第二层级:直接或间接(取自报价或其他)按市场价格推算的可靠数据,除第一层级中的市场报价以外资产或负债的输入值

第三层级:无法从市场上获取的数据为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)

于2013年6月30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金额为1,607,005,533.90元,属于第二层级的为2,634,569,000.00元,无属于第三层级的金额。

对于证券交易所上市的股票和债券,有出现重大事件停牌、交易不活跃(包括连续停牌的)交易无报价等情况,本基金不予停牌日交易价格或最近交易日交易价格区间及限售期前将相关股票和债券公允价值与最近收盘价或最近交易价格区间的不可能观察输入值对公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值,属于第三层级公允价值还是第二层级。

(n) 第三层级公允价值价值和第三层级公允价值

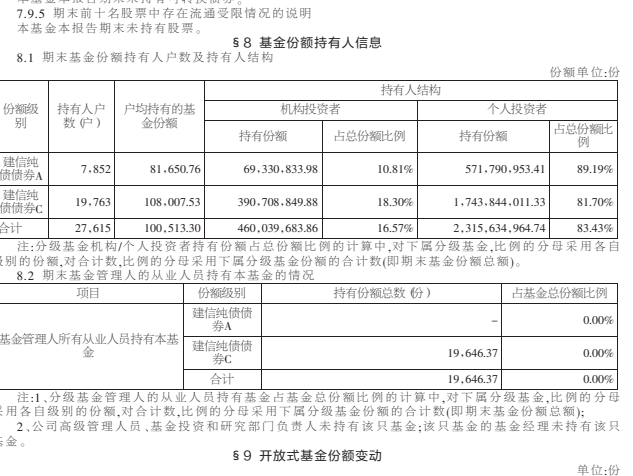
(o) 公允价值估值,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.1 期末基金资产净值情况

7.2 投资组合报告

序号	项目	金额	基金资产净值人民币元 占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他负债	-	-
7	资产净值	-	-
8	总资产	-	-

2	固定收益投资		4,241,574,533.90	93.81
	其中：债券		4,241,574,533.90	93.81
	资产支持证券		-	-
3	金融衍生品投资		-	-
4	买入返售金融资产		-	-
	其中：买入返售的买入返售金融资产		-	-
5	银行存款和结算备付金合计		171,442,169.76	3.79
6	其他各项资产		108,476.817.87	2.40
7	合计		4,521,493,521.53	100.00
7.2 期末按行业分类的股票投资组合				
本基金本报告期末未持有股票。				
7.3 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				
本基金本报告期末未持有股票。				
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动				
7.4.1 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				
本基金本报告期末未持有股票。				
7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细				
本基金本报告期末未持有股票。				
7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额				
本基金本报告期末未持有股票。				
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合				
				金额单位：人民币元
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例	
1	国家债券	390,099,254.00	13.75	
2	央行票据	-	-	
3	金融债券	833,828,000.00	29.32	
	其中：政策性金融债	752,140,000.00	26.45	
4	企业债券	2,023,927,279.90	71.18	
5	企业短期融资券	330,198,000.00	11.61	
6	中期票据	662,715,000.00	23.31	
7	可转债	-	-	
8	其他	-	-	
9	合计	4,241,574,533.90	149.16	
7.6 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				
				金额单位：人民币元
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值
1	120914	12国债14	3,390,000	371,556,000.00
2	120916	12国债16	2,000,000	222,000,000.00
3	120915	12国债15	2,000,000	222,000,000.00
4	120917	12国债17	2,000,000	222,000,000.00
5	120918	12国债18	2,000,000	222,000,000.00

[illegible][illegible]