

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	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东北证券	420,023,913.17	11.04%			
西南证券	234,227,555.66	6.03%		300,502,883.70	13.57%
第一创业	208,379,629.57	5.37%		25,708,865.95	1.16%

7.4.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单进行债券交易。

7.4.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单进行债券回购交易。

7.4.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单进行权证交易。

7.4.1.5 应支付关联方的佣金

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	
		当期佣金	占当期股票交易总额的占比	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的占比
东北证券	389,666.94	11.04%		130,526.80	9.50%
西南证券	212,732.53	6.03%		49,606.94	3.62%
第一创业	189,580.46	5.37%		162,274.32	11.82%

7.4.1.6 应支付关联方的利息

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	
		当期利息	占当期股票交易总额的占比	期末应付利息余额	占期末应付利息总额的占比
西南证券	269,724.24	14.03%		119,408.03	21.44%
第一创业	22,465.66	1.18%		198,480.45	36.18%

注：上述数据按市场利率计算，以目前中国信贷征信服务和证券交易的净额列示。该类关联方的服务费用范围包括包括关联方的基金业绩报酬的证券投资管理成果和市值信息费。

7.4.2 关联方报酬

7.4.2.1 基金管理费

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2013年12月31日	
		2013年1月1日至2013年12月31日	占基金资产净值的100%的费率比例	2012年1月1日至2013年12月31日	占基金资产净值的100%的费率比例
当期发生的基金应支付的管理费		13,413,759.78		5,537,434.19	
其中：支付管理人报酬的金额		488,495.90		263,987.66	

注：本基金管理人报酬=（本基金资产净值×1.00%的年费率）/计算天数/365。

HE=1.00%/当年天数

7.4.1.1 申购前一日的基金资产净值 申购前一日的基金资产净值=申购支付, 经基金托管人复核于次月首日起三个工作日内以基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日(含周末), 支付日期相应顺延。 7.4.1.2 基金托管费				
期间	本期	上年度可比期间		
2013年1月1日至2013年12月31日	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	2,662,755.95	1,071,486.72		
注:基金托管费指前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下: $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ H为每日应计提的托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,按月支付,经基金托管人复核后于次月首日起三个工作日内以基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日(含周末),支付日期顺延。 7.4.1.3 与关联方进行银行间同业市场的债券交易 注:本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券交易。 7.4.1.4 关联方资金往来 注:本基金未与关联方发生资金往来。 7.4.1.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 注:本基金的管理人未于报告期内、上年度计提和支付固有资金投资本基金。 7.4.1.6 报告期内基金管理人之外其他关联方投资本基金的情况				
份额单位:				
关联方名称	本期形式		报告期末	
	2013年12月31日		2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金已发行份额比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金已发行份额比例

	2.00	0.0005		0.005
注：基金管理人支付的其他各项与持有基金份额的费用相关的费用按照所公开的交易费率计算并支付。本基金除基金管理人支付之外其他相关费用均由基金份额持有人承担，包括但不限于：申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等。				
74.8.5 关于关联方保管的银行存款余额及产生的利息收入：				
单位：人民币				
关联方名称	本期		上年同期	
	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	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
	期初余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	163,525,536.21	927,619.99	1,146,053.99	327,565.70
74.8.6 中国银行在承销期间及与关联方承诺持仓的情况：				
注：本基金各主要券商均在发行及承销期间均持有在本承销期内的与关联方承诺持仓。				
74.8.7 关联交易公允性说明：				
本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。				



代码	行业类别	公允价值	金额单位：人民币
			占基金资产净值比例 (%)
A	农林牧渔业	-	-
B	采矿业	788,750,740.89	61.21
C	制造业	356,583,414.49	27.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-

S	合计			1,216,328,936.56	7.56
K.2.2 期末股权投资资产公允价值变动损益投资组合					
注：本基金合同及招募说明书未持有和计划投资股票。					
K.1.1 期末持有的公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含国债逆回购）					
K.1.1.1 期末持有的按公允价值计量的权益类资产净值大于或等于 20% 的前五名证券投资					
					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	占期末净资产比例 （%）
1	601088	中国神华	8,792,609	139,099,074.38	10.79
2	600111	招商轮船	3,474,228	72,394,057.58	5.70
3	602756	恒顺醋业	8,531,794	72,994,679.56	5.66
4	601857	中国石油	9,300,558	71,707,302.18	5.60
5	000088	中国石化	14,710,715	65,872,643.20	5.11
6	600547	山东黄金	2,864,800	49,438,455.25	3.88
7	601899	紫金矿业	21,642,770	49,059,618.70	3.71
8	600489	中金黄金	3,923,268	33,543,941.40	2.60
9	000043	江西铜业	2,321,047	31,311,086.48	2.44
10	000060	四川信托	9,281,420	29,321,434.20	2.31
注：报告期内，本基金尚未结束基金资产配置资产的持有期说明；如报告期末无基金管理人选定，可参见 www.cmfund.com.cn 的“重要提示”文。					
K.1.2 期末股权投资公允价值公允价值变动损益投资组合					
注：本基金合同及招募说明书未持有和计划投资股票。					
K.1.2.1 期末持有的公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含国债逆回购）					
K.1.2.1.1 本基金公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净值大于或等于 20% 的前 20 名的证券投资					
					金额单位：人民币元
序号	股票代码	股票名称	本期买入支付金额	占期末净资产比例 （%）	

2	600256	广汇能源	181.70,059.80	20.17
3	600111	包钢稀土	165.82,261.63	18.41
4	601057	中国石油	123.627,981.70	12.52
5	600028	中国石化	112.94,032.03	12.74
6	601599	紫金矿业	91.837,939.38	10.20
7	600547	山东黄金	69.129,292.91	7.67
8	600049	中金黄金	65.275,517.18	7.26
9	600362	江西铜业	62.799,950.48	6.97
10	000083	西山煤电	58.064,460.21	6.45
11	601699	潞安环能	52.238,385.77	5.80
12	601168	西部矿业	50.526,287.30	5.61
13	600348	内蒙电力	49.759,618.58	5.32
14	000831	五矿稀土	46.632,862.69	5.18
15	600060	中金岭南	45.579,176.46	4.96
16	601600	中国铝业	45.504,740.03	5.05
17	600549	厦门钨业	44.598,686.95	4.95
18	601898	中煤能源	43.481,474.24	4.83
19	600123	兰花科创	40.213,735.28	4.46
20	600497	德龙铝材	39.104,497.59	4.36
21	000630	铜铝有色	37.498,418.18	4.14
22	601958	金矿有色	36.718,501.30	4.08
23	600758	中铝国际	35.801,145.57	3.97
24	000516	方大集团	33.151,680.05	3.68
25	600157	永泰能源	31.973,982.17	3.55
26	000878	云南铜业	31.027,125.53	3.45
27	601666	平煤股份	29.180,747.33	3.28
28	600188	兖州矿业	28.638,617.35	3.14
29	000960	铜业有色	26.737,407.93	2.97
30	600119	南山铝业	26.475,386.85	2.94
31	000037	鲁丰矿业	22.417,171.17	2.43
32	000933	神火股份	25.686,593.38	2.85
33	002155	郑州矿产	24.805,319.54	2.75
34	600259	广晟有色	22.730,136.66	2.52
35	600403	大有能源	22.171,028.93	2.46
36	002428	云南铜业	21.496,668.55	2.39
37	600198	洛阳钼业	21.196,418.72	2.35
38	600018	中国铝业	21.188,016.41	2.34
39	601091	大同电力	19.420,922.58	2.16
40	000969	安泰科技	19.218,049.21	2.13
41	600971	恒顺矿业	18.298,028.89	2.03
42	601101	吴华能源	18.082,079.56	2.01

[illegible]

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：5 基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票持仓存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末按投资数量前十名股票中在流通受限情况下的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金资产净值比例	流通受限情况说明
1	600047	山东黄金	49,038,455.25	3.81	重大资产重组

注：5 基金本报告期前五名股票中不存在流通受限的情况

注：6 基金本报告期末未持有和视同持有股票

8.9.6 投资组合报告期末的其他金融资产情况

由于持仓本金的原因, 占比为 0 的分项之和与合计可能略有误差。

5.9 基金持有人结构及前十名基金持有人信息

9.1 期末基金基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：元

份额类别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
货币A类	711	520,938.70	306,864,260.00	82.85%	63,523,158.00	17.15%
货币C类	13,700	49,553.37	131,455,540.00	2.79%	42,925,180.00	76.96%
货币B类	3,101	119,770.87	227,545,834.00	61.26%	143,891,857.87	38.74%
合计	12,512	74,096.66	666,066,034.00	91.34%	210,339,895.87	88.66%

序号	持有人名称	持有股份(份)	占上市总股份比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	57,196,688.00	15.45%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	41,855,860.00	11.30%
3	红塔证券股份有限公司	32,187,998.00	8.69%
4	中国太平洋财产保险股份有限公司-补充-CTD01-寿险	31,356,460.00	8.47%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品-020-CTD01-寿险	25,381,410.00	6.85%
6	中国太平洋集团股份有限公司-传统-集团持有资金-020-CTD01-寿险	18,157,700.00	4.94%
7	东亚资管-招行-东方汇智-3号集合资产管理计划	13,160,585.00	3.55%
8	东亚资管-招行-东方汇智-7号集合资产管理计划	8,013,997.00	2.16%
9	华安信托有限责任公司-金元宝-定期和活期投资集合资金信托计划	7,881,911.00	2.13%
10	中国人寿资产管理有限公司-中国人寿年金计划-01期	6,482,556.00	1.73%

序号	持有人名称	持有股份(份)	占上市总股份比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	24,300,000.00	4.32%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	24,000,000.00	4.32%
3	中国太平洋财险 集团 投资-普通保险产品	21,867,792.00	3.94%
4	中国太平洋财产保险股份有限公司-补充-普通保险产品-010X-CTD01-寿险	21,427,276.00	3.86%
5	广州市广百股份有限公司	18,440,820.00	3.32%
6	中国太平洋集团股份有限公司-传统-集团持有资金-020-CTD01-寿险	10,474,710.00	1.89%
7	王磊	5,418,921.00	0.98%
8	融通证券股份有限公司-沪广自贸易得正收益资产证券化	5,009,944.00	0.91%
9	融通证券股份有限公司-沪广自贸易得正收益资产证券化-01期	4,546,460.00	0.79%
10	安信证券股份有限公司-安信资管交易员易得正收益资产证券化	3,755,500.00	0.68%

注：以上信息中持有人名称及持有股份数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

93 期末基金管理人的从业人员持有本基金的股票

	货币资金	99.00	0.00%
基金管理人所有人员持有本基金	货币资金	71.00	0.00%
	货币资金	25,506.96	0.01%
	合计	25,708.96	0.01%

注：1、对于分级基金，下属各级份额的比例由母基金单位级数的比例，合计占比的比例采用期末基金总资产计算。

2、基金实际控制人、基金管理人高级管理人员、基金投资研究部门1负责人持有本基金基金份额总数的数量均为0；本基金的基金托管人持有本基金基金份额的数量均为0。

5.10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华金瑞	银华鑫瑞	银华誉瑞
基金合同生效日至 2011 年 12 月 8 日 基金份额总额	-	-	1,301,965,701.68
本报告期期初基金份额总额	333,399,811.00	500,099,721.00	1,119,318,519.00
本报告期基金份额申购总额	-	-	3,755,474,738.62
减：本报告期基金份额赎回总额	-	-	1,854,370,794.55
本报告期基金份额净变动额	36,987,665.00	55,481,407.00	-1,648,095,050.35
本报告期末基金份额总额	370,387,476.00	555,581,128.00	371,437,373.67

注：报告期末的基金份额总额与基金二级份额之间差额为因申购赎回产生的基金份额折算误差。

5.11 基金管理人、基金托管人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

5.1.1 重大事件提示

5.1.2 基金管理人、基金托管人的有《证券投资基金法》的重大人事变动

5.1.2.1 2013 年 12 月 2 日，本基金管理人发布关于副总经理郑康民的公告，经本基金管理人董事会决议，郑康民先生自 2013 年 12 月 2 日起不再担任本基金管理人副总经理职务。

5.1.2.2 2013 年 12 月 2 日，本基金管理人发布关于副总经理郑康民的公告，经本基金管理人董事会决议，陆文俊先生自 2013 年 9 月 9 日起不再担任本基金管理人副总经理职务。

5.1.2.3 2013 年 11 月 19 日，本基金管理人发布关于副总经理郑康民的公告，肖勇先生辞去中国银河证券股份有限公司董事职务。

5.1.2.2.2 2013 年 6 月 17 日中国银河证券股份有限公司公告，肖勇先生辞去中国银河证券股份有限公司董事职务。

5.1.2.2.2.2 2013 年 6 月 17 日中国银河证券股份有限公司公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生担任中国银河证券股份有限公司董事长，执行董事长职务并兼任公司主要发起人。

5.1.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，不涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

[illegible]