金元惠理新经济主题股票型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

基金管理人:金元惠理基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年三月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年7月31日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金元惠理新经济主题股票
基金主代码	620008
交易代码	620008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月31日
基金管理人	金元惠理基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	90,289,838.92份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新发展时期和发展环境下,所涌现的与新经济主题相关、基本面良好、且具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司股票,力争实现基金资产的长期、持续、稳定增值。
投资策略	本基金通过发掘经济发展及结构转型过程中所显现的新经济主题,并以该主题所孕育的投资机会作为主要的投资线索,力争获取持续稳健的投资超额收益。 在资产配置方面,本基金根据国内外宏观经济、政策环境、市场运行趋势等因素确定基金的大类资产配置比例;在权益资产投资方面,采用"自上而下"的方式,选择与新经济主题相关性较高的行业中的个股进行配置。同时,结合"自下而上"的方式,精选与新经济主题相关性较高的上市公司股票作为投资方向;在债券投资方面,选择具有票息优势的债券品种作为主要的债券投资标的;最后,在综合考量投资组合的风险收益特征基础上,本基金完成组合构建。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准为中国债券总指数。本基金的整体业绩基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只具有主题投资风格的股票型基金,其预期的风险和收益特征高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

投资目标		基金管理人	基金托管人
名称		金元惠理基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌有法	李芳菲
	联系电话	021-68881801	010-66060069
	电子邮箱	service@jyvpfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-666-0666	95599
传真		021-68881875	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.jyvpfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	2012年7月31日至2012年12月31日	2011年	2010年
本期已实现收益	-457,490.13	-	-
本期利润	-332,214.48	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0012	-	-
本期基金份额净值增长率	1.60%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.0029	-	-
期末基金资产净值	91,771,264.63	-	-
期末基金份额净值	1.016	-	-

注:1:本基金于2012年7月31日成立,基金合同生效当期不是完整的报告期。

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的孰低数(为期末余额,不是当期发生数);

4:表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日。

5: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。

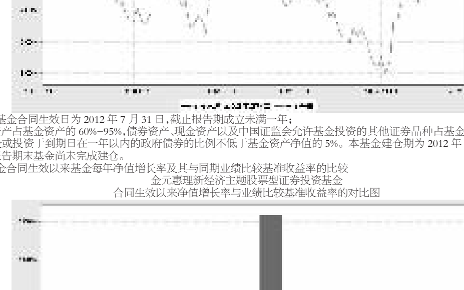
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	1.50%	0.34%	7.96%	1.02%	-6.46%	-0.68%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.26%	6.16%	1.02%	-4.56%	-0.76%

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

金元惠理新经济主题股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年7月31日至2012年12月31日)

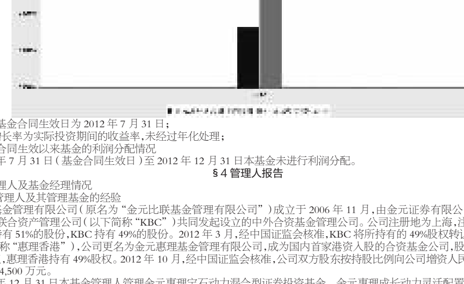


注:(1)本基金合同生效日为2012年7月31日,截止报告期成立未满一年;

(2)股票资产占基金资产的60%-95%,债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2012年7月31日至2013年1月30日,截至报告期末基金尚未完成建仓。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金元惠理新经济主题股票型证券投资基金
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:(1)本基金合同生效日为2012年7月31日;

(2)基金增长率为实际投资期间的收益率,未经过年化处理;

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本期2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日本基金未进行利润分配。

§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

金元惠理基金管理有限公司(原名为"金元比联基金管理有限公司")成立于2006年11月,由金元证券有限公司(以下简称"金元证券")与比利时联合资产管理公司(以下简称"KBC")共同发起设立的中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本1.5亿人民币,其中金元证券持有51%的股份,KBC持有49%的股份。2012年3月,经中国证监会核准,KBC将所持有的49%股权转让惠理基金管理香港有限公司(以下简称"惠理香港"),公司更名为金元惠理基金管理有限公司,成为国内首家港资入股的合资基金公司,股权结构变更为:金元证券持有51%股权,惠理香港持有49%股权。2012年10月,经中国证监会核准,公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元,公司注册资本金增至24,500万元。

截至2012年12月31日本基金管理人管理金元惠理宝石动力混合型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、金元惠理价值增长股票型证券投资基金、金元惠理核心动力股票型证券投资基金、金元惠理消费主题股票型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金和金元惠理新经济主题股票型证券投资基金共八只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
潘江	本基金基金经理	2012-7-31	-	14	CFA,工商管理硕士。现任公司副总经理、兼任投资总监、投资决策委员会主席、金元惠理价值增长股票型证券投资基金和金元惠理新经济主题股票型证券投资基金基金经理。曾任国海富兰克林基金管理有限公司研究总监、基金经理、投资决策委员会委员,万家基金管理有限公司首席策略师、研究总监、基金经理、投资决策委员会委员,国泰基金管理有限公司研究部经理,美国韦里逊通信有限公司国际投资部投资经理。

注:1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日,若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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》、《金元惠理新经济股票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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起了《金元惠理基金管理有限公司公平交易管理制度》,涵盖了各投资组合、投资市场、投资标的的公平交易制度规范,贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程,并通过分析报告、监控、稽核的方式保证制度流程的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等,重视交易执行环节的公平交易措施,启用投资交易系统中的公平交易模块,以确保公平对待各投资组合。在报告期内,本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《异常交易监控与报告制度》的规定,对交易进行了监控,未发现异常交易行为。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金成立于2012年7月31日,基金成立之后开始逐步建立权益投资头寸,主要集中在食品饮料、医药和纺织服装,取得了一定的正收益。但本基金基于谨慎估值的考虑,权益资产的投资比例保持在相对较低的位置,对12月份整体市场的上涨判断不足,导致业绩落后比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期,本基金份额净值增长率为1.60%,业绩比较基准收益率为6.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前从全球的经济来看,2013年的形势预计应该好于2012年。美国在最后一刻解除了财政悬崖危机,暂时缓解了对全球经济可能的负面冲击,QE4的实施也为经济企稳复苏注入了强心剂。欧洲的债务危机没有根本解决,未来5年内彻底解决的可能性不大,不过短期内通过救助手段避免了体系的休克和欧元的崩溃,期间不会再出现类似前期的重大负面事件。

而中国经济从已披露的近期数据来看,基本表现出企稳回暖的迹象。

中国经济的转型依然任重而道远,从新一届的中央领导层的所为来看,领导层对经济转型、政治体制改革的决心坚决、信心坚定。这对资本市场信心的树立很有帮助。在中国走过了沿着传统道路高速发展了三十多年后,面临全球已重新布局的政经格局,面对重要的转型和改革的十字路口,需要中国政府拿出更大的勇气和更大的决心去坚持改革开放的道路,国际国内形势已经不允许中国出现一个停滞的局面。如果新一届领导层能在这方面有所作为,中国经济有望在过去三十年改革发展的基础上,发掘出新的改革红利,突破瓶颈,继续保持相对全球经济的高速发展态势

从目前的各种迹象来看,最高领导层正在沿着改革之路前进。中国如果能够抓住当前全球经济再平衡的历史机遇,就有机会完成真正的经济转型并大大受益于全球经济格局的重组演变。

从目前市场估值水平来看,一些小市值公司的估值相对高估,尤其对一些已失去高成长动力的公司而言更是如此,而大市值绩优公司相对估值合理。

总体而言,2013经济形势出现惊喜的可能性不大,另一方面出现严重下滑的概率也较小。对应这种经济走势,可能资本市场将走出类似的形态。

改革红利、资产负债表修复、城镇化将成为2013年资本市场正面影响的关键词,而经济下半年走势的不确定性、IPO对资金的分流、产业资本的减持压力将成为资本市场负面影响的关键词。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由主管运营的副总经理、基金事务部、投资部、交易部、监察稽核部部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;
② 确保估值方法符合现行法规;
③ 批准证券估值的步骤和方法;
④ 对异常情况做出决策。

主管运营的副总经理是估值工作小组的组长,主管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

4.7.1.2 基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后,基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告,至少每月一次。

基金事务部职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;
② 每日证券估值;
③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;
④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;
⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;
⑥ 对估值调整和人工估值进行记录;
⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

4.7.1.3 投资部的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;
② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;
③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告;
④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.7.1.4 交易部的职责分工

① 对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应;
② 通知基金事务部关于证券停牌、价格变发性异常波动、退市等特定信息;
③ 评价并确认基金事务部提供的估值报告。

4.7.1.5 监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;
③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;
④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险;
⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯;
⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7.2 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本期2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日本基金未进行利润分配。

§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

在托管金元惠理新经济主题股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《金元惠理新经济主题股票型证券投资基金基金合同》、《金元惠理新经济主题股票型证券投资基金托管协议》的约定,金元惠理新经济主题股票型证券投资基金管理人—金元惠理基金管理公司2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,金元惠理基金管理公司在金元惠理新经济主题股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,金元惠理基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的金元惠理新经济主题股票型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部
2013年3月20日

§6 审计报告

安永华明(2013)审字第60657709_B08号

金元惠理新经济主题股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的金元惠理新经济主题股票型证券投资基金的财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表、2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是金元惠理新经济主题股票型证券投资基金的基金管理人金元惠理基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、实施和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了金元惠理新经济主题股票型证券投资基金2012年12月31日的财务状况以及2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师 徐艳 方侃
北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
2013-03-26

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:金元惠理新经济主题股票型证券投资基金
报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
银行存款	2,334,430.00	-
结算备付金	2,543,216.12	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	40,097,212.80	-
其中:股票投资	10,005,212.80	-
基金投资	-	-
债券投资	30,092,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	49,000,150.00	-
应收证券清算款	12,507,050.38	-
应收利息	305,589.98	-
应收股利	-	-
应收申购款	10,977.21	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	106,798,626.49	-
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	-	-
应付证券清算款	13,996,801.39	-
应付赎回款	709,942.93	-
应付管理人报酬	123,073.00	-
应付托管费	20,512.17	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	47,142.69	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	129,889.68	-
负债合计	15,027,361.86	-
所有者权益:		
实收基金	90,289,838.92	-
未分配利润	1,481,425.71	-
所有者权益合计	91,771,264.63	-
负债和所有者权益总计	106,798,626.49	-

注:(1)报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.016,基金份额总额90,289,838.92份。

(2)本基金合同于2012年7月31日生效。

7.2 利润表

会计主体:金元惠理新经济主题股票型证券投资基金
本报告期:2012年7月31日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年7月31日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	2,100,115.71	-
1.利息收入	3,139,128.88	-
其中:存款利息收入	674,318.19	-
债券利息收入	381,045.23	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,083,765.46	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,960,944.18	-
其中:股票投资收益	-1,996,390.57	0.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	35,446.39	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	125,275.65	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	796,655.36	-
减:二、费用	2,432,330.19	-
1.管理人报酬	1,606,386.29	-
2.托管费	267,731.04	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	177,864.05	-
5.利息支出	6,021.84	-
其中:卖出回购金融资产支出	6,021.84	-
6.其他费用	374,326.97	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-332,214.48	-
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-332,214.48	-

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金元惠理新经济主题股票型证券投资基金
本报告期:2012年7月31日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年7月31日至2012年12月31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)	728,928,409.64	0.00	728,928,409.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-332,214.48	-332,214.48
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)	-638,638,570.72	1,813,640.19	-636,824,930.53
其中:1.基金申购款	497,208.20	-2,158.06	495,050.14
2.基金赎回款	-639,135,778.92	1,815,798.25	-637,319,980.67
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)	90,289,838.92	1,481,425.71	91,771,264.63

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:张嘉宾,主管会计工作负责人:符刃,会计机构负责人:季泽

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金元惠理新经济主题股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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[2012]505号文《关于核准金元惠理新经济主题股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由金元惠理基金管理有限公司作为发起人于2012年7月2日至2012年7月27日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第60657709_B01号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2012年7月31日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币728,816,319.81元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币112,089.83元,以上实收基金(本息)合计为人民币728,928,409.64元,折合728,928,409.64份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元惠理基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金贯彻"以基本面为基础,以研究为驱动"的理念,充分把握我国经济发展及结构转型过程中所带来的新经济主题型投资机会,重点投资于从新经济主题中受益,具有高成长性的上市公司。本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2012年12月31日的财务状况以及2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2012年7月31日(基金合同生效日)起至2012年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债金部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B.首次公开发行的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算;

首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,按中国证监会相关规定处理;

2) 债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;

3) 权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市流通的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量;

(3)因持有股票而享有的配股权证,采用估值技术确定公允价值进行估值;

4)分离交易可转债

分离交易可转债,上市日前,采用估值技术分别对债券和权证进行估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值;

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

(3)卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(2)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6次,每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%;若基金合同生效不满3个月,可不进行收益分配;

(3)基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若基金投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(5)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税.

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配

取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金元惠理基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人\注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
惠理基金管理香港有限公司	基金管理人的股东

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年7月31日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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
金元证券股份有限公司	8,450,526.75	6.93%	-	-

7.4.8.1.2 权证交易

本期2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日止本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年7月31日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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
金元证券股份有限公司	55,021,882.53	66.32%	-	-

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年7月31日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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
金元证券股份有限公司	1,602,800,000.00	22.53%	-	-

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年7月31日至2012年12月31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
金元证券股份有限公司	7,421.74	6.92%	7,421.74	16.43%

注: 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证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年7月31日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,606,386.29	-
其中:支付销售机构的客户维护费	760,081.32	-

注:a.基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。

计算方法如下:H=E×1.50%/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,

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

b.根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年7月31日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	267,731.04	-

注:a.基金托管费按前一日基金资产净值的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,

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日止本基金未与关联方进行银行间市场交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2012年7月31日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,334,430.00	71,624.85	-	-

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间获得的利息收入为人民币42,110.01元,2012年末结算备付金余额为人民币2,543,216.12元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期2012年7月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日止本基金未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	10,005,212.80	9.37
	其中:股票	10,005,212.80	9.37
2	固定收益投资	30,092,000.00	28.18
	其中:债券	30,092,000.00	28.18
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	49,000,150.00	45.88
	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	4,877,646.12	4.57
6	其他各项资产	12,823,617.57	12.01
7	合计	106,798,626.49	100.00

8.2 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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	8,074,762.80	8.80
C0	食品、饮料	5,838,534.00	6.36
C1	纺织、服装、皮毛	188.80	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	2,236,040.00	2.44
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	1,186,600.00	1.29
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	743,850.00	0.81
M	综合类	-	-
	合计	10,005,212.80	10.90

8.3 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	600519	贵州茅台	14,400	3,009,888.00	3.28
2	000858	五粮液	100,200	2,828,646.00	3.08
3	600079	人福医药	54,800	1,281,772.00	1.40
4	000963	华东医药	34,900	1,186,600.00	1.29
5	300199	翰宇药业	69,200	954,268.00	1.04
6	300027	华谊兄弟	52,200	743,850.00	0.81
7	002029	七匹狼	10	188.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002154	报喜鸟	17,052,091.96	18.58
2	600519	贵州茅台	13,899,553.75	15.15
3	000718	苏宁环球	5,326,132.12	5.80
4	002146	荣盛发展	5,119,408.47	5.58
5	000596	古井贡酒	4,832,281.08	5.27
6	000568	泸州老窖	3,012,176.38	3.28
7	600079	人福医药	3,010,345.00	3.28
8	002294	信立泰	2,844,901.00	3.10
9	000858	五粮液	2,831,334.90	3.09
10	002266	浙富股份	2,087,963.68	2.28
11	300128	锦富新材	1,830,128.00	1.99
12	000963	华东医药	1,134,728.00	1.24
13	300199	翰宇药业	1,000,184.00	1.09
14	002029	七匹狼	999,135.72	1.09
15	300027	华谊兄弟	797,584.00	0.87
16	300228	富瑞特装	502,013.00	0.55
17	000826	桑德环境	446,945.00	0.49
18	002612	朗姿股份	260,292.00	0.28

8.4.2 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	002154	报喜鸟	15,338,007.89	16.71
2	600519	贵州茅台	10,390,746.77	11.32
3	000596	古井贡酒	5,350,441.59	5.83
4	000718	苏宁环球	5,291,106.25	5.77
5	002146	荣盛发展	4,722,522.75	5.15
6	000568	泸州老窖	3,163,868.54	3.45
7	002294	信立泰	2,761,215.03	3.01
8	002266	浙富股份	2,067,958.34	2.25
9	300128	锦富新材	1,854,782.39	2.02
10	600079	人福医药	1,814,895.85	1.98
11	002029	七匹狼	934,403.28	1.02
12	300228	富瑞特装	571,648.00	0.62
13	000826	桑德环境	496,650.00	0.54
14	002612	朗姿股份	267,159.00	0.29

8.4.3 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	57,021,796.25
卖出股票的收入(成交)总额	55,025,405.68

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,028,000.00	10.93
5	企业短期融资券	20,064,000.00	21.86
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	30,092,000.00	32.79

8.6 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	041260058	12深特发CP001	200,000	20,064,000.00	21.86
2	1280470	12黄岩国资债	100,000	10,028,000.00	10.93

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	12,507,050.38
3	应收股利	-
4	应收利息	305,589.98
5	应收申购款	10,977.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,823,617.57

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,514	35,914.81	27,678,920.59	30.66%	62,610,918.33	69.34%

9.29.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	88,969.01	0.10%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0;

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	728,928,409.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	497,208.20
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	639,135,778.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	90,289,838.92

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,未召开基金份额持有人大会,无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、 本报告期内,基金管理人于2012年1月14日发布公告,任命潘江先生为投资总监;

2、 本报告期内,基金管理人于2012年3月3日发布公告,任命符刃先生为运营总监;

3、 本报告期内,基金管理人于2012年3月3日发布公告,任命凌有法先生为督察长;

4、 本报告期内,经金元惠理基金管理有限公司(以下简称"公司")2012年第一次股东会审议通过,同意Karel Heyndrickx先生、Johan Dewolf先生辞去公司董事职务;同意彭张兴先生、Edison Tack Shuen Tse(谢德荪)先生辞去公司独立董事职务;同意谢伟明先生、苏俊祺先生、张嘉宾先生担任公司董事;同意梁宝吉先生、张屹山先生担任公司独立董事。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,未发生改聘会计师事务所的情况。本报告期内,应向安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)支付报酬人民币70,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽核或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券股份有限公司	1	55,138,467.39	45.19%	47,781.98	44.58%	-
中国国际金融有限公司	2	27,294,655.15	22.37%	24,164.98	22.55%	-
国金证券股份有限公司	1	17,651,542.62	14.47%	15,822.49	14.76%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	10,935,471.83	8.96%	9,676.86	9.03%	-
金元证券股份有限公司	1	8,450,526.75	6.93%	7,421.74	6.92%	-
中信证券股份有限公司	1	2,541,940.00	2.08%	2,314.19	2.16%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注:1:专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字<1998>29号)和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序:

A.选择标准。

a.公司具有较强的研究实力,能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时交流和对需求做出反应,有较广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

b.公司资信状况较好,无重大不良记录。

c.公司经营规范,能满足基金运作的合法、合规需求。

d.能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务;可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务,无被持有人投诉的记录。

B.选择流程。

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比,并根据评比的结果选择交易单元。

2:截至本报告期末2012年12月31日止,本基金新租用东方证券股份有限公司1个深圳交易单元,中国国际金融有限公司1个上海交易单元,1个深圳交易单元,国金证券股份有限公司1个上海交易单元,国泰君安证券股份有限公司1个深圳交易单元,金元证券股份有限公司1个上海交易单元,中信证券股份有限公司1个上海交易单元,招商证券股份有限公司1个上海交易单元,1个深圳交易单元,中国中投证券有限责任公司1个上海交易单元,广发证券股份有限公司1个上海交易单元,瑞银证券股份有限公司1个上海交易单元,中国民族证券有限责任公司1个上海交易单元,1个深圳交易单元,北京高华证券有限责任公司1个深圳交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	10,353,296.63	12.48%	251,000,000.00	3.53%	-	-
中国国际金融有限公司	161,188.33	0.19%	669,300,000.00	9.41%	-	-
国金证券股份有限公司	7,211,788.16	8.69%	3,324,300,000.00	46.72%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	55,021,882.53	66.32%	1,602,800,000.00	22.53%	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	197,000,000.00	2.77%	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	1,070,400,000.00	15.04%	-	-
招商证券股份有限公司	10,212,705.76	12.31%	-	-	-	-
中国中投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

金元惠理基金管理有限公司
二〇一三年三月二十八日