诺安股票证券投资基金 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	诺安股票
交易代码	320003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月19日
报告期末基金份额总额	24,060,807,098.90份

2.2 基金产品说明

投资目标	以中国企业的比较优势和全球化发展为视角，发掘最具投资价值的企业，获得稳定的中长期资本投资收益。在主动投资的理念下，本基金的投资目标是取得超额利润，也就是在承担和控制市场风险的情况下，取得稳定的、优于业绩基准的中长期投资回报。
投资策略	本基金实施积极的投资策略。在资产类别配置层面，本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动，动态调整股票资产的配置比例；在此基础上本基金注重有中国比较优势和有国际化发展基础的优势行业的研究和投资；在个股选择层面，本基金通过对上市公司主营业务盈利能力和持续性的定量分析，挖掘具有中长期投资价值的股票；在债券投资方面，本基金将运用多种投资策略，力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	80%×新华富时A600指数+20%×新华富时中国国债指数
风险收益特征	本基金属于中高风险的股票型基金，通过合理的资产配置和投资组合的建立，有效地规避风险并相应地获得较高的投资收益。

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	-780,839,358.78
本期利润	8,714,798,719.80
加权平均基金份额本期利润	0.3555
本期基金份额净值增长率(%)	53.71
3.1.2 期末数据和指标	
期末可供分配基金份额利润	-0.1350
期末基金资产净值	24,451,958,532.18
期末基金份额净值	1.0163

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人申购或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期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。

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
过去一月	14.75%	1.06%	10.03%	0.90%	4.72%	0.16%
过去三月	23.01%	1.23%	18.45%	1.21%	4.56%	0.02%
过去六月	53.71%	1.46%	54.36%	1.56%	-0.65%	-0.10%
过去一年	17.49%	1.80%	13.12%	2.05%	4.37%	-0.25%
过去三年	148.27%	1.88%	94.60%	1.95%	53.67%	-0.07%
自基金合同生效起至今	283.51%	1.81%	187.12%	1.85%	96.39%	-0.04%

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		
杨谷	副总经理、投资总监、本基金的基金经理。	2006年2月22日	-	11	经济学硕士，CFA。1998年至2001年任平安证券公司综合研究所研究员；2001年至2003年任西北证券公司资产管理部研究员。2003年10月加入诺安基金管理有限公司，现任公司副总经理、投资总监。曾于2006年11月至2007年11月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理，2006年2月起任本基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离职日期均指公司作出决定并对外公告之日；

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，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，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《诺安股票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

本基金与诺安价值增长股票证券投资基金为投资风格相似的投资组合。报告期内，本基金的净值增长率为53.71%，诺安价值增长股票证券投资基金的净值增长率为46.92%，两者相差6.79个百分点。

根据业绩归因分析的结果，本基金的行业选择效用为10.18%，诺安价值增长股票证券投资基金的行业选择效用为5.60%。

具体而言，在报告期内，本基金重仓配置的前三大行业是银行、房地产和保险，各行业平均持有市值占资产净值的比重分别为15.88%、7.37%、5.92%；诺安价值增长股票证券投资基金重仓配置的前三大行业是银行、食品和房地产，各行业平均持有市值占资产净值的比重分别为11.41%、8.01%、7.73%。从2009年上半年股市走势看，金融及房地产行业的表现要好于食品行业。

因此，行业配置上的差异是造成两只基金净值增长率差异的主要原因。

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

2009年上半年，沪深300指数上涨超过74%，创出2008年6月11日以来的新高。诺安股票基金份额净值为1.016，创出2008年6月4日以来的新高，略微领先市场创出新高，累计净值也已经超过2007年6月22日分红时的水平，当时的沪深300指数是4051点，上证指数为4091点。当然，目前的份额净值距离最高位1.51元仍下跌了32.7%。这仍需要我们将来继续努力，挽回这部分损失。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

大盘股的估值仍不算高，这会对市场形成支持，大盘股在过去约2年的时间里大幅跑输小盘股，在目前的估值条件下，蓝筹股下半年的行情值得期待，蓝筹股走强，会有利于本基金的表现。

全球的流动性泛滥会让股票和商品的行情超预期，从今年的情况看，股票的行情比商品行情更火暴。股票的估值已经不低，目前的市场并不便宜，用2006-2008年最好的连续4个季度业绩作为计算基础，300指数成分股的PE平均在25倍左右，整个市场非ST股票的平均PE则在37倍左右。也许明年商品的行情会超过股票，但是市场可能会有一段时间停留在高的估值水平上，直到政府重新采取紧缩的政策。而这可能要等到就业情况明显好转以后。

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同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少一次，最多为六次；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。

本基金在2009年上半年弥补上年度亏损后，本期无可分配收益，根据基金合同规定，本基金本期不进行利润分配。

§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，本基金托管人在对诺安股票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，诺安股票证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安股票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，诺安股票证券投资基金未进行利润分配。

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股票证券投资基金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：诺安股票证券投资基金

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	2,999,930,177.11	5,676,566,625.97
结算备付金	24,880,752.63	17,703,211.14
存出保证金	2,864,280.06	2,115,634.44
交易性金融资产	21,409,674,234.19	10,877,633,298.52
其中：股票投资	21,409,674,234.19	10,875,592,355.92
债券投资	0.00	2,040,942.60
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	0.00	0.00
应收证券清算款	71,933,888.41	0.00
应收利息	566,695.23	1,156,314.36
应收股利	18,281,934.54	0.00
应收申购款	12,318,686.15	1,587,669.72
其他资产	0.00	0.00
资产总计	24,540,450,648.32	16,576,762,754.15
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	45,139,257.56	7,977,753.38
应付管理人报酬	28,493,641.02	21,954,515.12
应付托管费	4,748,940.15	3,659,085.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,502,732.59	2,907,403.60
应交税费	25,000.00	25,000.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	1,582,544.82	1,379,870.00
负债合计	88,492,116.14	37,903,627.95
所有者权益：		
实收基金	24,060,807,098.90	25,013,103,204.20
未分配利润	391,151,433.28	-8,474,244,078.00
所有者权益合计	24,451,958,532.18	16,538,859,126.20
负债和所有者权益总计	24,540,450,648.32	16,576,762,754.15

注：报告截止日2009年06月30日，基金份额净值1.0163元，基金份额总24,060,807,098.90份。

6.2 利润表

会计主体：诺安股票证券投资基金

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01月01日至2008年06月30日
一、收入	8,914,299,280.00	-14,880,523,517.80
1.利息收入	16,129,299.69	29,138,485.61
其中：存款利息收入	16,123,787.86	29,134,197.36
债券利息收入	5,511.83	4,288.25
资产支持证券利息收入	0	0
买入返售金融资产收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益(损失以"-"填列)	-599,528,078.17	-863,089,141.04
其中：股票投资收益	-738,544,857.06	-681,398,991.17
债券投资收益	1,089,875.05	27,353.48
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	-323,506,348.23
股利收益	137,926,903.84	141,788,844.88
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	9,495,638,078.58	-14,056,494,745.24
4.其他收入(损失以"-"号填列)	2,059,979.90	9,921,882.87
二、费用(以"-"填列)	-199,500,560.20	-319,829,729.81
1.管理人报酬	-150,126,425.51	-234,960,457.61
2.托管费	-25,021,070.88	-39,160,076.31
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-24,144,388.53	-45,495,112.82
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	-208,675.28	-214,083.07
三、利润总额(亏损总额以"-"填列)	8,714,798,719.80	-15,200,353,247.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安股票证券投资基金

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)	25,013,103,204.20	-8,474,244,078.00	16,538,859,126.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,714,798,719.80	8,714,798,719.80
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）	-952,296,105.30	150,596,791.48	-801,699,313.82
其中：1.基金申购款	1,076,821,635.55	-153,733,062.50	923,088,573.05
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-2,029,117,740.85	304,329,853.98	-1,724,787,886.87
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)	24,060,807,098.90	391,151,433.28	24,451,958,532.18
项目	上年度可比期间 2008年01月01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)	29,232,318,526.44	12,202,990,741.00	41,435,309,267.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,200,353,247.61	-15,200,353,247.61
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）	-3,172,411,029.63	-521,054,022.93	-3,693,465,052.56
其中：1.基金申购款	3,404,520,123.09	840,747,568.51	4,245,267,691.60
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-6,576,931,152.72	-1,361,801,591.44	-7,938,732,744.16
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)	26,059,907,496.81	-3,518,416,529.54	22,541,490,967.27

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与最近一期年度报告一致、除6.4.2.2外，会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告【2008】38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》有关规定，本基金自2008年9月16日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对本基金持有的长期停牌股票进行估值。

2009年5月18日，本基金所持有的长期停牌股票长江电力（股票代码600900）复牌。经与基金托管人协商一致，本公司决定自2009年5月18日起对长江电力（股票代码600900）恢复采用市价估值方法进行估值，以5月18日收盘价格计算，该估值方法的调整对本基金的基金资产净值的影响不超过0.25%。估值方法调整对本基金基金资产净值、当日损益的影响较小。

6.4.2.3 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
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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01月01日至2008年06月30日
当期应支付的管理费	150,126,425.51	234,960,457.61
其中：当期已支付	121,632,784.49	204,919,454.06
期末未支付	28,493,641.02	30,041,003.55

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01月01日至2008年06月30日
当期应支付的托管费	25,021,070.88	39,160,076.31
其中：当期已支付	20,272,130.73	34,153,242.36
期末未支付	4,748,940.15	5,006,833.95

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

本基金于本期及上年度可比期间与基金托管人无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

份额单位：份

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01月01日至2008年06月30日
期初持有的基金份额	149,317,687.04	149,317,687.04
期间认购总份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分增加的份额	0.00	0.00
期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	149,317,687.04	149,317,687.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	0.62	0.57

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同规定执行。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009年06月30日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
中国中化集团公司	184,236,997.79	0.77	184,236,997.79	0.71
深圳市捷隆投资有限公司	12,900,000.00	0.05	33,333,579.83	0.13

注：投资本基金费率按照本基金合同的规定执行。

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1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,999,930,177.11	16,028,464.51	6,134,595,981.11	29,041,057.10

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方成效证券的情况。

6.4.5 期末（2009年06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

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额
600229	青岛碱业	2009-06-24	2010-06-20	非公开网下发行	4.84	4.87	10,000,000	48,400,000.00	48,700,000.00

注：①可流通日以公告为准。

②本基金本报告期末未持有流通受限的债券和权证。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票@代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600607	上实医药	2009-6-18	重大资产重组	19.33	-	-	627,603	11,774,325.27	12,131,565.99

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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	21,409,674,234.19	87.24
	其中：股票	21,409,674,234.19	87.24
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	0.00	0.00
	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	3,024,810,929.74	12.33
6	其他资产	105,965,484.39	0.43
7	合计	24,540,450,648.32	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	24,109,379.30	0.10
B	采掘业	2,754,132,201.77	11.26
C	制造业	5,423,799,919.09	22.18
C0	食品、饮料	1,803,266,134.93	7.37
C1	纺织、服装、皮毛	131,113,790.42	0.54
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	167,591,316.20	0.69
C4	石油、化学、塑胶、塑料	620,948,551.58	2.54
C5	电子	16,140,684.00	0.07
C6	金属、非金属	1,415,604,182.65	5.79
C7	机械、设备、仪表	1,006,087,874.10	4.11
C8	医药、生物制品	259,536,571.31	1.06
C99	其他制造业	3,510,813.90	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	453,599,018.52	1.86
E	建筑业	1,285,412,803.22	5.26
F	交通运输、仓储业	570,820,142.27	2.33
G	信息技术业	753,394,513.80	3.08
H	批发和零售贸易	744,801,617.14	3.05
I	金融、保险业	7,315,890,752.43	29.92
J	房地产业	1,069,313,317.64	4.37
K	社会服务业	774,466,966.54	3.17
L	传播与文化产业	66,946,424.59	0.27
M	综合类	172,987,177.88	0.71
	合计	21,409,674,234.19	87.56

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	601939	建设银行	221,666,640	1,336,649,839.20	5.47
2	600036	招商银行	56,172,113	1,258,817,052.33	5.15
3	601390	中国中铁	170,858,918	1,160,132,053.22	4.74
4	600519	贵州茅台	7,777,773	1,151,188,181.73	4.71
5	601857	中国石油	68,125,554	986,458,021.92	4.03
6	601628	中国人寿	35,182,494	969,277,709.70	3.96
7	000069	华侨城A	34,262,805	716,092,624.50	2.93
8	600030	中信证券	24,000,000	678,240,000.00	2.77
9	601318	中国平安	12,541,717	620,313,322.82	2.54
10	000402	金 融 街	44,067,441	606,367,988.16	2.48

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	601390	中国中铁	1,027,737,991.02	6.21
2	601939	建设银行	727,920,692.94	4.40
3	601857	中国石油	720,128,370.40	4.35
4	600030	中信证券	639,117,455.22	3.86
5	600519	贵州茅台	448,903,773.48	2.71
6	000858	五 粮 液	338,694,925.01	2.05
7	600050	中国联通	325,035,182.47	1.97
8	601318	中国平安	286,805,097.60	1.73
9	601088	中国神华	255,850,165.00	1.55
10	600036	招商银行	242,992,038.28	1.47
11	601998	中信银行	232,587,334.70	1.41
12	600019	宝钢股份	213,349,521.76	1.29
13	600585	海螺水泥	184,209,513.61	1.11
14	600900	长江电力	149,518,999.90	0.90
15	601628	中国人寿	143,814,839.43	0.87
16	600031	三一重工	121,301,450.80	0.73
17	600660	福耀玻璃	110,817,467.71	0.67
18	600649	城投控股	101,559,596.80	0.61
19	600170	上海建工	91,752,781.74	0.55
20	000027	深圳能源	83,540,201.83	0.51

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，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	600000	浦发银行	674,770,712.54	4.08
2	000002	万 科A	438,277,689.56	2.65
3	600123	兰花科创	334,986,064.19	2.03
4	601898	中煤能源	316,763,928.39	1.92
5	600660	福耀玻璃	210,159,016.33	1.27
6	600005	武钢股份	197,476,378.91	1.19
7	600586	金晶科技	196,525,987.16	1.19
8	600320	振华重工	195,789,427.32	1.18
9	000039	中集集团	178,821,267.20	1.08
10	000983	西山煤电	152,203,576.06	0.92
11	600348	国阳新能	136,943,436.33	0.83
12	600489	中金黄金	129,546,369.93	0.78
13	600030	中信证券	124,813,301.58	0.75
14	600066	宇通客车	121,704,437.09	0.74
15	600547	山东黄金	120,053,113.33	0.73
16	600036	招商银行	114,718,525.32	0.69
17	000839	中信国安	111,337,930.93	0.67
18	600170	上海建工	100,160,152.48	0.61
19	000401	冀东水泥	98,560,463.23	0.60
20	600867	通化东宝	92,150,806.43	0.56

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	9,041,514,586.45
卖出股票收入(成交)总额	7,264,117,532.85

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金本报告期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.9.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额