诺安灵活配置混合型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2009年8月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安灵活配置混合
交易代码	320006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月20日
报告期末基金份额总额	308,278,042.26份

2.2 基金产品说明

投资目标	积极调整,稳健投资,力图在将风险控制在一定水平的基础上获得超过比较基准的投资收益。
投资策略	本基金实施积极主动的投资策略,具体由资产配置策略,股票投资策略,债券投资策略和权证投资策略四部分组成。 ①在资产配置方面,本基金自上而下进行,具体由类别资产配置和行业资产配置组成。 ②在股票投资方面,本基金综合运用优势企业增长策略、内在价值低估策略、景气回归上升策略这三种策略构建股票组合。 ③在债券投资方面,本基金将实施利率预测策略、收益率曲线模拟、收益率溢价策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。 ④在权证投资方面,本基金主要运用的策略包括:价值发现策略、价差策略、对敲策略、卖出有担保的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等,作为辅助性投资工具,本基金会结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准是沪深300指数以及上证国债指数的复合指数即: 60%×沪深300指数+40%×上证国债指数 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
风险收益特征	较高风险,较高收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	蒋松云
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年01月01日至2009年06月30日)
本期已实现收益	108,417,734.49
本期利润	132,492,169.78
加权平均基金份额本期利润	0.3080
本期基金份额净值增长率(%)	34.30
3.1.2 期末数据和指标	
期末可供分配基金份额利润	0.0791
期末基金资产净值	338,175,764.57
期末基金份额净值	1.097

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.81%	0.73%	8.58%	0.73%	1.23%	0.00%
过去三个月	17.32%	0.91%	15.38%	0.93%	1.94%	-0.02%
过去六个月	34.30%	1.01%	40.35%	1.17%	-6.05%	-0.16%
过去一年	26.42%	0.89%	13.01%	1.54%	13.41%	-0.65%
自基金合同生效起至今	20.60%	0.86%	-7.34%	1.59%	27.94%	-0.73%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]132号文批准设立,公司股东为中国对外经济贸易信托有限公司、深圳市捷隆投资有限公司、北京中关村科学城建设股份有限公司,公司注册资本为1.5亿元人民币。公司建立了完善的内部风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理制度、人力资源管理制度、信息披露制度、信息技术管理制度、基金会计核算制度、基金销售管理制度、保密制度、紧急应变制度、授权管理制度、资料档案管理制度等公司管理制度体系。截至2009年6月30日,公司共管理八只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林健标	本基金的基金经理、诺安平衡证券投资基金的基金经理。	2008年5月20日	-	5	英国CASS商学院MBA毕业。1996年9月至2002年8月,任广东移动通信有限责任公司工程师;2003年10月至2004年8月,任博时基金管理有限公司区域经理;2004年10月至2006年6月,任华西证券研究员;2006年7月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2008年1月起担任诺安平衡证券投资基金基金经理,2008年5月起担任诺安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期为诺安灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安灵活配置混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程,并通过系统和人工等方式在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

今年上半年,在宏观财政及货币政策转向之后,延其经典作用路径,对国内经济产生了重大且深远的影响。政府投资和充裕流动性是推升A股市场在09年上半年走出低谷的决定性力量。正是基于对投资增速的乐观预期及对估值水平修复的判断,09年上半年本基金采取积极应对措施,适时提高权益投资比例,并强化了个股选择效用,取得了一定的投资业绩。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月23日召开的政治局会议再次明确了短期内宏观政策取向不会改变,依然表达出对经济复苏前景的担忧。即便7月份银行新增信贷出现环比显著回落,相信市场也早有所预期,短期市场依然有望维持“宽动性充裕”局面,推动本轮市场上涨的最初原动力依然存在。

随着各大地产公司中报披露,地产开工计划提升的趋势有望进一步得到确认,地产投资受益公司的相关投资主线依然值得重点关注。

此外,近期外围主要经济体的经济数据出现转好,尤其是美国房地产数据更令市场信心提振。若诚如之前业界预期,今年晚些时间主要发达经济体触底回升,那么从现在开始我们就需要重点关注出口部类可能存在的投资机会。

在短期市场强势依然有望延续的背景下,应时刻保持对市场潜在调整风险的警惕。不必赌何时调整,只要提前做好合理应对措施,更多采取灵活仓位应对市场可能存在的大幅波动风险,并将配置的重点放在个股选择上,在沿袭低估值、地产投资拉动和中报超预期三条选股主线之外,新增出口回暖高贝塔标的选择思路。

2010年是经济复苏之后企业盈利正常恢复的第一个完整年度,从目前的情况来看,2010年上市公司盈利增长前景仍是值得期待的,虽然存在阶段性性调整的可能,但总体上看,A股市场的上升周期预期仍将延续。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险管理人员、固定收益人员及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%,基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

本基金本期进行利润分配一次,共分配利润33,073,822.82元,每10份基金份额分红数为1.000元,符合本基金合同约定。

截至2009年06月30日,本基金可供分配而未分配利润为24,371,788.88元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2009年上半年,本基金托管人在诺安灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009年上半年,诺安灵活配置混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为33,073,822.82元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安灵活配置混合型证券投资基金2009年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2009年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	43,456,150.64	114,742,886.27
结算备付金	2,043,555.81	1,162,234.99
存出保证金	500,000.00	250,000.00
交易性金融资产	206,857,755.73	333,824,066.56
其中:股票投资	206,857,755.73	141,139,066.56
债券投资	0.00	192,685,000.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	50,000,000.00	0.00
应收证券清算款	41,031,240.25	0.00
应收利息	23,967.77	7,212,189.38
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	91,919.44	19,646.37
其他资产	0.00	0.00
资产总计	344,004,589.64	457,211,023.57
负债和所有者权益	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008年12月31日
负债:		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	2,688,924.33	1,279,889.22
应付管理人报酬	424,064.54	605,654.69
应付托管费	70,677.46	100,942.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,936,668.60	446,568.04
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	708,490.14	604,823.64
负债合计	5,828,825.07	3,037,878.05
所有者权益:		
实收基金	308,278,042.26	505,716,353.76
未分配利润	29,897,722.31	-51,543,208.24
所有者权益合计	338,175,764.57	454,173,145.52
负债和所有者权益总计	344,004,589.64	457,211,023.57

注:报告截止日2009年06月30日,基金份额净值1.097元,基金份额总额308,278,042.26份。

6.2 利润表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上年度可比期间 2008年05月20日至2008年06月30日
一、收入	141,539,676.91	-37,055,631.33
1.利息收入	2,541,083.82	1,139,509.49
其中:存款利息收入	420,199.73	539,246.07
债券利息收入	2,113,026.94	425,051.28
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	7,857.15	175,212.14
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益(损失以“-”填列)	114,470,671.95	-2,797,305.87
其中:股票投资收益	114,424,571.50	-3,101,685.93
债券投资收益	-1,343,990.00	114,248.22
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	1,390,090.45	190,131.84
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	24,074,435.29	-35,402,860.83
4.其他收入(损失以“-”号填列)	453,485.85	5,025.88
二、费用(以“-”号填列)	-9,047,507.13	-2,104,459.07
1.管理人报酬	-3,209,652.47	-1,410,170.22
2.托管费	-534,942.10	-235,028.37
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-5,095,321.47	-458,346.98
5.利息支出	0.00	0.00
其中:卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6.其他费用	-207,591.09	-913.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	132,492,169.78	-39,160,090.40

注:本基金基金合同于2008年5月20日生效,故可比期间为2008年05月20日至2008年06月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	505,716,353.76	-51,543,208.24	454,173,145.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	132,492,169.78	132,492,169.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-197,438,311.50	-17,977,416.41	-215,415,727.91
其中:1.基金申购款	145,938,650.28	-940,338.61	144,998,311.67
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-343,376,961.78	-17,037,077.80	-360,414,039.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-33,073,822.82	-33,073,822.82
五、期末所有者权益(基金净值)	308,278,042.26	29,897,722.31	338,175,764.57

项目	上年度可比期间 2008年05月20日至2008年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	857,290,847.05	-	857,290,847.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-39,160,090.40	-39,160,090.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
其中:1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	857,290,847.05	-39,160,090.40	818,130,756.65

注:本基金基金合同于2008年5月20日生效,故可比期间为2008年05月20日至2008年06月30日。

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人
中国工商银行股份有限公司	托管人

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及其上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及其上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及其上年度可比期间没有支付给关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上年度可比期间 2008年05月20日至2008年06月30日
当期应支付的管理费	3,209,652.47	1,410,170.22
其中:当期已支付	2,785,587.93	386,023.13
期末未支付	424,064.54	1,024,147.09

A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

B. 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上年度可比期间 2008年05月20日至2008年06月30日
当期应支付的托管费	534,942.10	235,028.37
其中:当期已支付	464,264.64	64,337.19
期末未支付	70,677.46	170,691.18

A. 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

B. 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2009年01月01日至2009年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	99,555,356.16	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

上年度可比期间 2008年05月20日至2008年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	60,009,041.10	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及其上年度可比期间基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末基金管理人主要股东及其控制机构未持有本基金的基金份额。

6.4.4.5 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

关联方名称	本期 2009年01月01日至2009年06月30日		上年度可比期间 2008年5月20日至2008年6月30日	
	期末余额	期末余额	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	43,456,150.64	404,241.04	11,072,673.83	537,139.04

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及其上年度可比期间承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.5 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期期末未持有因认购新发或增发而流通受限证券。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止,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为0.00元,无债券作为抵押。

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止,本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0.00元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券,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的余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	206,857,755.73	60.13
	其中:股票	206,857,755.73	60.13
2	固定收益投资	0.00	0.00
	其中:债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	14.53
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	45,499,706.45	13.23
6	其他资产	41,647,127.46	12.11
7	合计	344,004,589.64	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,916,800.00	3.82
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	78,589,701.24	23.24
C0	食品、饮料	10,360,700.00	3.06
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,495,791.83	2.81
C5	电子	4,185,000.00	1.24
C6	金属、非金属	13,462,500.00	3.98
C7	机械、设备、仪表	12,649,486.72	3.74
C8	医药、生物制品	22,159,292.19	6.55
C99	其他制造业	6,276,930.50	1.86
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	22,190,120.00	6.56
F	交通运输、仓储业	9,425,100.00	2.79
G	信息技术业	39,029,306.74	11.54
H	批发和零售贸易	7,569,647.90	2.24
I	金融、保险业	23,183,470.00	6.86
J	房地产业	11,191,209.85	3.31
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化产业	2,762,400.00	0.82
M	综合类	0.00	0.00
	合计	206,857,755.73	61.17

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	600487	亨通光电	1,266,279	26,667,835.74	7.89
2	601390	中国中铁	2,500,000	16,975,000.00	5.02
3	600251	冠农股份	520,000	12,916,800.00	3.82
4	000063	中兴通讯	439,910	12,361,471.00	3.66
5	601628	中国人寿	425,000	11,708,750.00	3.46
6	601318	中国平安	232,000	11,474,720.00	3.39
7	600082	海泰发展	1,349,965	11,191,209.85	3.31
8	600519	贵州茅台	70,000	10,360,700.00	3.06
9	600688	S上石化	1,139,951	9,495,791.83	2.81
10	601006	大秦铁路	890,000	9,425,100.00	2.79

提示:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.lionfund.com.cn网站的半年度报告正文。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000581	威孚高科	60,440,062.34	13.31
2	600487	亨通光电	57,125,743.22	12.58
3	600030	中信证券	40,206,954.26	8.85
4	600693	东百集团	36,266,019.02	7.99
5	600036	招商银行	35,603,886.68	7.84
6	000623	吉林敖东	34,641,223.30	7.63
7	600019	宝钢股份	34,002,317.97	7.49
8	000876	新希望	32,629,773.19	7.18
9	600861	北京城乡	32,289,852.27	7.11
10	601006	大秦铁路	30,638,765.89	6.75
11	000629	攀钢钒钛	28,800,000.00	6.34
12	000002	万科A	28,303,567.00	6.23
13	000538	云南白药	27,999,983.19	6.17
14	600001	邯郸钢铁	27,015,926.16	5.95
15	601390	中国中铁	25,368,600.00	5.59
16	000709	唐钢股份	23,686,424.43	5.22
17	601939	建设银行	23,346,597.00	5.14
18	000729	燕京啤酒	21,545,043.77	4.74
19	601628	中国人寿	20,807,082.74	4.58
20	600185	*ST海星	20,724,915.86	4.56
21	600221	海南航空	20,616,120.53	4.54
22	600770	综艺股份	20,414,939.02	4.49
23	601919	中国远洋	20,196,664.80	4.45
24	002109	兴化股份	19,675,647.60	4.33
25	000525	红太阳	19,675,288.82	4.33
26	000679	大连友谊	19,435,590.41	4.28
27	601166	兴业银行	19,332,143.24	4.26
28	600284	浦东建设	18,781,751.72	4.14
29	000951	中国重汽	18,588,887.19	4.09
30	601328	交通银行	17,644,831.00	3.89
31	600518	康美药业	17,416,557.80	3.83
32	601318	中国平安	17,275,175.36	3.80
33	600082	海泰发展	16,993,256.90	3.74
34	000932	华菱钢铁	14,981,890.73	3.30
35	600519	贵州茅台	14,898,096.19	3.28
36	600887	*ST伊利	14,679,362.30	3.23
37	600005	武钢股份	14,422,800.00	3.18
38	600597	光明乳业	13,795,097.38	3.04
39	000063	中兴通讯	13,794,703.00	3.04
40	600583	海油工程	13,679,408.72	3.01
41	000999	三九医药	13,534,839.16	2.98
42	600251	冠农股份	13,481,832.48	2.97
43	601766	中国南车	13,468,199.00	2.97
44	600569	安阳钢铁	13,369,863.64	2.94
45	000014	沙河股份	13,249,396.69	2.92
46	002269	美邦服饰	13,208,759.34	2.91
47	002073	青岛软控	12,491,459.40	2.75
48	600386	北巴传媒	12,250,848.09	2.70
49	600498	烽火通信	12,207,750.40	2.69
50	600190	锦州港	12,174,596.86	2.68
51	600016	民生银行	12,006,900.00	2.64
52	600622	嘉宝集团	11,970,773.50	2.64
53	600418	江淮汽车	11,878,041.11	2.62
54	600380	健康元	10,722,810.02	2.36
55	600900	长江电力	10,694,467.76	2.35
56	600858	银座股份	10,668,795.14	2.35
57	600426	华鲁恒升	10,527,347.00	2.32
58	000759	武汉中百	10,480,647.29	2.31
59	600029	南方航空	10,441,382.45	2.30
60	002052	同洲电子	10,402,786.53	2.29
61	000652	泰达股份	10,387,659.97	2.29
62	600631	百联股份	10,301,845.20	2.27
63	000636	风华高科	10,075,663.84	2.22
64	600150	中国船舶	10,041,511.50	2.21
65	600688	S上石化	9,915,602.25	2.18
66	600062	双鹤药业	9,880,930.75	2.18
67	600595	中孚实业	9,867,710.16	2.17
68	600000	浦发银行	9,839,938.00	2.17
69	600787	中储股份	9,815,649.00	2.16
70	600423	柳化股份	9,710,239.50	2.14
71	600196	复星医药	9,510,167.00	2.09
72	002250	联化科技	9,239,782.66	2.03
73	600588	用友软件	9,123,206.35	2.01

注:本期累计买入金额按买卖成交金额计算,不考虑相关交易费用。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000581	威孚高科	57,958,985.48	12.76
2	000002	万科A	45,356,432.91	9.99
3	600487	亨通光电	44,913,101.01	9.89
4	600036	招商银行	44,370,759.36	9.77
5	600030	中信证券	42,051,313.78	9.26
6	000876	新希望	34,987,647.49	7.70
7	600693	东百集团	32,942,530.20	7.25
8	600861	北京城乡	32,758,605.52	7