建信优化配置混合型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月26日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信优化配置混合
基金主代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月1日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,245,845,018.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择,在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究,运用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	蒋松云
	联系电话	010-66228888	010-66106912
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	010-66106904

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	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所。

§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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	372,407,580.50
本期利润	477,661,433.25
加权平均基金份额本期利润	0.0560
本期基金份额净值增长率	7.21%
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	-0.1981
期末基金资产净值	6,612,449,124.36
期末基金份额净值	0.8019

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.期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

3.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。

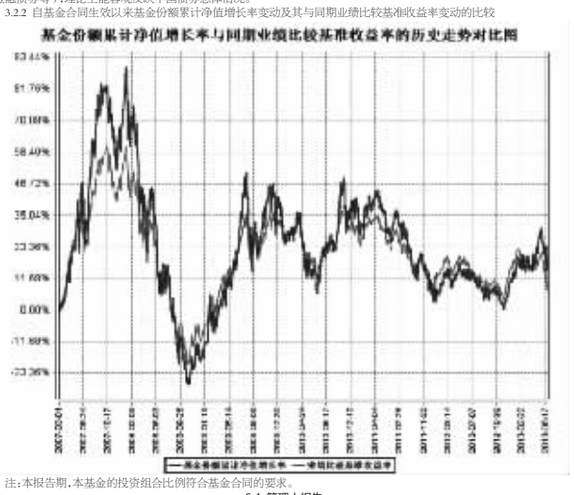
3.2 基金净值表现

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	-7.73%	1.55%	-9.51%	1.13%	1.78%	0.42%
过去三个月	0.93%	1.29%	-6.38%	0.86%	7.31%	0.43%
过去六个月	7.21%	1.23%	-5.81%	0.88%	13.02%	0.35%
过去一年	5.86%	1.02%	-5.23%	0.81%	11.09%	0.21%
过去三年	9.95%	1.16%	-4.03%	0.82%	13.98%	0.34%
自基金合同生效起至今	18.49%	1.66%	8.68%	1.18%	9.81%	0.48%

注:本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×中国债券总指数。其中:富时中国A600指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准,中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。富时中国A600指数由新华富时指数公司发布,该指数包含中国深沪两个市场流通市值最大的六百家上市公司,涵盖了几乎所有行业。该指数在市场代表性、市场相关度、流动性等方面具备作为基准指数的可行性。中债系列指数由一个总指数(即中国债券总指数)、若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数,包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券(如交易所和银行间国债、银行间金融债券等),理论上能客观反映中国债券总体情况。

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



注:本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作、致力成为“最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至2013年6月30日,公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金31只开放式基金和建信信用增强债券型证券投资基金1只封闭式基金,管理的基金资产规模共计为483.16亿元。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陶灿	本基金的基金经理	2011年7月11日	-	6	硕士,2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理,2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理。
乔林建	本基金的基金经理	2013年1月5日	-	11	硕士,2002年6月起就职于新华人寿保险公司,历任研究员、投资经理;2006年6月起就职于新华资产管理公司,任高级投资经理。2008年2月加入我公司,历任高级投资经理、资深投资经理、基金经理助理,2013年1月5日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理。
顾中汉	研究部副总监、本基金的基金经理	2011年12月13日	2013年5月3日	9	硕士。曾任北京市房管局科员,2004年4月起就职于易方达基金管理公司,历任交易员、研究员、基金经理助理、投资经理,2010年1月至2011年5月任社保109组合的投资经理。顾中汉于2011年6月加入本公司,2011年10月11日起任建信恒久价值股票型证券投资基金基金经理;2011年12月13日至2013年5月3日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规,部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责,安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

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

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合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成交量的5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

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

2013年上半年市场分化剧烈,依照周期与成长的风格划分,沪深300与中小板、创业板走势反差极致鲜明。期间,经济复苏预期从强变弱乃至下滑,传统周期行业经历较大幅度调整,而相对集中新兴产业当中的成长股,则受到政策扶持、以及自身行业景气的上行,而估值得到进一步提升。

本基金紧密跟踪宏观经济和政策变化,注重判断行业景气趋势,积极进行组合管理,在周期和成长之间做出相对均衡的选择。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为7.21%,波动率为1.23%,业绩比较基准收益率为-5.81%,波动率为0.88%。

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,稳增长与控通胀构成政策上下限,从目前政策趋势来看,稳增长的动力在增强,经济失速下滑的风险在减小。证券市场创业板再融资将大概率推行,市场风格的演绎是延续上半年的情形,还是出现收敛是市场关注的焦点,总体上,我们采取比较谨慎的态度,在估值和行业景气的权衡中寻找合适的配置,为持有人创造回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2008]38号文《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,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,拟基金估值委员会审议批准。

4.6.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

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管理费	50,808,848.27	51,726,334.05
其中:支付销售机构的客户维护费	7,893,299.06	8,022,082.10

注:1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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 X 1.50% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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	8,468,141.37	8,621,055.66

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 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	
	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	1,493,307,398.24	4,363,635.75	605,432,024.50	3,610,685.00

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末及上年度可比期间,本基金未发生其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备注
300133	华策影视	2013年5月27日	重大资产重组	24.43	2013年7月30日	26.87	1,972,884	23,154,191.50	48,197,556.12	-
300020	银江股份	2013年5月31日	重大资产重组	22.67	-	-	1,236,577	23,161,551.31	28,033,200.59	-
600284	浦东建设	2013年6月21日	重大资产重组	9.50	-	-	2,645,110	27,196,492.68	25,128,545.00	-
002660	茂硕电源	2013年6月5日	重大资产重组	11.77	2013年7月19日	10.59	1,303,690	14,919,011.63	15,344,431.30	-
000998	隆平高科	2013年5月3日	重大资产重组	20.73	2013年7月8日	20.50	654,392	12,924,874.36	13,565,546.16	-

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生重大影响而被暂时停牌的股票,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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末,本基金无银行间市场债券正回购交易余额,故未存在作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末,本基金无交易所市场债券正回购交易余额,故未存在作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(ⅰ)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ⅱ)各层次金融工具公允价值

于2013年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为4,802,998,943.51元,属于第二层级的余额为130,269,279.17 元,无属于第三层级的余额(2012年6月30日:第一层级5,304,806,407.56 元,第二层级243,550,000.00元,无第三层级)。

(ⅲ)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

(ⅳ)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	4,725,025,234.58	70.99
	其中:股票	4,725,025,234.58	70.99
2	固定收益投资	208,242,988.10	3.13
	其中:债券	208,242,988.10	3.13
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	181,600,592.40	2.73
	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	1,506,418,941.00	22.63
6	其他各项资产	34,299,836.16	0.52
7	合计	6,655,587,592.24	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	152,555,796.76	2.31
B	采矿业	101,755,279.98	1.54
C	制造业	2,522,028,642.52	38.14
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	95,508,866.30	1.44
E	建筑业	47,121,963.16	0.71
F	批发和零售业	10,619,892.81	0.16
G	交通运输,仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	344,255,069.70	5.21
J	金融业	177,796,177.69	2.69
K	房地产业	730,270,573.16	11.04
L	租赁和商务服务业	299,581,905.26	4.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利,环境和公共设施管理业	190,585,091.32	2.88
O	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	52,945,975.92	0.80
S	综合	-	-
	合计	4,725,025,234.58	71.46

注:以上行业分类以2013年6月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

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	002344	海宁皮城	10,566,826	201,932,044.86	3.05
2	000625	长安汽车	19,800,186	183,943,727.94	2.78
3	600887	伊利股份	4,255,497	133,111,946.16	2.01
4	002410	广联达	7,005,052	132,815,785.92	2.01
5	000002	万 科A	12,873,928	126,808,190.80	1.92
6	600340	华夏幸福	3,618,119	117,733,592.26	1.78
7	300070	碧水源	3,018,876	113,751,247.68	1.72
8	000671	阳 光 城	9,222,063	109,281,446.55	1.65
9	002241	歌尔声学	2,661,905	96,600,532.45	1.46
10	601888	中国国旅	3,173,783	92,674,463.60	1.40

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www.ccbfund.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	000001	平安银行	276,172,944.73	4.21
2	600016	民生银行	234,875,490.12	3.58
3	601166	兴业银行	223,913,473.56	3.41
4	000625	长安汽车	173,109,804.85	2.64
5	600837	海通证券	168,970,576.74	2.57
6	600329	中新药业	137,968,500.13	2.10
7	002146	荣盛发展	135,879,921.58	2.07
8	002410	广联达	133,112,490.02	2.03
9	601288	农业银行	126,282,296.96	1.92
10	600108	亚盛集团	118,827,623.19	1.81
11	600795	国电电力	111,435,657.01	1.70
12	000671	阳 光 城	110,048,259.41	1.68
13	600030	中信证券	109,851,903.76	1.67
14	600340	华夏幸福	104,034,157.13	1.58
15	600383	金地集团	102,526,119.32	1.56
16	600089	特变电工	102,025,114.97	1.55
17	600256	广汇能源	101,216,104.65	1.54
18	002106	莱宝高科	96,099,850.27	1.46
19	601318	中国平安	95,097,757.24	1.45
20	000656	金科股份	94,198,173.19	1.43

注:上述买入金额为买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

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	600519	贵州茅台	276,222,140.22	4.21
2	000001	平安银行	254,574,773.34	3.88
3	601318	中国平安	244,714,369.25	3.73
4	000002	万 科A	235,397,597.56	3.59
5	601166	兴业银行	234,474,443.34	3.57
6	600016	民生银行	211,914,586.11	3.23
7	600887	伊利股份	192,425,161.41	2.93
8	000024	招商地产	185,231,260.60	2.82
9	600048	保利地产	181,125,566.19	2.76
10	601601	中国太保	170,238,947.33	2.59
11	600329	中新药业	131,563,343.93	2.00
12	000895	双汇发展	129,436,158.95	1.97
13	600837	海通证券	129,395,696.93	1.97
14	601288	农业银行	116,140,593.85	1.77
15	600422	昆明制药	114,952,473.01	1.75
16	600795	国电电力	105,580,969.69	1.61
17	600030	中信证券	100,410,055.66	1.53
18	600256	广汇能源	99,362,966.45	1.51
19	600809	山西汾酒	96,033,174.05	1.46
20	002106	莱宝高科	94,827,296.05	1.44

注:上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

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	10,289,574,802.48
卖出股票收入(成交)总额	10,356,473,390.92

注:上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	208,242,988.10	3.15
8	其他	-	-
9	合计	208,242,988.10	3.15

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	110003	新钢转债	1,128,390	117,521,818.50	1.78
2	110015	石化转债	624,830	62,370,530.60	0.94
3	110022	同仁转债	214,350	27,786,190.50	0.42
4	110023	民生转债	5,430	564,448.50	0.01

7.7 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。

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

7.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 本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。

7.10.3 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	2,544,632.99
2	应收证券清算款	26,571,760.52
3	应收股利	1,178,587.29
4	应收利息	3,012,217.18
5	应收申购款	992,638.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,299,836.16

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

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	117,521,818.50	1.78
2	110015	石化转债	62,370,530.60	0.94
3	110022	同仁转债	27,786,190.50	0.42

7.10.5 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 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

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	
325,896	25,302.07	4,592,759.64	0.06%	8,241,252,258.93	99.94%	

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	91,457.13	0.00%

注:截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年3月1日)基金份额总额	9,658,655,708.23
本报告期期初基金份额总额	8,776,172,978.59
本报告期基金总申购份额	56,018,955.62
减:本报告期基金总赎回份额	586,346,915.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,245,845,018.57

注:上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期,本基金未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

我公司于2013年3月28日召开2013年度第一次临时股东会,会议决定与公司控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的马鞭琴女士、俞斌先生不再担任公司董事,增选中国建设银行股份有限公司提名的曹伟先生和美国信安金融集团提名的欧阳伯权先生担任公司董事,公司已将前述董事任免情况报告备案至中国证监会基金部和北京监管局,公司目前现有9名董事,其中与控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的董事为3名,符合《证券投资基金管理公司管理办法》第四十一条第三款的监管要求。 2013年6月20日我公司第三届董事会第十二次临时会议一致同意副总经理张延明离职,我公司于2013年6月20日正式上报中国证券投资基金业协会和北京证监局备案,并于2013年6月21日获得中国基金业协会的备案文件。我公司于2013年6月22日对外公告,张延明于2013年6月20日正式离职。 报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今,本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责,以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。 本报告期内,本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

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

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	
长江证券	1	1,936,360,988.35	9.38%	1,702,254.53	9.28%	-
中信证券	1	1,768,759,191.34	8.57%	1,579,106.31	8.61%	-
长城证券	2	1,738,614,284.08	8.42%	1,533,853.45	8.36%	-
东北证券	2	1,662,436,324.75	8.05%	1,489,381.00	8.12%	-
申银万国	1	1,611,513,250.16	7.81%	1,424