诺德增强收益债券型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年6月30日

基金管理人:诺德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:二〇一〇年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年8月23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。

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。

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。

本半年度报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至2010年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺德增强收益债券
基金主代码	573003
基金交易代码	573003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月4日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	65,480,697.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为主动式管理的债券型基金,主要通过全面投资于各类债券品种,在获得稳定的息票收益的基础上,争取获得资本利得收益,为基金份额持有人获得较好的全面投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将通过研究分析国内外宏观经济发展形势、政府的政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期,并在此基础上通过对各种债券品种进行相对价值分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和对利率变化的敏感性等因素,主动构建和调整投资组合,在获得稳定的息票收益的基础上,争取获得资本利得收益,同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性,从而达到控制投资风险,长期稳健地获得债券投资收益的目的。本基金对非债券产品的直接投资首选在一级市场上的新股申购(含增发),如果新股的收益率降低,根据风险和收益的配比原则,本基金将参与二级市场的股票买卖。
业绩比较基准	中国债券总指数(全价)收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金

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		诺德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
信息披露负责人	姓名	张欣	尹东
	联系电话	021-68879999	010-67595003
	电子邮箱	xin.zhang@lordabbettchina.com	yindong@ccb.com
客户服务电话		400-888-0009	010-67595096
传真		021-68877727	010-66275853

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.nuodefund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年度报告原件置于陆家嘴环路1233号汇亚大厦12楼基金管理人办公场所

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(2010年1月1日至2010年6月30日)
本期已实现收益	472,271.23
本期利润	-1,487,716.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0186
本期基金份额净值增长率	-2.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0120
期末基金资产净值	66,267,308.71
期末基金份额净值	1.012

注:1、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;

2、所述基金业绩指标不包括持有人认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。

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	-1.46%	0.27%	-1.10%	0.19%	-0.36%	0.08%
过去三个月	-3.44%	0.27%	-1.98%	0.19%	-1.46%	0.08%
过去六个月	-2.32%	0.27%	-1.39%	0.17%	-0.93%	0.10%
过去一年	-0.39%	0.32%	-1.23%	0.20%	0.84%	0.12%
自基金合同生效日起至今	1.20%	0.28%	2.07%	0.20%	-0.87%	0.08%

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

诺德增强收益债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年3月4日至2010年6月30日)

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	1,920,554.98	9,083,371.08
结算备付金		771,519.57	3,007,088.07
存出保证金		213,251.22	176,871.66
交易性金融资产	6.4.7.2	43,118,909.96	84,784,339.98
其中:股票投资		6,094,250.10	12,341,363.75
基金投资		-	-
债券投资		37,024,659.86	72,442,976.23
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	20,000,000.00	22,200,000.00
应收证券清算款		1,752,447.77	10,503,965.36
应收利息	6.4.7.5	866,162.56	1,119,075.64
应收股利		-	-
应收申购款		9,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		68,651,846.06	130,874,711.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款			15,000,000.00
应付证券清算款		823,157.38	-
应付赎回款		384,221.79	1,254,635.82
应付管理人报酬		42,199.44	89,781.31
应付托管费		11,253.20	23,941.69
应付销售服务费		22,506.36	47,883.36
应付交易费用	6.4.7.7	429,097.20	222,888.24
应交税费		468,784.68	468,784.68
应付利息		-	2,702.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	203,317.30	325,000.22
负债合计		2,384,537.35	17,435,618.31
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	65,480,697.95	109,528,242.98
未分配利润	6.4.7.10	786,610.76	3,910,850.50
所有者权益合计		66,267,308.71	113,439,093.48
负债和所有者权益总计		68,651,846.06	130,874,711.79

注:报告截止日2010年06月30日,基金份额净值1.012元,基金份额总额65,480,697.95份。

6.2 利润表

会计主体:诺德增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30日
一、收入		162,739.83	16,640,251.40
1.利息收入		1,037,543.86	4,028,931.59
其中:存款利息收入	6.4.7.11	46,638.00	439,569.55
债券利息收入		920,309.31	2,519,675.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		70,596.55	1,069,687.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,084,977.85	13,530,336.41
其中:股票投资收益	6.4.7.12	1,404,402.85	14,745,647.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-347,999.84	-1,746,127.61
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	28,574.84	530,816.76
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.15	-1,959,988.04	-1,022,113.25
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	206.16	103,096.65
减:二、费用		1,650,456.64	5,586,484.61
1.管理人报酬		309,079.09	2,073,754.08
2.托管费		82,421.09	553,001.10
3.销售服务费		164,842.20	1,106,002.25
4.交易费用	6.4.7.17	789,981.97	1,709,850.28
5.利息支出		87,895.62	-
其中:卖出回购金融资产支出		87,895.62	-
6.其他费用	6.4.7.18	216,236.67	143,876.90
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-1,487,716.81	11,053,766.79
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-1,487,716.81	11,053,766.79

注:本基金合同生效日为2009年3月4日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺德增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6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)	109,528,242.98	3,910,850.50	113,439,093.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,487,716.81	-1,487,716.81
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)	-44,047,545.03	-1,636,522.93	-45,684,067.96
其中:1.基金申购款	1,675,849.94	62,594.67	1,738,444.61
2.基金赎回款	-45,723,394.97	-1,699,117.60	-47,422,512.57
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	65,480,697.95	786,610.76	66,267,308.71

项目	上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6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)	1,184,890,833.63	-	1,184,890,833.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,053,766.79	11,053,766.79
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)	-697,927,339.76	-3,272,863.80	-701,200,203.56
其中:1.基金申购款	16,597,115.42	80,647.48	16,677,762.90
2.基金赎回款	-714,524,455.18	-3,353,511.28	-717,877,966.46
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	486,963,493.87	7,780,902.99	494,744,396.86

注:1、本基金合同生效日为2009年3月4日。

2、报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.3、财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:杨忆风、主管会计工作负责人:杨忆风、

会计机构负责人:虞俏依 高奇

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德增强收益债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]第1392号《关于核准诺德增强收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,184,234,685.11元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第021号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》于2009年3月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,184,890,833.63份基金份额,其中认购资金利息折合656,149.52份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行及交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券和债券回购等固定收益证券品种,以及股票、权证等权益类证券品种。本基金的投资组合比例为:债券类(包括可转债)资产的投资比例为基金资产净值的80%-95%,本基金持有的非债类资产为基金资产净值的0-20%;基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券(包括央行票据)的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:90%×中国债券总指数(全价)收益率+10%×沪深300指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年1月1日至2010年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2010年6月30日的财务状况以及2010年1月1日至2010年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本报告期内本基金未发生会计政策变更事项、会计估计变更事项及会计差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期内,未发生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。

6.4.9.2 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
诺德基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
长江证券股份有限公司("长江证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30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
长江证券	55,223,984.20	10.79%	327,247,414.79	29.15%

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内本基金未通过关联方交易单元进行权证交易业务。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
长江证券	35,106,547.15	7.99%	410,662,655.97	53.97%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	170,200,000.00	10.44%	15,888,900,000.00	78.02%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	46,223.29	10.77%	46,223.29	10.77%

关联方名称	上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	275,327.36	29.25%	227,300.56	25.45%

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	309,079.09	2,073,754.08
其中:支付销售机构的客户维护费	40,458.90	242,191.56

注:支付基金管理人诺德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,421.09	553,001.10

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
建设银行	159,295.02
长江证券	123.16
诺德基金管理有限公司	2,409.54
合计	161,827.72

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
建设银行	959,429.06
长江证券	2,464.11
诺德基金管理有限公司	1,191.86
合计	963,085.03

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给诺德基金管理有限公司,再由诺德基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.4%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本报告期末本基金其他关联方未持有本基金份额。

6.4.10.5 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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年3月4日(基金合同生效日)至2009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
中国建设银行	1,920,554.98	29,676.54	95,690,137.35	336,915.40

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行间业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金未发生其他需要说明的关联方交易。

6.4.12 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300068	南都电源	2010-04-12	2010-07-21	网下配售中签	33.00	25.67	17,002	561,066.00	436,441.34	-
002440	闰土股份	2010-06-25	2010-07-06	网上申购中签	31.20	31.20	1,500	46,800.00	46,800.00	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未从事银行间市场债券正回购交易,无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年6月30日止,基金无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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

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	6,094,250.10	8.88
	其中:股票	6,094,250.10	8.88
2	固定收益投资	37,024,659.86	53.93
	其中:债券	37,024,659.86	53.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,000.00	29.13
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,692,074.55	3.92
6	其他各项资产	2,840,861.55	4.14
7	合计	68,651,846.06	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	376,500.00	0.57
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,180,672.34	6.31
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	46,800.00	0.07
C5	电子	1,373,200.00	2.07
C6	金属、非金属	177,550.00	0.27
C7	机械、设备、仪表	1,804,372.34	2.72
C8	医药、生物制品	403,050.00	0.61
C99	其他制造业	375,700.00	0.57
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	504,777.76	0.76
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	579,400.00	0.87
H	批发和零售贸易	222,600.00	0.34
I	金融、保险业	230,300.00	0.35
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	6,094,250.10	9.20

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	002241	歌尔声学	25,000	756,500.00	1.14
2	300068	南都电源	17,002	436,441.34	0.66
3	600535	天士力	15,000	403,050.00	0.61
4	002223	鱼跃医疗	10,000	352,800.00	0.53
5	002081	金螳螂	10,000	313,000.00	0.47
6	002069	獐子岛	10,000	275,500.00	0.42
7	600388	龙净环保	10,000	263,600.00	0.40
8	000541	佛山照明	20,000	237,600.00	0.36
9	600563	法拉电子	10,000	237,000.00	0.36
10	002106	莱宝高科	10,000	235,000.00	0.35

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人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	601328	交通银行	7,067,400.00	6.23
2	601601	中国太保	6,553,126.78	5.78
3	601318	中国平安	5,433,856.01	4.79
4	600016	民生银行	5,322,300.00	4.69
5	600048	保利地产	4,733,320.50	4.17
6	600508	上海能源	4,542,081.50	4.00
7	000001	深发展A	4,492,745.28	3.96
8	000898	鞍钢股份	4,465,809.69	3.94
9	600036	招商银行	4,043,988.05	3.56
10	601169	北京银行	3,999,490.46	3.53
11	601699	潞安环能	3,981,206.60	3.51
12	000709	河北钢铁	3,954,459.15	3.49
13	600664	哈药股份	3,569,772.48	3.15
14	601988	中国银行	3,372,100.00	2.97
15	600050	中国联通	3,351,680.00	2.95
16	600029	南方航空	3,104,155.00	2.74
17	600028	中国石化	2,973,573.27	2.62
18	601088	中国神华	2,920,023.00	2.57
19	000937	冀中能源	2,894,791.00	2.55
20	600000	浦发银行	2,892,458.00	2.55
21	000540	中天城投	2,776,431.31	2.45
22	600837	海通证券	2,773,343.14	2.44
23	000002	万科A	2,742,174.00	2.42
24	600030	中信证券	2,634,889.00	2.32
25	600601	方正科技	2,561,300.00	2.26
26	600748	上实发展	2,509,361.01	2.21
27	600550	天威保变	2,448,763.10	2.16

注:"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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	601328	交通银行	7,035,444.00	6.20
2	601318	中国平安	6,826,789.00	6.02
3	601601	中国太保	6,632,284.60	5.85
4	600016	民生银行	5,164,996.80	4.55
5	600048	保利地产	4,713,493.68	4.16
6	600664	哈药股份	4,667,705.32	4.11
7	600508	上海能源	4,422,043.99	3.90
8	000001	深发展A	4,385,579.45	3.87
9	000898	鞍钢股份	4,275,533.70	3.77
10	600036	招商银行	4,068,478.44	3.59
11	601169	北京银行	3,991,876.20	3.52
12	000709	河北钢铁	3,980,392.60	3.51
13	601699	潞安环能	3,973,251.00	3.50
14	600028	中国石化	3,644,447.00	3.21
15	601988	中国银行	3,287,600.00	2.90
16	600050	中国联通	3,246,060.00	2.86
17	600029	南方航空	3,120,700.00	2.75
18	601088	中国神华	2,931,945.00	2.58
19	600000	浦发银行	2,898,295.00	2.55
20	000937	冀中能源	2,862,320.10	2.52
21	600837	海通证券	2,845,946.00	2.51
22	000540	中天城投	2,786,441.00	2.46
23	000002	万科A	2,714,600.00	2.39
24	600030	中信证券	2,666,061.15	2.35
25	000402	金融街	2,541,000.00	2.24
26	600601	方正科技	2,500,991.26	2.20
27	600748	上实发展	2,495,548.10	2.20
28	600550	天威保变	2,434,336.84	2.15
29	600383	金地集团	2,302,985.00	2.03

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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

买入股票的成本(成交)总额	254,702,802.50
卖出股票的收入(成交)总额	260,387,354.63

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	24,345,409.76	36.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,133,094.10	18.31
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	546,156.00	0.82
7	其他	-	-
8	合计	37,024,659.86	55.87

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	010308	03国债(8)	60,000	6,138,000.00	9.26
2	010112	21国债(12)	60,000	6,083,400.00	9.18
3	010110	21国债(10)	60,000	6,078,000.00	9.17
4	010311	03国债(11)	34,750	3,512,877.50	5.30
5	112016	09宏润债	26,870	2,850,100.90	4.30

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1