全痴的位, 人足币元

## 基金管理人:交银施罗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 报告送出日期:二〇一三年八月二十六日

### 1 重要提示

1. 重安证外 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、误导性除述或重大遗漏,并对其 内容的真实性,准确性和完整性束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(以下使用全称或其简称"中国建设银行")根据本基金

签述工程/十四建设银门/旅游本签金 合同规定,于2013年8月23日复核了本报告中的财务指标,净值表现,利润分免情况,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。 本半年度报告播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。 本担生力时发次就主经中过。

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。 2 基金简介

基金简称	交银蓝筹股票 519694		
基金主代码			
交易代码	519694(前端)	519695(后端)	
&金运作方式	契约型	开放式	
&金合同生效日	2007年8月8日		
<b>š</b> 金管理人	交银施罗德基金管理有限公司		
<b>贴金托管人</b>	中国建设银行	股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,110,276,765.50(/)		
基金合同存续期	不定	5期	

投资目标	本基金为一只蓝筹股票基金,主要通过投资于业辖优良 发展稳定 在行业内占 有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票,在有效控制风险并保持基金资产 良好流动性的前提下,追求在稳定分红的基础上实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势。将严谨,规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,通过优选业绩优良、发展稳定,在行业内占有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票进行投资。以读来基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	75%×中证100指数+25%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,以优质蓝筹股为主要投资对象,属于证券投资基金中较高项期收益和较高风险的品种,本基金的风险与预期收益都要高于混合型基金和综金用基金。

注:本基金业绩比较基准中的原"中信金债指数"更名为"中信标普金债指数",详情见本基金管理人于2013年2月4日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准更名的

2.3基金管理	11人和基金打	£管人	
项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
	姓名	孙艳	田青
信息披露负责人	联系电话	021-61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	010-67595096
传真		021-61055054	010-66275853
2.4台自世標	产七士		

裁基金半年度报告正文的管理 b www.jyfund.com, www.jysld.com, www.bocomschroder.com

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

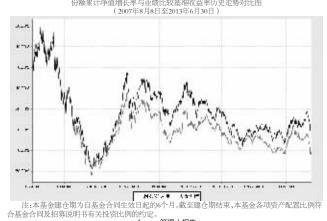
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	142,589,397.57
本期利润	-14,909,680.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0013
本期基金份额净值增长率	-0.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3628
期末基金资产净值	7,876,311,192.12
期末基金份额净值	0.7089

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

阶段	份额净值增长 率①	份額净值增长 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	-7.84%	1.68%	-12.05%	1.43%	4.21%	0.25%
过去三个月	-0.99%	1.24%	-9.79%	1.11%	8.80%	0.13%
过去六个月	-0.38%	1.28%	-11.35%	1.18%	10.97%	0.10%
过去一年	1.94%	1.14%	-7.70%	1.04%	9.64%	0.10%
过去三年	-2.11%	1.17%	-7.98%	1.02%	5.87%	0.15%
自基金合同生效 起至今	-28.13%	1.46%	-40.83%	1.45%	12.70%	0.01%

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

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金 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 (2007年8月8日至2013年6月30日)



管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

券投资基金(基金合同生效日;2013年4月24日)和交银施罗德成长30股票型证券投资基金(基金合同 中效日;2013年6月5日)。 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(助理)期限		证券从业年	说明	
X土-台	BX 95	任职日期	离任日期	限	192.95	
张媚钗	本基金的基金经理	2010-06-04	-	11年	张媚钗女士,经济学硕士。历 任申银万国证券研究所研究 员。2005年加入交银施罗德基 员。管理有限公司,历任投资研 京部研究员、基金经理助理和 专户投资经理。	
注:1、本	注:1、本表所列基金经理(助理)任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公					
(dn)活用(之日为准:						

2、本表所列基金经理(助理)证券从业年限中的"证券从业"的含义遵从中国证券业协会《证券

告(加這用)乙日为榷;

2.本表所列基金经理(助理)证券从业年限中的"证券从业"的含义遵从中国证券业协会《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循(中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规。监管部门的相关规定,本者诚实信用、勤勉尽贵的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上、为基金特有人谋求最大利益。
本报告期内、本基金整体运作合规合法。无不当内幕交易和关联交易,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金持有人利益的行为。
4.3管型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
本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合。包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。公司建立资源共享的投资研究信息平台、确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易,遵循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则、全部通过交易系统进行比例分配,对于非集中竞价交易,返循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则,全部通过交易系统进行比例分配,对于非集中竞价交易,设公司名义进行的场外交易,遵循"价格优先、比例分配"的原则按查方家对交易居集进行分配。公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控、风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别为公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异及又不同时间面口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易进程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的

报告别内华公司 格別几公平交易制度,公平内特旗下各权负担信,未及现住间地仅公平交易的行为。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本公司管理的所有投资组合未发生参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的
单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。
4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4 1报告期内基金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业绩表现说明
4.4 1报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4 1报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
宋特在较低水平。金融体系表外融资及银行同业业务在上半年大幅扩张、实体经济则呈现货币空转需求不振的转点。政府对此加强了金融风险的控制和加益。同时,伴随实体经济去库存及制造业投资低迷带来的经济下行压力,新一届政府加快推进了以市场化为导向的改革措施及结构调整。
报告期内,伴随经济规划企稳,信息服务、医药、信息设备、由于等行业盈利增速明显回升,而中上游周期品如采掘、黑色金属及有色金属等行业则受到了供给过剩及经济整体放缓的转续负面影响继续显现级软料征。上半年市场整体呈现分化加创的转点,而一季度目下而上的成长极选股逻辑得以加强,市场更偏原有事情个股、成长风格意价持续提升,报告即内本基金配置路偏成长策明部分优加强价,市场更偏原有事情个股、成长风格意价持续提升,报告即内本基金配置路偏成长策明部分优值价值价值股、在医药。电子、环保、食品及其他细分成长类行业中取得了不错的回报,但受到6月以来短期资金面的转续流对准中击、银行地产类个股整体表现略有拖累。 4.4.2报告期内基金的业绩表现

4.4.报告期內基金的业绩表现 截至2013年6月30日、本基金份额争值为0.7089元,本报告期份额争值增长率为-0.38%,同期业绩比较基准增长率为-11.35%。 4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望下半年,宏观经济在整体政策控风险的背景下。市场仍承受一定的下行压力,传统行业可能继 续承压,但稳中有为的政策基周营账者代表未来发展方向的新兴产业或仍将保持一定的估值溢价,因 此本基金将继续关注有较大市值扩张空间的行业和个般。 4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 本基金管理人制定了健全,有效的估值政策和程序,经公司管理层批准后实行,并成立了估值委员 会、估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。 公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值,保证基金估值 的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质,研究

# 交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

## 2013 半年度 报告摘要

并参考市场普遍认同的做法,建议合理的估值模型,由量化投资部进行测算和认证,认可后交各估值委

升等多币均管现代则的饭法,建议合理的估值模型、出面代权资和处了观异和以证、认为历文各估值委 员会成员从基金会计、风险、各规等方面审批、一致同意后,报公司投资总监。总经理审批。 估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性 的情况后,及时召开临时会议进行研究,及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值委员会成员均具 备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披 露情况保持应有的职业敏感。向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。本基金管理人参与 估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。 4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 本书本本书程生版书本进行初记录

4.7管理人对报告期内基金平别为公司。 本基金本报告期内未进行利润分配。 5 托管人报告

5.1报告期內本基金托管人遵规守信情况声明 本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、 基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了

基金合同,托管协议和其他有关规定,不存在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投资运作遵规守信,净值计算、利润分配等情况的说明本报告期,本托管人按照国家有关规定,基金合同,托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算,基金费用开文等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,本基金未实施利润分配。
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复核审查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。

半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表 会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金 报告截止日:2013年6月30日

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	931,387,379.74	929,143,142.8
结算备付金		8,895,899.75	3,559,611.2
存出保证金		2,808,625.49	3,797,328.9
交易性金融资产	6.4.7.2	6,174,030,165.23	7,155,927,814.3
其中:股票投资		5,826,522,825.30	7,106,336,285.5
基金投资		-	
债券投资		347,507,339.93	49,591,528.
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产	6.4.7.3	_	
买人返售金融资产	6.4.7.4	801,423,023.73	532,601,298.9
应收证券清算款		-	
应收利息	6.4.7.5	4,661,250.90	1,603,656.0
应收股利		292,687.97	
应收申购款		54,117.32	4,920,623.4
递延所得税资产		_	
其他资产	6.4.7.6	_	
资产总计		7,923,553,150.13	8,631,553,475.
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		_	
交易性金融负债		_	
衍生金融负债	6.4.7.3	_	
卖出回购金融资产款		_	
应付证券清算款		28,654,970.53	235,722,504.
应付赎回款		2,575,901.10	4,751,876.
应付管理人报酬		10,081,976.57	9,949,814.
应付托管费		1,680,329.39	1,658,302.
应付销售服务费		-	
应付交易费用	6.4.7.7	4,032,890.10	4,875,603.
应交税费		-	
应付利息		-	
应付利润		_	
递延所得税负债		-	
其他负债	6.4.7.8	215,890.32	2,436,860.
负债合计		47,241,958.01	259,394,962.
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	11,110,276,765.50	11,765,102,052.
未分配利润	6.4.7.10	-3,233,965,573.38	-3,392,943,538.
所有者权益合计		7,876,311,192.12	8,372,158,513
负债和所有者权益总计		7,923,553,150.13	8,631,553,475.

注:1、报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.7089元,基金份额总额11,110,276,765.50份。 2.本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

平1以口州:2013年1月1日王2013年6	-,,,		单位:人民币:
項 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月 30日
一、收入		78,986,914.37	694,490,252.87
1.利息收入		13,688,959.14	13,275,209.17
其中:存款利息收入	6.4.7.11	3,939,034.36	3,626,708.90
债券利息收人		2,344,308.15	1,270,254.73
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收人		7,405,616.63	8,378,245.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		222,768,718.37	-340,736,316.65
其中:股票投资收益	6.4.7.12	174,030,030.78	-387,392,464.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-244,000.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	48,738,687.59	46,900,148.08
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-157,499,078.21	1,021,872,755.13
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	28,315.07	78,605.23
减:二、费用		93,896,595.01	79,675,463.08
1.管理人报酬		62,178,196.56	61,831,428.2
2.托管费		10,363,032.72	10,305,238.0
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	21,091,624.50	7,281,838.47
5.利息支出		-	
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.20	263,741.23	256,958.37
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-14,909,680.64	614,814,789.7
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-14,909,680.64	614,814,789.7

会计主体:交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至20	013年6月30日		单位:人民币:
项目	2013	本期 年1月1日至2013年6月30日	平世:八天川
- グロ	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)	11,765,102,052.13	-3,392,943,538.93	8,372,158,513.20
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	-14,909,680.64	-14,909,680.6
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)	-654,825,286.63	173,887,646.19	-480,937,640.44
其中:1.基金申购款	33,614,590.27	-9,117,844.70	24,496,745.57
2.基金赎回款	-688,439,876.90	183,005,490.89	-505,434,386.0
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)	11,110,276,765.50	-3,233,965,573.38	7,876,311,192.12
项目	2012	上年度可比期间 年1月1日至2012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)	12,396,022,584.01	-4,393,828,286.83	8,002,194,297.18
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	614,814,789.79	614,814,789.79
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)	-302,864,861.67	95,214,838.69	-207,650,022.98
其中:1.基金申购款	35,226,062.35	-11,459,102.02	23,766,960.33
2.基金赎回款	-338,090,924.02	106,673,940.71	-231,416,983.31
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)	12,093,157,722.34	-3,683,798,658.35	8,409,359,063.99

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:战龙,主管会计工作负责人:许珊燕,会计机构负责人:朱鸣

100指数+25%×中信标普全债指数。

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 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"),中国证监会颁布的《证券投资基金自息被案XBRL模板第3号~电废银告知半年度报告>》,中国证券投资基金的有《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德蓝筹股票证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。
643 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金2013年上半年度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2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年度的经营成果和基金净值变对情况等有关信息。
644 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所采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致。
645 会计政策变更的说明
本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明 本基金本报告期未发生会计政策变更。 6.4.5.2 会计估计变更的说明 本基金本报告期未发生会计估计变更。 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

各46 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《关于正券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于企业所得税苦干优惠政策的通知》、财税[2005]105号《关于企业所得税苦干优惠政策的通知》、财税[2005]105号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关。10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证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。2013年1月1日以前、对基金取得的股息、红利收入,由上市公司投资、持税、暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前、对基金取得的危速、红利收入,由上市公司投资、持税、暂不征收企业所得税。自2013年1月1日。以对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司股票、持税期限在1个月以内含1个月的,其股息红利所得金额计人应纳税所得额;持股期限在1个月以内含1个月的,其股息红利所得金额计人应纳税所得额;持股期限在1个月以内含1年的,皆减按50%计人应纳税所得额;持股期限在1个月以内含1年的,皆减按50%计人应纳税所得额;特股期限超过1年的,皆减按50%计人应纳税所得额;

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买人股票不征收股票交易印花税。 (1)益重共田以市3以1.74年3月以中43年3月以市大利市关系的关联方发生变化的情况 6.47、美联方关系 6.47.1 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。 6.47.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

交銀施罗德基金管理有限公司("交银施罗德基金公司") 基金管理人、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、基金代销机构注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

单位:人民币元 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 项目 2013年1月1日至2013年6月30日 司的基金管理人报酬按前-注:支付基金管理人交银施罗德基金/ 计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×

1	.5% ÷ 当年天数。 6.4.8.2.2基金托管费		M. 1 . 1
			单位:人民币5
	项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	10,363,032.72	10,305,238.00
E	注:支付基金托管人中国建设银行的是 以计至每月月底,按月支付。其计算公式为		

6.4.8.2.3销售服务费

无。 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。 6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.5 由天联	万保官的银行仔款余	额及当期产生的利息	!収入		
				单位:人民币元	
	本期		上年度可比期间		
关联方名称	2013年1月1日至	2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日		
	期末余額	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
中国建设银行	931,387,379.74	3,813,496.77	546,614,811.52	3,577,477.33	
注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。					
6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况					

4.4.3 本基金上平和时间等一人取几户时间,对印度的工作的工作。 本基金本报告期内及上年度可比期间无未在承销期内参与关联方承销证券。 6.4.8 共他关联交易事项的说明 本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。 6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元 证券名称 莱宝高科 16.52 15.35 6,000,000 99,120,000.00 92,100,000.00

金额单位:人民币元 复牌 日期 期末 估值总额 数量(股 注:本基金截至2013年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。 6.49.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.2期末按行业分类的股票投资组合

			金额单位:人民币
序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,826,522,825.30	73.53
	其中:股票	5,826,522,825.30	73.53
2	固定收益投资	347,507,339.93	4.39
	其中:债券	347,507,339.93	4.3
	资产支持证券	-	
3	金融衍生品投资	-	
4	买人返售金融资产	801,423,023.73	10.1
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
5	银行存款和结算备付金合计	940,283,279.49	11.8
6	其他各项资产	7,816,681.68	0.1
7	合计	7,923,553,150.13	100.0

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				105,951,348.92	1.35
В	采矿业			15,218,173.88		0.19
С	制造业			3,949,367,544.19		50.14
D	电力、热力、燃气及水生产	"和供应业			71,430,492.32	0.93
E	建筑业			279,245,005.47		3.55
F	批发和零售业				-	-
G	交通运输、仓储和邮政业				51,691,210.56	0.66
Н	住宿和餐饮业				_	-
I	信息传输、软件和信息技	术服务业		136,827,650.45		1.74
J	金融业			_		-
K	房地产业		j <sup>2c</sup> <u>₩</u> 622,450,496.9		622,450,496.92	7.90
L	租赁和商务服务业				136,086,153.00	1.7.
M	科学研究和技术服务业				_	-
N	水利、环境和公共设施管理业				271,076,664.72	3.4-
0	居民服务、修理和其他服	务业			-	-
P	教育				-	-
Q	卫生和社会工作				_	-
R	文化、体育和娱乐业			187,178,084.87		2.38
S	综合			-		-
	合计			5,826,522,825.30		73.98

1	合计		5,826,522,825.30		73.98	
7.3期末	按公允价值占基	金资产净值比例大小	非序的前十名股	票投资明细		
					额单位:人民司	
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	002415	海康威视	10,580,004	373,897,341.36	4.	
2	600887	伊利股份	11,599,924	362,845,622.72	4.	
3	600535	天士力	9,000,000	352,350,000.00	4.	
4	000423	东阿阿胶	7,835,115	303,062,248.20	3.	
5	600383	金地集团	40,481,356	277,702,102.16	3.	
6	300070	碧水源	7,194,179	271,076,664.72	3.	
7	002081	金 螳 螂	9,416,763	268,095,242.61	3.	
8	600703	三安光电	12,712,021	249,664,092.44	3.	
9	002241	歌尔声学	6,535,989	237,191,040.81	3.	
10	000024	招商地产	9,356,000	227,163,680.00	2.	
34- +/L25	大学公子的大担生	期士甘瓜机次的庇古	DV db db db (m + + 1521)	<b>未双共工士</b> 公签Ⅲ	MAHMAKE	

7.4报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

TCL 集团 600383 金地集团 224.930.851.9 601166 202,464,839.7 骆驼股( 189,205,721.2 181,380,781.9 157,388,306.69 特变电 139,876,002.9 002415 海康威初 119,225,037.89

115,415,990.4

潞安环间

冀中能源

注:"本期累计买人金额"按买人成交金额(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

			3	並映平位:八八川
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	000651	格力电器	402,131,078.16	4.80
2	600585	海螺水泥	395,062,675.42	4.72
3	600000	浦发银行	321,632,471.05	3.84
4	600036	招商银行	300,835,941.53	3.59
5	600048	保利地产	261,656,311.22	3.13
6	601668	中国建筑	256,423,566.51	3.06
7	601601	中国太保	222,257,666.61	2.65
8	600015	华夏银行	209,955,140.39	2.51
9	601169	北京银行	203,836,898.72	2.43
10	601117	中国化学	186,612,997.78	2.23
11	002375	亚厦股份	183,862,403.71	2.20
12	002304	洋河股份	167,710,150.65	2.00
13	600690	青岛海尔	165,874,599.98	1.98
14	002431	棕榈园林	164,408,605.53	1.96
15	601166	兴业银行	161,054,964.04	1.92
16	601628	中国人寿	156,237,246.84	1.87
17	600031	三一重工	151,107,888.06	1.80
18	601088	中国神华	149,229,171.68	1.78
19	600123	兰花科创	145,163,579.13	1.73
20	000157	中联重科	144,943,888.04	1.73

7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注: "买人股票成本"或"实出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不定相关交易费用。

7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

1	国家债券	-	-
2	央行票据	99,100,000.00	1.26
3	金融债券	208,853,000.00	2.65
	其中:政策性金融债	208,853,000.00	2.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	39,554,339.93	0.50
8	其他	-	-
9	合计	347,507,339.93	4.41
7.6期末	按公允价值占基金资产净值比例大小技	非名的前五名债券投资明细	

130218

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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 报贷组合报告附注 7.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前 年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.10.	3期末具他各坝资产构成	** LD7
		单位:人民币元
序号	名称	金額
1	存出保证金	2,808,625.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	292,687.97
4	应收利息	4,661,250.90
5	应收申购款	54,117.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	7,816,681.68

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 金额单位:人民币元

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的证 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。 7.10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾

基金份额持有人信息 8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

注:本基金管理人的高级管理人员、基金投资和

占总份额 比例

责人、本基金基金经理未持有本基金

开放式基金份额变动 单位:份 11,743,885,724.35 本报告期期初基金份额总额 本报告期基金总申购份额 11,110,276,765.50

注:1、如果本报告期间发生转换人、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务; 2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。 10 **重大事件揭示** 

10.1 基金份额持有人大会决议

10.1 金並仍時時刊入八云宗以本 本基金本报告期內宋召开基金份额持有人大会。 10.2 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.基金管理人的重大人事变动,本基金管理人本报告期內未发生重大人事变动。 2.基金托管人的基金托管部门的重大人事变动;本基金托管人的基金托管部门本报告期內未发生

、八事变动。 10.3 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本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变 本基金本报告期内投资策略未发生改变。 10.5 报告期内改资策略未发生改变。 本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计

F。 10.6 管理人,托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 本基金管理人,基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1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

	交易单元 股票交易		应支付该券商		i的佣金	备注
券商名称	数量	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	
安信证券股份有 限公司	2	2,821,234,127.67	21.03%	2,549,461.57	21.02%	-
海通证券股份有 限公司	1	2,514,569,406.22	18.74%	2,289,260.15	18.87%	-
长江证券股份有 限公司	1	1,430,357,259.11	10.66%	1,284,506.80	10.59%	-
中信建投证券股 份有限公司	2	1,322,085,114.12	9.85%	1,171,591.03	9.66%	-
宏源证券股份有 限公司	2	1,021,501,741.85	7.61%	929,968.93	7.67%	-
东方证券股份有 限公司	1	881,071,531.88	6.57%	802,135.88	6.61%	-
北京高华证券有 限责任公司	1	831,619,743.62	6.20%	757,100.53	6.24%	-
中信证券股份有 限公司	1	623,991,195.42	4.65%	568,079.72	4.68%	-
中银国际证券有 限责任公司	1	495,719,256.82	3.69%	443,668.97	3.66%	-
平安证券有限责 任公司	1	480,994,357.56	3.59%	435,808.98	3.59%	-
齐鲁证券有限公 司	2	430,478,286.56	3.21%	387,281.68	3.19%	-
华泰证券股份有 限公司	2	393,864,098.30	2.94%	358,571.95	2.96%	-
中国国际金融有 限公司	1	168,811,241.03	1.26%	153,686.06	1.27%	-
东兴证券股份有 限公司	1	=	-	=	-	-
德邦证券有限责 任公司	1	=	-	=	-	-
中国银河证券股 份有限公司	1	-	-	=	-	-
方正证券股份有 限公司	1	-	-		-	-
华安证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有	1	-	-	-	-	-

10.7.2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 占当期权证成交 总额的比例 成交金额 成交金额 成交金額 100.009

注:1.报告期内,本基金交易单元未发生变化; 2.租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价 3、租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价,然

3.租用证券公司交易甲匹的程序:自先根据租用证券公司交易甲匹的延停标值处门录管FUI,然后根据评价选择基金交易甲元。研究部提交方案。并上报公司批准。

11 影响投资者决策的其他重要信息
 依据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导宽见》(证监会公告[2008]38号)的有关规定、经与基金托管人协商一致、本基金对其所持有的美的电器(证券代码;000527)自2013年1月18日起采取指数收益法进行估值,并已于2013年4月2日起恢复按市场价格进行估值。

交银施罗德基金管理有限公司