

(续前B16)续

注1: 申购期间/基金份额红利再投资情况
注2: 基金管理人投资本基金合同约定的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的相关规定执行。
6.2.4.4.4 报告期内本基金管理人及其他关联方投资本基金的情况
本基金在报告期内未持有其他关联方投资本基金的情况
本基金在报告期未持有其他关联方投资本基金的情况
6.2.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方	期末余额	本期	当期利息收入
中国建设银行	7,884,616.22	3,057.03	

注:本基金定期银行存款由基金托管人中国建设银行计提,银行理财产品利息。
6.2.4.6 本基金在报告期内与关联方共同投资的情况
6.2.4.7 其他关联交易事项说明
6.2.4.8 报告期内本基金管理人及其他关联方投资本基金的情况
6.2.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.2.4.9.1 因认购失败/增发定向发行/期末持有的流通受限证券
本基金在报告期内未持有因认购失败/增发定向发行而流通受限的证券。
6.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券
本基金在报告期内未持有暂时停牌等流通受限证券。
6.2.4.9.3 交易所上市证券停牌期间的估值处理
本基金在报告期内未持有交易所上市证券停牌期间的估值处理。
6.2.4.9.4 银行间市场债券正回购,因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
6.2.4.9.5 交易所上市证券正回购,因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
6.2.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
(如适用)

(b)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很小。
6.2.5.1 应收款项
6.2.5.2 其他金融资产
6.2.5.3 其他金融负债
6.2.5.4 其他金融资产
6.2.5.5 其他金融负债
6.2.5.6 其他金融资产
6.2.5.7 其他金融负债
6.2.5.8 其他金融资产
6.2.5.9 其他金融负债
6.2.5.10 其他金融资产
6.2.5.11 其他金融负债
6.2.5.12 其他金融资产
6.2.5.13 其他金融负债
6.2.5.14 其他金融资产
6.2.5.15 其他金融负债
6.2.5.16 其他金融资产
6.2.5.17 其他金融负债
6.2.5.18 其他金融资产
6.2.5.19 其他金融负债
6.2.5.20 其他金融资产
6.2.5.21 其他金融负债
6.2.5.22 其他金融资产
6.2.5.23 其他金融负债
6.2.5.24 其他金融资产
6.2.5.25 其他金融负债
6.2.5.26 其他金融资产
6.2.5.27 其他金融负债
6.2.5.28 其他金融资产
6.2.5.29 其他金融负债
6.2.5.30 其他金融资产
6.2.5.31 其他金融负债
6.2.5.32 其他金融资产
6.2.5.33 其他金融负债
6.2.5.34 其他金融资产
6.2.5.35 其他金融负债
6.2.5.36 其他金融资产
6.2.5.37 其他金融负债
6.2.5.38 其他金融资产
6.2.5.39 其他金融负债
6.2.5.40 其他金融资产
6.2.5.41 其他金融负债
6.2.5.42 其他金融资产
6.2.5.43 其他金融负债
6.2.5.44 其他金融资产
6.2.5.45 其他金融负债
6.2.5.46 其他金融资产
6.2.5.47 其他金融负债
6.2.5.48 其他金融资产
6.2.5.49 其他金融负债
6.2.5.50 其他金融资产
6.2.5.51 其他金融负债
6.2.5.52 其他金融资产
6.2.5.53 其他金融负债
6.2.5.54 其他金融资产
6.2.5.55 其他金融负债
6.2.5.56 其他金融资产
6.2.5.57 其他金融负债
6.2.5.58 其他金融资产
6.2.5.59 其他金融负债
6.2.5.60 其他金融资产
6.2.5.61 其他金融负债
6.2.5.62 其他金融资产
6.2.5.63 其他金融负债
6.2.5.64 其他金融资产
6.2.5.65 其他金融负债
6.2.5.66 其他金融资产
6.2.5.67 其他金融负债
6.2.5.68 其他金融资产
6.2.5.69 其他金融负债
6.2.5.70 其他金融资产
6.2.5.71 其他金融负债
6.2.5.72 其他金融资产
6.2.5.73 其他金融负债
6.2.5.74 其他金融资产
6.2.5.75 其他金融负债
6.2.5.76 其他金融资产
6.2.5.77 其他金融负债
6.2.5.78 其他金融资产
6.2.5.79 其他金融负债
6.2.5.80 其他金融资产
6.2.5.81 其他金融负债
6.2.5.82 其他金融资产
6.2.5.83 其他金融负债
6.2.5.84 其他金融资产
6.2.5.85 其他金融负债
6.2.5.86 其他金融资产
6.2.5.87 其他金融负债
6.2.5.88 其他金融资产
6.2.5.89 其他金融负债
6.2.5.90 其他金融资产
6.2.5.91 其他金融负债
6.2.5.92 其他金融资产
6.2.5.93 其他金融负债
6.2.5.94 其他金融资产
6.2.5.95 其他金融负债
6.2.5.96 其他金融资产
6.2.5.97 其他金融负债
6.2.5.98 其他金融资产
6.2.5.99 其他金融负债
6.2.5.100 其他金融资产

6.2.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
(如适用)

7.1 投资组合报告

7.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	其他	-	-
7	合计	10,442,342.60	100.00

注:上表为本基金在报告期最后一日(2014年5月20日)的基金资产组合情况。

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额	占基金股票资产的比例(%)
1	医药生物	-	-
2	食品饮料	-	-
3	公用事业	-	-
4	交通运输	-	-
5	其他	-	-
6	合计	-	-

7.1.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末公允价值	占基金股票资产净值的比例(%)
1	009322	沃森生物	29,000	2,900,283.14	2.74
2	001914	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	期末公允价值	占基金债券资产净值的比例(%)
1	091932	沃森转债	29,000	2,900,283.14	2.74
2	001914	招商转债	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.6 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

序号	贵金属名称	数量(克)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.7 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权证投资明细

序号	权证名称	数量(份)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓量和损益明细

序号	股指期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.15 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.16 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.18 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.19 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.21 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.22 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.23 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.24 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.25 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.26 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.27 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.28 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.29 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.30 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.31 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.32 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.33 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,879,152.11	2.73

7.1.34 报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

序号	国债期货名称	数量(元)	期末公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	招商公路	29,000	2,900,283.14	2.74
2	招商公路	28,700	2,87	