Disclosure 信息披露

§ 1 重要提示

9.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所教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 集积实整性率担个别及准带的进程责任。本字中度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签处。 基金社管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月23日复核了本报告中的财务指标。净值表 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置能记载,误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人承诺以减实信用,勤勉是劳助原则管理和应用基金资产但不保证基金一定遏制。 基金管理人承诺以减实信用,勤勉是劳助原则管理和应用基金资产但不保证基金一定通利。

§ 2 基金简介

7 M C W C W C
本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。
本报告中财务资料未经审计 。
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
Γ ₀

2.1 基金基	本情况				
基金简称		民生加银红利回报混合			
基金主代码		690009			
交易代码		690009			
基金运作方式		契约型开放式			
基金合同生效	H	2012年8月9日			
基金管理人		民生加银基金管理有限公司			
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 597,110,449.50份					
基金合同存续	朝	不定期			
2.2 基金产	品说明				
投资	E目标	本基金通过灵活的资产配置,重点投资于历强的上市公司,在充分控制基金资产风险和业绩比较基准的投资回报,争取实现基金资	保证基金资产流动性的基础上,追求超越 产的长期稳健增值。		
投资	後策略	本基金在制定投资策略时,将充分考虑国家 时依据政策的变化而对投资策略进行相应的 配置 SAA 凝准上,更注重互用战术性资产 等大类资产配置。基基金在进行股票配置时 平等角度筛选出具有良好盈利前景和分红港 策略主要包括债券投资组合策略和个券选择	與放政策、货币政策以及产业政策,并及 加惠等。本基金资产配置是在战略性资产 配置 (TAA)來构建和动态调整股票,债券 将从分红能力和动力、盈利前景、估值水 分力的公司进行投资。本基金的债券投资 等策略。		
业绩日	2较基准	中证红利指数收益率×60%+中证国债指数收	益率×40%		
风险收	ζ 益特 征	本基金属于主动式混合型证券投资基金,通和债券型基金,低于股票型基金。	首常预期风险收益水平高于货币市场基金		
2.3 基金管	理人和基金托管	į.			
项	Ħ	基金管理人	基金托管人		
名	称	民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司		
信自抽電名	姓名	张力	田青		

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网坛

3.1.1 期间数据和指标	金額单位:人民币: 报告期 2013年1月1日 - 2013年6月30日)
3.1.1 州间级临阳信怀	(収古朔 12013年1月1日 = 2013年6月30日)
本期已实现收益	169,173,366.60
本期利润	108,363,086.19
加权平均基金份额本期利润	0.0850
本期基金份額净值增长率	2.53%
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額利润	0.0134
期末基金资产净值	605,129,635.68
期末基金份额净值	1.013

	3.2 恭並伊恒表現							
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								
分響争値増长 分響争値増 必響をを 必要を 必要を 必要を 必要を の一③ の一④ の一③ の一④ の一○ の								
过去一个月	-7.91%	1.40%	-10.25%	1.16%	2.34%	0.24%		
过去三个月	1.30%	1.07%	-7.81%	0.89%	9.11%	0.18%		
过去六个月	2.53%	1.06%	-7.48%	0.98%	10.01%	0.08%		
自基金合同生 效起至今 1.30% 0.89% -2.28% 0.88% 3.58% 0.01%								
3.2.2 自基金	合同生效以来基	金份额累计净值	直增长率变动及	其与同期业绩比较	交基准收益率变动的	比较		

基金价额累计净值增长率与同期业级比较基准收益率的历史走势对比图 9.50% 2.39% 0.00% 4.789 7:75 -2.565 从各等機能分別的預长率 使器化差量指数差率 注:本基金合同于2012年8月9日生效,本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

4.1 基金管理人及基金经理情况

任公司共同发起设立的中外合资基金票据公司。20中国电监 至(2006)118/写久机(电) 2000年1173以 1000年1173以 2000年1173以 2000年117

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	-1-PR	
吴剑飞	民生加银景气行业 股票、民生加银红 利回报混合基金经 理、公司副总经理、 投资决策委员会主 席	2012年8月9日	-	13年	北京大学光年管理学院工商管理硕士。自2000年起长后任职于长盛基金管理有限 2000年起长后任职于长盛基金管理有限 公司、泰达宏利基金管理有限公司、任研 交员、基金经理助理、基金经理等职; 2005年加入建信基金管理有限公司、任 基金经理、投资决策委员会委员、投资部 通识监:2009年加入平安资产管理公司。 任股票投资部总经理;2011年加入本公司。
	述任职日期、离任日!				外披露的任免日期填写。

注①上述任职日期,张任日期报准本基金合同生效日成本基金管理对外披露的任免日期城写。②证券从业的含义遵从证券业从业人员资格管理办法的相关规定。
②证券从业的含义遵从证券业从业人员资格管理办法的相关规定。
42 管理从对报告期内法基金资作建设产信债况的访到
本报告期内,基金管理人严格遵守证券投资基金法)及L值相关法律法规。证监会规定和基金合同的约定,本着诚实
用、勤起之劳助原则被重加证用基金资产产产产的核助规则的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体会治会规工指率基金份额持有人和热的行为。
43 管理人对报告期内公平交易制度和现分。
43 管理人对报告期内公平交易制度和公司公平交易制度和导意见),完善了公司公平交易制度,制度的范围包括境内上市股票。借券的一级市场市场或分量等所有处营资理活动。同时包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理运动相关的各个环形。形成了有效的公平交易标件体系。
对于场内交易公司自用了交易系统中的公平交易程序。在指令分发指令执行阶段。均由系统强制执行公平委托。此外公司严格投资部汇制设资组合之间的同日应则应复易。对于场内交易公司宣第银行间市场交易。交易所尤增交易等申申等以公司及发进行的交易。及投资组会获得公平的交易成。对于部份债券一级市场市场交易。交易所尤某交易等申申等以公司及发进行的交易。及投资组会实现的企业等企业的交易。对于部份债券一级市场市场之务。交易所允累之务等申申等以公司及发进行的交易。各投资组会经营组合实现的交易的核密制量、公司按照价格优先,比例分配的原则对文易、是投资组会数理在交易前独市成本基金管理从工程会的更多,本报告期内。基金管理人工程在任务,有投资组合参与的交易所从开发价间日反向交易。本报告期的情况。
43.2 异常交易不分的专项设则

。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截至2013年6月30日,本基金份额净值为1.013元,本报告期内份额净值增长率为2.53%。同期业绩比较基准收益率

\$1.报告期內本基金托管人遵规守信信况声明 本报告期中国建设银行股份有股合有限 在基金托管人遵规守信信况声明 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,不存在报害基金份额榜有人利益的行为完全尽限尺需地履行了基金托管人应尽的义务。
\$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 未报告的报报值整有关规定,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,基金费用开支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管,未发观基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

用开文章中即近江; 40000的行为。 报告期内,本基金未实施利润分配。 5.3 托管别人对本学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。 80半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金 报告截止日: 2013年6月30日					
A I I I I I I I I I I I I I I I I I I I	J		单位:人民币 5		
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		77,943,259.02	149,727,746.81		
结算备付金		3,361,869.33	6,448,568.37		
存出保证金		908,756.32	-		
交易性金融资产		472,009,231.66	1,808,004,874.81		
其中:股票投资		466,635,231.66	1,587,057,874.81		
基金投资		-	-		

	附注号	本期末 2013年6月30日	単位:人民币: 上年度末 2012年12月31日
		2013年6月30日	2012年12月31日
资产:			
银行存款		77,943,259.02	149,727,746.81
结算备付金		3,361,869.33	6,448,568.37
存出保证金		908,756.32	-
交易性金融资产		472,009,231.66	1,808,004,874.81
其中:股票投资		466,635,231.66	1,587,057,874.81
基金投资		-	_
债券投资		5,374,000.00	220,947,000.00
资产支持证券投资		_	_
行生金融资产		_	-
买人返售金融资产		30,000,000.00	
应收证券清算款		45,515,065.68	289,761,266.08
立收利息		87,812.17	5,084,548.19
应收股利		787,043.08	_
立收申购款		39,410.92	15,026.37
递延所得税资产		_	-
其他资产		_	-
资产总计		630,652,448.18	2,259,042,030.63

民生加银红利回报灵活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

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		-	
卖出回购金融资产款		-	
应付证券清算款		16,621,783.67	
应付赎回款		5,364,469.53	16,170,493.68
应付管理人报酬		830,209.68	2,795,369.56
应付托管费		138,368.29	465,894.93
应付销售服务费		-	
应付交易费用		1,267,415.82	2,516,695.74
应交税费		1,092,800.00	1,092,800.00
应付利息		-	
应付利润		-	
递延所得税负债		-	
其他负债		207,765.51	203,206.35
负债合计		25,522,812.50	23,244,460.26
所有者权益:			
实收基金		597,110,449.50	2,262,117,904.10
未分配利润		8,019,186.18	-26,320,333.73
所有者权益合计		605,129,635.68	2,235,797,570.3
负债和所有者权益总计		630,652,448.18	2,259,042,030.63

注:1报告截止日2013年6月30日、基金份额净值1.013元、基金份额总额597,110,449.50份。 2.本基金台同于2012年8月9日生效,放无对比期间财务报表数据。 6.2 利润表 会计主体民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期: 2013年1月1日 至 2013年6月30日

项目	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 30日
一、收入		127,302,799.53	
1.利息收入		3,257,164.39	
其中:存款利息收入		887,798.76	
债券利息收入		821,725.49	
资产支持证券利息收入		_	
买人返售金融资产收入		1,547,640.14	
其他利息收入		-	
2.投资收益 假失以 ""填列)		182,233,861.14	
其中:股票投资收益		167,446,561.23	
基金投资收益		-	
债券投资收益		9,127,062.31	
资产支持证券投资收益		_	
衍生工具收益		-	
股利收益		5,660,237.60	
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)		-60,810,280.41	
4. 汇兑收益 假失以""号填列)		-	
5.其他收入 假失以 ""号填列)		2,622,054.41	
减:二、费用		18,939,713.34	
1.管理人报酬		9,827,059.20	
2.托管费		1,637,843.17	
3.销售服务费		-	
4.交易费用		7,251,092.02	
5.利息支出		-	
其中:卖出回购金融资产支出		-	
6.其他费用		223,718.95	
三、利润总额 医损总额以 ""号填列)		108,363,086.19	
减:所得税费用		-	
四、净利润(净亏损以""号填列)		108,363,086.19	

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月	∃30⊟		单位:人民币元
项目	本期 2013年1月1日至2013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 偡金净值)	2,262,117,904.10	-26,320,333.73	2,235,797,570.37
二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期净利润)	-	108,363,086.19	108,363,086.19
三、本期基金份额交易产生的基金净 值变动数(争值减少以""号填列)	-1,665,007,454.60	-74,023,566.28	-1,739,031,020.88
其中:1.基金申购款	8,645,886.46	348,277.99	8,994,164.45
2.基金赎回款	-1,673,653,341.06	-74,371,844.27	-1,748,025,185.33
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)	597,110,449,50	8,019,186,18	605,129,635.68

______朱晓光___ 主管会计工作负责人

金资产净值%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金股票资产部分至少80%投资于红利股票。本基金的业绩 比较基准为一世证利指数收益率460%。中证证利指数收益率460%。 6.42 会计报表的编制基础 本财务报表存提照中国财政部2006年2月颁布的(企业会计准则一基本准则)和38项具体会计准则、其后颁布的应用 指南、顺春以及其他相关规定(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按照方面。也参考了中国 博幸业检查物理的证券投资基金的主核重块分析引)、中国证金参加定的(关注一步规范证券投资基金信息少的目 导意见)(关于证券投资基金均长企业会计准则为信业多及份额净信计价有关事项的通知)(证券投资基金信息按照 管理办法)(证券投资基金均支援实金均未完)则等的"保证报告的内容"与格式》(证券投资基金自按据 管理办法)(证券投资基金均量据内等与基本式使制)第3号(平程报告的内等格式)(证券投资基金自按据 则)第3号(会计报表附注的编制及按照),(证券投资基金信息按据XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>)及其他中 本维务报报以本基金持续经营办基础到报。

0-4.3 建隔近至空门间隔及乐地有大规定的严明 本财务报表符合企业会计幅则要集,真实,整地反映了本基金于2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至 2013年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。 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 本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

:基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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 但自分批准值。例如他,自然依如是如何先天民。自2008年9月19日度,而然由由证方依证为(依例)之の中化优化年录的印花规(受证方不相似或,晚年不用他或,我是不是 印花规(受证方不相似或,晚年来) 置改革过程中国性法通股股东向成通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免证使用花规。

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、对证券投资基金付别式证券投资基金,不放式证券投资基金)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: 程据财政部。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的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

6.4.7、果胺方关系 6.4.7.1 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 本基金本报告期不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。 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称 生加银基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 生加银基金管理有限公司 国建设银行股份有限公司(中国建设银行") 走;下连关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 6.48 本报告则及上年度可比期间的关联方交易 本基金合同于2012年3月9日生效 就无上年度可比期间数据。 6.48.1 海过关联方交易单元进行的交易

648.11 股票交易 基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。 648.12 权证交易。 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。 648.13应支持关联方的佣金 本基金本报告期来发生应支付关联方的佣金。

6.4.8.2.1 基金管理费

当期发生的基金应支付的管理费

中,支付销售机构的客户维护费

1.049,730
注:1)基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=Ex1.50%/当年天数
H=5x1.50%/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、基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。
2)基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。
2)基金管理费于2013年上半年末尚未支付的金额为830,209.68元,于2012年末尚未支付的金额为2,795,369.56元。
6.48.2.2 基金托管费

单价人尽

2013年1月1日至2013年6月30日 1,637,843.17

本期 2013年1月1日至2013年6月30日

9,827,059.2

\$P\$发生的基金应支付的扩管费

让1,637,84
注1,适金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
HE50,25%的当年天数
H为每日应支付的基金托管费
医为前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
HE50,25%的当年发生的最多设产净值
基金托管费每日计提送日景计至每个月月末按月支付。
2) 基金托管费于2013年上半年末尚未支付的金额为138,368,29元,于2012年末尚未支付的金额为465,894,93元。
4.48.4 与关联方进行组行间回业市场的债券(仓回购)交易。
4.48.4 含关联方进行组行间回业市场的债券(仓回购)交易。
6.48.4.1 报告期户基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告朝无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.48.4.2 报告期末除基金管理人运用的定资金投资本基金的情况
6.48.4.2 报告期末除基金管理人之外的支他关联方投资本基金的情况

					单位:人民币元		
ſ	关联方 名称 2013年1月1日		本期 至2013年6月30日	上年度可 2012年1月1日至2			
	石你	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入		
Γ	中国建设银行	77,943,259.02	838,302.86	-	-		
_	注: 木基会的銀行存款由基金耗管 人由围建设銀行保管 按銀行同业利率计自						

无。 64.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券 64.91 因认购新发增发证券而干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干期末持有的流通受限证券。 64.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

复牌 复牌 日期 开盘单价 期末 成本总额 期末估值总额 数量(股)

6.49.3 開東の参正回购交易中作为抵押的债券 6.49.3 1 銀行向市场债券正回购 6.49.3 1 銀行向市场债券正回购 截至本报告開東2013年6月30日止本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。 6.49.3.2 交易所市场储券正回购 截至本报告期来2013年6月30日止,本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。 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承诺事项 截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

2共他爭项 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

序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	466,635,231.66	73.99
	其中:股票	466,635,231.66	73.99
2	固定收益投资	5,374,000.00	0.85
	其中:债券	5,374,000.00	0.85
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	_
4	买人返售金融资产	30,000,000.00	4.76
	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	81,305,128.35	12.89
6	其他各项资产	47,338,088.17	7.51
7	合计	630,652,448.18	100.00

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 %)
农、林、牧、渔业	41,099,459.52	6.79
采矿业	13,987,500.00	2.31
制造业	328,883,330.69	54.35
电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,557,000.00	1.91
建筑业	-	-
批发和零售业	-	-
交通运输、仓储和邮政业	-	-
住宿和餐饮业	-	-
信息传输、软件和信息技术服务业	21,412,625.00	3.54
金融业	33,739,551.45	5.58
房地产业	-	-
租赁和商务服务业	4,025,000.00	0.67
科学研究和技术服务业	-	-
水利、环境和公共设施管理业	-	-
居民服务、修理和其他服务业	-	_
教育	-	-
卫生和社会工作	-	-
文化、体育和娱乐业	-	-
综合	11,930,765.00	1.97
合计	466,635,231.66	77.11

					金額单位:人民币:
序号	股票代码	股票名称	数量(段)	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	600519	贵州茅台	179,856	34,598,898.72	5.72
2	600495	晋西车轴	2,923,181	29,933,373.44	4.95
3	600809	山西汾酒	1,185,505	29,044,872.50	4.80
4	600276	恒瑞医药	1,100,000	28,996,000.00	4.79
5	000998	隆平高科	1,500,000	27,705,000.00	4.58
6	601166	兴业银行	1,100,000	16,247,000.00	2.68
7	000001	平安银行	1,580,513	15,757,714.61	2.60
8	300088	长信科技	699,700	14,756,673.00	2.44
9	300119	瑞普生物	699,712	14,714,943.36	2.43
10	600887	伊利股份	464,119	14,517,642.32	2.40
注:投	资者欲了解本	报告期末基金投资	资的所有股票明细,应阅	读登载于民生加银基金	全管理有限公司网站的半年度打

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

7		山州初高並贝) (平直25		金額单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 %)
1	002028	思源电气	54,876,970.38	2.45
2	600332	广州药业	47,237,280.34	2.11
3	601318	中国平安	47,017,464.75	2.10
4	600519	贵州茅台	43,532,256.07	1.95
5	000998	隆平高科	42,479,200.79	1.90
6	002477	雏鹰农牧	41,929,872.49	1.88
7	600199	金种子酒	41,000,009.21	1.83
8	600060	海信电器	40,934,514.84	1.83
9	300119	瑞普生物	38,221,563.03	1.71
10	600276	恒瑞医药	37,705,627.73	1.69
11	300205	天喻信息	37,230,102.63	1.67
12	600809	山西汾酒	34,957,003.37	1.56
13	000598	兴蓉投资	33,607,556.37	1.50
14	002023	海特高新	33,304,299.55	1.49
15	600495	晋西车轴	31,628,570.09	1.41
16	002554	惠博普	29,346,464.38	1.31
17	600240	华业地产	25,610,193.18	1.15
18	600406	国电南瑞	25,373,564.25	1.13
19	300105	龙源技术	25,324,009.48	1.13
20	000009	中国宝安	25,218,081.66	1.13

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

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	金額甲位:人民市: 占期初基金资产净值比例 %)
1	600519	贵州茅台	101,521,373.31	4.54
2	300088	长信科技	93,554,106.11	4.18
3	600458	时代新材	92,373,696.08	4.13
4	600993	马应龙	83,368,782.28	3.73
5	600271	航天信息	75,095,796.82	3.30
6	600111	包钢稀土	64,875,511.06	2.90
7	600495	晋西车轴	61,913,789.76	2.77
8	600489	中金黄金	61,789,120.55	2.76
9	600118	中国卫星	57,880,668.72	2.59
10	600559	老白干酒	57,359,541.68	2.5
11	002155	辰州矿业	56,184,030.49	2.5
12	600547	山东黄金	54,303,058.15	2.4:
13	600332	广州药业	53,667,562.70	2.40
14	002028	思源电气	52,393,149.34	2.34
15	002407	多氣多	51,545,932.12	2.3
16	600893	航空动力	49,501,981.09	2.2
17	300205	天喻信息	47,169,236.26	2.1
18	002299	圣农发展	41,662,425.30	1.80
19	002501	利源铝业	41,292,026.12	1.83
20	600549	厦门钨业	41,219,535.35	1.8-
		17 按卖出成交金额(成3 总额及卖出股票的收力	交单价乘以成交数量)填列,不考虑 人总额	8相关交易费用。

1,619,678,544.89

7.5 月	用末按债券品种分类的债券投资组合	ī	金額单位: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	5,374,000.00	0.89
8	其他	-	-
9	合计	5,374,000.00	0.89

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

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本基金本报告期未来持有资产支持证券。
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
7.5报告期末本基金投资的股排期贷为占情况说明
7.5报告期末本基金投资的股排期贷为合和损益明细本基金未提合服务股份

7.5.2.4%並及以成立用可以的以及地位 本基金以避免储和有效管理为目标。在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指朝房的投资。本基金在进行股指期货 投资中,将分析股指期货的收益性、流动性及风险转征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究现货和期货市 场的发展趋势,运用定价模型对其进行合理估值。谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调整投资组合仓位,以

降低组合风险、提高组合的运作效率。 7.10 投资组合报告附注 7.10 打声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

谴责、处罚的情形。 2013年2月22日、贵州茅台通股份有限公司控股子公司贵州茅台通销售有限公司收到贵州省物价局《行政处罚决定 黔沙处[0313]号》本基金投资上还股票的决策程序符合相关法律法规的要求。 本基金特有的其余九名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、 间的情形。 7.10.2声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。 报告期内本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 7.10.3 期末其他各项资产构成

		単位:人民币ラ
序号	名称	金额
1	存出保证金	908,756.32
2	应收证券清算款	45,515,065.68
3	应收股利	787,043.08
4	应收利息	87,812.17
5	应收申购款	39,410.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,338,088.17
7.10.4	4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细	

占基金资产净值比例 66) 序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 占基金资产净值比例 %) 流通受限情况说明

8.1 期末基:	金份額持有人户数及		- 基本 / 1 (秋) 7	一円八旧心			
							份额单位:6
				持有。	人结构		
持有人户数	户均持有的基金 份额	机构投资者		个人投资者			
(户)		持有份	分额	占总份额比 例		持有份额	占总份额比 例
5,502	108,526.07	135	282,297.74	22.66%		461,828,151.76	77.34%
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况							

基金合同生效日(2012年8月9日)基金份额总额 3,045,236,217.81 _____ 本报告期期初基金份额总额 2,262,117,904.10 本报告期基金总申购份额 8,645,886.46

本报告期期末基金份额总额 10.1 基金份额持有人大会决议 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动 本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情况

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

		股票交	易	应支付该券商的佣金			
券商名称	交易单元 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	备注	
国信证券股份 有限公司	1	618,096,469.32	14.05%	552,681.21	14.04%	-	
申银万国证券 股份有限公司	1	461,921,913.74	10.50%	420,533.50	10.68%	-	
中信证券股份 有限公司	1	440,910,147.13	10.02%	401,404.43	10.20%	-	
安信证券股份 有限公司	2	367,720,562.07	8.36%	332,287.79	8.44%	-	
招商证券股份 有限公司	1	333,703,747.04	7.58%	299,417.62	7.61%	-	
国金证券股份 有限公司	1	331,248,465.20	7.53%	301,569.48	7.66%	-	
长江证券股份 有限公司	1	325,559,070.70	7.40%	293,701.31	7.46%	-	
海通证券股份 有限公司	1	300,010,315.13	6.82%	273,128.30	6.94%	-	
国泰君安证券 股份有限公司	1	293,678,709.71	6.67%	262,730.35	6.67%	-	
银河证券股份 有限公司	2	283,965,910.77	6.45%	220,687.09	5.61%	-	
中国国际金融 有限公司	2	265,520,865.44	6.03%	234,960.30	5.97%	-	
民生证券股份 有限公司	1	163,928,264.17	3.73%	149,240.38	3.79%	-	
中银国际证券 有限责任公司	2	148,257,934.50	3.37%	134,973.20	3.43%	-	
中国中投证券 有限责任公司	1	63,109,372.27	1.43%	57,454.74	1.46%	-	
广发证券股份 有限公司	1	2,575,214.22	0.06%	2,344.42	0.06%	-	
山西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
东吴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
光大证券股份 有限公司	1	_	-	-	-	-	
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
齐鲁证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
平安证券有限	1	-	-	-	-	-	
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
东海证券有限 责任公司	1	_	-	-	-	-	

服务。 ②券商专用交易单元选择程序: i投研能力打分:由投资。研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分,填写《券商评价表》 ii指定租用方案:由交易部根据评价结果,结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案;

11 指定程用方案:由交易邮根据评价结果,指台公司租用原应要表而是具体的陈证租用方案; 前公司领导申账公司领导对信权租用穷建产程度,是是一种企程保险意见; 扩交易部治谈交易都指减令人就租用审定等业务与券商一并进行治谈,并起草相关书面协议; V 律师审议,所在租用协议全公司监查解除部的律师进行法律审计; vi交易部经办,居位租用协议全公司监查解除的转师进行法律审计; vi运通测试(应良效产能等型)交易部通知后,原始等务商技术人员外租用席位并产量等方面的测试; vii通测式管行。信息技术都测试通过后,应及时通知投资部、交易都及运营部,由运营部通知托管行有关席位的具体

, ix席位启用:交易席位正式使用.投资部、交易部、运营部有关人员须提前做好席位启用的准备工作。

ix断位自用:交易席位正式使用:投资席、交易那、运营部有关人员须提前做好席位自用的准备工作。 本基金管理人与被逐移的寿命签了泛易申完组用的技,请加贴金社管人。 ②本基金合同于2012年8月9日生效:根据以上标准,本期分别选择了安信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、资 证券股份有限公司、国泰君安证券股份有股公司、国信证券股份有股公司、海通证券股份有限公司、将应证有 任公司、山西证券股份有股公司、申银习国证券股份有股公司、决证券股份有限公司、共产证券股份有限公司,与国国 际金融有限公司、中国中枢证券有限责任公司、中信建校证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限 公司、国金证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司。金元证券股份有股公司、东海证券有限责任公司、东吴证券 股份有限公司、齐备证券有限责任公司,中国银河证券股份有限公司。是证券股份有股公司、东海证券有限责任公司、东吴证券 股份有限公司、青备证券有限责任公司,中国国际证券有限责任公司、民生证券股份有限公司、工事证券股份有限公司、 东方证券股份有限公司、国联证券股份有限公司的交易单元作为本基金交易单元。

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

					亚侧甲亚:人民用刀		
	债券	交易	债券回购	咬易	权证交易		
券商名称	成交金額	占当期债券 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	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例	
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
申银万国证券 股份有限公司	116,871,176.40	33.19%	798,000,000.00	39.94%	-	-	
中信证券股份 有限公司	35,114,196.60	9.97%	310,000,000.00	15.52%	-	-	
安信证券股份 有限公司	41,907,089.70	11.90%	-	-	-	-	
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
国金证券股份 有限公司	49,435,740.60	14.04%	-	-	-	-	
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
海通证券股份 有限公司	85,839,222.40	24.38%	340,000,000.00	17.02%	-	-	
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
银河证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-	
民生证券股份 有限公司	22,952,407.00	6.52%	270,000,000.00	13.51%	-	-	
中银国际证券 有限责任公司	-	-	280,000,000.00	14.01%	-	-	
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-	
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
山西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
齐鲁证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
国联证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	
东海证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	

民生加银基金管理有限公司

金额单位:人民币元