金元比联丰利债券型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:金元比联基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年十月二十七日

§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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元比联丰利债券
基金主代码	620003
交易代码	620003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月23日
报告期末基金份额总额	157,088,460.83份
投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的稳健收益和总回报。
投资策略	基于"自上而下"的原则,本基金采用久期控制下的主动性投资策略,并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。经过对历史数据的统计分析发现,债券市场收益率受到宏观经济形势和债券市场供需两方面不同程度的影响,因此本基金在债券投资过程中,将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析,并运用适当的策略来构建债券组合。
业绩比较基准	中信标普全债指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其风险收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	金元比联基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	464,094.87
2.本期利润	6,834,921.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0342
4.期末基金资产净值	158,857,550.32
5.期末基金份额净值	1.011

注:(1)上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;
(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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2010.07.01-2010.09.30	3.59%	0.25%	0.87%	0.04%	2.72%	0.21%

注:(1)上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;
(2)本基金选择中信标普全债指数作为基金业绩基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

金元比联丰利债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年3月23日至2010年9月30日)

注:(1)本基金合同生效日为2009年3月23日;
(2)本基金建仓期为2009年3月23日至2009年9月22日,建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
李飞	本基金基金经理	2009-5-5	-	7	南京大学理学和经济学硕士,加拿大西门弗雷泽大学经济学硕士,CFA,7年证券、基金从业经验。历任上海陈源数据责任公司担任研究员,国盛债券有限责任公司宏观债券分析师;2006年6月加入我司,历任宏观策略高级债券研究员,金元比联丰利债券型证券投资基金基金经理助理。
何旻	本基金基金经理	2009-3-23	-	12	基金经理,CFA,FRM。英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。1998年加盟国泰基金管理有限公司,先后担任研究开发部行业研究员、综合研究小组(包括债券研究)负责人、基金管理部、固定收益部基金经理助理、固定收益部负责人、曾任国泰金龙债券基金、国泰金象保本基金和国泰金鹿保本基金的基金经理。2006年加盟本公司,现任金元比联丰利债券型证券投资基金以及金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金的基金经理。具有基金从业资格。

注:此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日;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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、《金元比联丰利债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度。投资管理和交易执行相隔离,实行集中交易制度,严格执行交易系统中的公平交易程序,未出现违反公平交易制度的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

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

本报告期内,公司旗下无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

本报告期内,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2010年第三季度,上证综合指数在7月中下旬回复到2550点之上,此后进入箱体震荡,箱体在2550点至2700点之间。上证综合指数在7月至9月涨幅达到10.7%左右。在板块方面,中小盘股票战胜了大盘股。新能源和区域板块仍然是市场热点。银行间固定利率国债曲线呈现蝶形变化,中期债券收益率略有上升,短期和长期债券收益率都有所下降。在第三季度中,我们积极参加了新股的申购,并且保持较高的股票仓位。债券方面,增加了企业债的比例,并且在久期上有所增加。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在第三季度的净值上涨幅度为3.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2010年最后一个季度,我们认为股票市场的表现将会优于债券市场。由于全球有可能再一次进入一轮量化宽松的政策时期,本身具有一定估值优势的资源类个股会出现比较大的机会。同时伴随着对人民币升值预期的加强,航空造纸等行业也会跑赢基准。创业板将面临解禁股的压力,短期内股价受制。因此,第四季度配置重心应当转向大盘股。债券市场也会先抑后扬,先期加息预期较高,之后可能收益率逐步下降,长期债券收益率的波动会比较大,企业债的信用利差有收窄的趋势,但是空间并不大。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	24,428,092.84	9.54
	其中:股票	24,428,092.84	9.54
2	固定收益投资	127,670,059.90	49.83
	其中:债券	127,670,059.90	49.83
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	100,974,920.02	39.41
6	其他各项资产	3,115,955.88	1.22
7	合计	256,189,028.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	676,563.35	0.43
B	采掘业	-	-
C	制造业	14,026,597.41	8.83
C0	食品、饮料	442,924.08	0.28
C1	纺织、服装、皮毛	861,012.80	0.54
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,013,597.40	1.27
C5	电子	5,526,376.63	3.48
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	5,182,686.50	3.26
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	776,733.48	0.49
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	951,548.00	0.60
H	批发和零售贸易	2,590,957.00	1.63
I	金融、保险业	1,425,600.00	0.90
J	房地产业	1,344,000.00	0.85
K	社会服务业	2,636,093.60	1.66
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	24,428,092.84	15.38

5.3 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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002106	莱宝高科	59,000	2,177,100.00	1.37
2	002024	苏宁电器	108,100	1,726,357.00	1.09
3	002249	大洋电机	53,950	1,668,673.50	1.05
4	002449	国星光电	48,574	1,602,942.00	1.01
5	600000	浦发银行	110,000	1,425,600.00	0.90
6	300070	碧水源	16,000	1,416,320.00	0.89
7	000002	万科A	160,000	1,344,000.00	0.85
8	002469	三维工程	27,288	1,219,773.60	0.77
9	300105	龙源技术	14,393	1,165,833.00	0.73
10	002407	多氟多	20,000	1,149,800.00	0.72

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,466,562.00	9.74
2	央行票据	10,018,000.00	6.31
3	金融债券	50,836,000.00	32.00
	其中:政策性金融债	50,836,000.00	32.00
4	企业债券	28,768,950.00	18.11
5	企业短期融资券	10,022,000.00	6.31
6	可转债	12,558,547.90	7.91
7	其他	-	-
8	合计	127,670,059.90	80.37

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080417	08农发17	300,000	30,762,000.00	19.36
2	100402	10农发02	200,000	20,074,000.00	12.64
3	010213	02国债(13)	128,400	12,522,852.00	7.88
4	110009	双良转债	81,570	10,264,768.80	6.46
5	098028	09津城投3	100,000	10,262,000.00	6.46

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告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
本报告期末本基金未持有权证投资。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,863,755.88
5	应收申购款	2,200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,115,955.88

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110009	双良转债	10,264,768.80	6.46

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002449	国星光电	1,602,942.00	1.01	召开股东大会
2	002469	三维工程	1,219,773.60	0.77	网下新股锁定
3	300105	龙源技术	1,165,833.00	0.73	网下新股锁定

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	215,327,683.95
本报告期基金总申购份额	44,150,075.61
减:本报告期基金总赎回份额	102,389,298.73
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	157,088,460.83

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1.2010年7月1日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联丰利债券型证券投资基金半年度最后一个市场交易日《份额净值》(公告);

2.2010年7月7日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司参加上海银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告》;

3.2010年7月21日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联丰利债券型证券投资基金2010年第2季度报告》;

4.2010年8月9日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司增加开放旗下开放式基金转换业务机构的公告》;

5.2010年8月9日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参加海通证券定投费基金定投业务申购费率优惠活动的公告》;

6.2010年8月26日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联丰利债券型证券投资基金2010年半年度报告》;

7.2010年8月26日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联丰利债券型证券投资基金2010年半年度报告摘要》;

8.2010年9月1日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司增加华泰证券为代销机构并开通转换与定投业务的公告》;

9.2010年9月17日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联丰利债券型证券投资基金增加开通定期定额投资业务机构的公告》;

10.2010年9月20日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联丰利债券型证券投资基金开通上海银行定期定额投资业务的公告》。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、《金元比联丰利债券型证券投资基金基金合同》;
2、《金元比联丰利债券型证券投资基金基金招募说明书》;
3、《金元比联丰利债券型证券投资基金托管协议》。

8.2 存放地点
存放地点:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦36层3608室。

8.3 查阅方式
查阅方式:网站:http://www.jykbc.com。

金元比联基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十七日

金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:金元比联基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年十月二十七日

§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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元比联成长动力混合
基金主代码	620002
交易代码	620002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年9月3日
报告期末基金份额总额	148,901,503.15份
投资目标	在"可持续成长投资"指导下,本基金深度剖析与把握上市公司的成长动力,以"以投入资本回报率(Return on Invested capital,ROIC)"为核心财务分析指标,主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司,力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的证券精选,在精细化风险管理的基础上构建优化组合,谋求基金资产长期持续稳定的合理回报。
投资策略	将数量模型与定性分析相结合,采取主动投资方法构建投资组合是本基金的投资策略。在股票投资方面,本基金采取"自下而上"的方法选择投资标的,同时以宏观经济预测和行业趋势分析为辅助。具体而言,在"可持续成长投资"指导下,本基金以"已投入资本回报率"为核心财务分析指标,经过流动性筛选、行业分类、利润增长分析与筛选、已投入资本回报率分析、公司治理以及估值等量六个步骤,股票组合主要投资于资本运用效率高、具有可持续成长特征的上市公司。在债券投资方面,基于"自上而下"的原则,本基金采用久期控制下的主动性投资策略,并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。
业绩比较基准	中信标普300指数收益率×55%+中信标普国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的灵活配置混合型基金,其风险收益特征从长期平均及预期来看,低于股票型基金,高于债券型基金。保本型基金与货币市场基金,属于中高风险的证券投资基金品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。
基金管理人	金元比联基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-9,509,316.77
2.本期利润	18,526,771.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.1100
4.期末基金资产净值	168,544,273.43
5.期末基金份额净值	1.132

注:(1)上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;
(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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2010.07.01-2010.09.30	11.09%	1.04%	8.48%	0.72%	2.61%	0.32%

注:(1)上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;
(2)本基金选择中信标普300指数作为股票投资部分的业绩基准,选择中信标普国债指数作为债券投资部分的业绩基准,复合业绩比较基准为:中信标普300指数收益率×55%+中信标普国债指数收益率×45%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年9月3日至2010年9月30日)

注:(1)本基金合同生效日为2008年9月3日,基准累计增长率以2008-9-2日指数为基准;
(2)本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的30%-80%;债券为15%-65%;现金比例在5%以上;本基金的建仓期自2008年9月3日起至2009年3月2日止,在建仓期末和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
吴广利	本基金基金经理	2009-5-5	-	8	1973年出生,上海交通大学工学学士,北京大学经济学硕士,8年证券、基金从业经验。历任海通证券研究所研究员,长江巴黎百富勤研究部研究经理;2006年7月加入我司,历任研究员、首席研究员兼金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金基金经理助理、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、金元比联核心动力股票型证券投资基金基金经理。

注:此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日;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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、《金元比联成长动力混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度。投资管理和交易执行相隔离,实行集中交易制度,严格执行交易系统中的公平交易程序,未出现违反公平交易制度的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

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

本基金管理人旗下无其他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

本报告期内,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,在所谓"经济退、政策进"的因素触发下,上证指数在7月份出现明显反弹,幅度达到11%,8、9月份则基本维持震荡盘整的态势。

在操作上,随着股市的反弹,本基金也逐步提高了股票仓位,并将配置的重点由上半年的主题投资为主转向精选零售、医药、食品饮料、电力设备和有色金属(黄金和稀有金属)等行业的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2010年9月30日,本基金的份额净值为1.132元,报告期内净值增长率为11.1%,业绩比较基准收益率为8.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对第四季度的行情持乐观态度。从基本面来看,中国GDP同比增速预计在明年一季度见底,股市则通常领先宏观经济3-6个月。资金面上,股市赚钱效应的显现和楼市二次调控加强情况下资金由房地产向股票资产的转移,将使A股具有较好的流动性支撑。在政策方面,由于CPI将在四季度初见到年内高点并随后下行,同时考虑人民币汇率等因素,央行年内不加息成为大概率事件,货币政策不会进一步紧缩。

在操作上,本基金将在均衡行业配置的基础上,努力把握行业轮动节奏,并通过自下而上选择"十二五"规划、人民币升值、通胀预期、"三农"、年度业绩超预期和年报高送转等主题相关股票进行投资。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	132,244,758.86	75.97
	其中:股票	132,244,758.86	75.97
2	固定收益投资	25,591,489.40	14.70
	其中:债券	25,591,489.40	14.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	14,769,897.13	8.49
6	其他各项资产	1,458,358.86	0.84
7	合计	174,064,504.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,713,709.20	5.76
B	采掘业	5,447,579.56	3.23
C	制造业	71,576,732.42	42.47
C0	食品、饮料	13,034,413.29	7.73
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	-	-
C5	电子	15,810,171.50	9.38
C6	金属、非金属	10,766,540.00	6.39
C7	机械、设备、仪表	9,763,827.44	5.79
C8	医药、生物制品	22,201,780.19	13.17
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,138,000.00	4.24
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,382,500.00	2.60
H	批发和零售贸易	13,132,849.76	7.79
I	金融、保险业	18,234,231.48	10.82
J	房地产业	2,619,156.44	1.55
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	132,244,758.86	78.46

5.3 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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002024	苏宁电器	551,668	8,810,137.96	5.23
2	002106	莱宝高科	203,389	7,505,054.10	4.45
3	600970	中材国际	200,000	7,138,000.00	4.24
4	600276	恒瑞医药	143,726	7,012,391.54	4.16
5	600875	东方电气	224,834	7,005,827.44	4.16
6	600809	山西汾酒	100,000	6,858,000.00	4.07
7	600111	包钢稀土	89,000	6,840,540.00	4.06
8	601607	上海医药	305,961	6,838,228.35	4.06
9	000858	五粮液	179,913	6,176,413.29	3.66
10	600489	中金黄金	138,898	5,447,579.56	3.23

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	21,968,205.00	13.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,000,240.00	1.78
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	623,044.40	0.37
7	其他	-	-
8	合计	25,591,489.40	15.18

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010110	21国债(10)	123,000	12,484,500.00	7.41
2	010203	02国债(3)	93,500	9,483,705.00	5.63
3	122964	09龙湖债	18,000	1,952,640.00	1.16
4	088040	08铁路01	10,000	1,047,600.00	0.62
5	110009	双良转债	2,060	259,230.40	0.15

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告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
本报告期末本基金未持有权证投资。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	275,946.25
3	应收股利	-
4	应收利息	157,513.79
5	应收申购款	24,898.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,458,358.86

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110007	博汇转债	129,129.00	0.08
2	110008	王府转债	234,685.00	0.14

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	187,662,088.59
本报告期基金总申购份额	3,133,836.94
减:本报告期基金总赎回份额	41,894,422.38
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	148,901,503.15

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1.2010年7月1日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参加中国邮政储蓄银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告》;

2.2010年7月1日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金半年度最后一个市场交易日《份额净值》(公告);

3.2010年7月7日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参加信达证券定投暨非现场委托方式申购费率优惠活动的公告》;

4.2010年7月21日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金2010年第2季度报告》;

5.2010年7月23日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参与中信建投证券网上申购费率优惠活动的公告》;

6.2010年7月31日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司继续参加上海银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告》;

7.2010年8月9日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司增加开放旗下开放式基金转换业务机构的公告》;

8.2010年8月9日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参加海通证券定投费基金定投业务申购费率优惠活动的公告》;

9.2010年8月23日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参与金元证券网上申购费率优惠活动的公告》;

10.2010年8月23日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参与华泰联合证券网上申购费率优惠活动的公告》;

11.2010年8月23日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下开放式基金参与中国银河证券定投费网上申购费率优惠活动的公告》;

12.2010年8月26日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金2010年半年度报告》;

13.2010年8月26日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金2010年半年度报告摘要》;

14.2010年9月1日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司增加华泰证券为代销机构并开通转换与定投业务的公告》;

15.2010年9月1日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司旗下部分基金继续参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告》;

16.2010年9月17日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联旗下基金参加华泰证券基金申购费率优惠活动的公告》;

17.2010年9月17日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jykbc.com上公布《金元比联基金管理有限公司关于网上直销中国农业银行支付渠道申购费率优惠的公告》。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、《金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
2、《金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》;
3、《金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

8.2 存放地点
存放地点:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦36层3608室。

8.3 查阅方式
查阅方