诺安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

基金管理人:诺安基金管理有限公司
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27日

§1 重要提示

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23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	诺安灵活配置混合
基金主代码	320006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月20日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
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	3,337,451,451.05份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	积极调整,稳健投资,力图在将风险控制在一定水平的基础上获得超过比较基准的投资收益。
投资策略	本基金实施积极主动的投资策略,具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略和权证投资策略四部分组成。 (1)在资产配置方面,本基金自上而下进行,具体由类别资产配置和行业资产配置组成。 (2)在股票投资方面,本基金综合运用优势企业增长策略、内在价值低估策略、景气回归上升策略这三种策略构建股票组合。 (3)在债券投资方面,本基金将实施利率预测策略、收益率曲线模拟、收益率溢价策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。 (4)在权证投资方面,本基金主要运用的策略包括:价值发现策略、价差策略、对敲策略、卖出有担保的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等,作为辅助性投资工具,本基金会结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	较高风险,较高收益。

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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798

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	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§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	122,681,601.74
本期利润	-43,040,488.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0098
本期基金份额净值增长率	-2.59%
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	-0.0597
期末基金资产净值	3,138,307,575.81
期末基金份额净值	0.940

注:①上述基金业绩指标不包括持有人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期末可供分配利润是采用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。

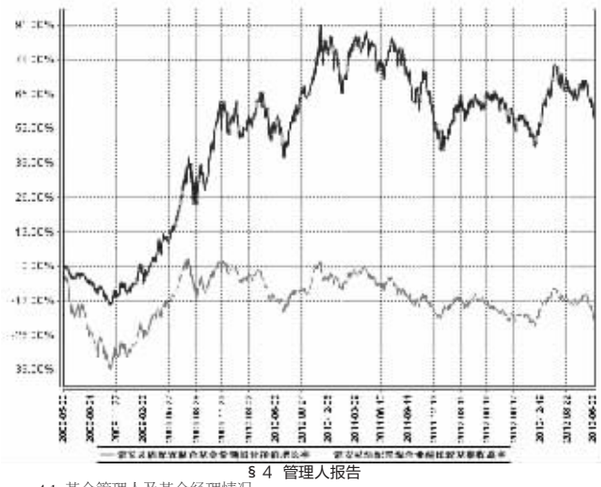
3.2 基金净值表现

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	-7.21%	0.90%	-9.44%	1.12%	2.23%	-0.22%
过去三个月	-6.00%	0.80%	-6.81%	0.87%	0.81%	-0.07%
过去六个月	-2.59%	0.89%	-6.96%	0.90%	4.37%	-0.01%
过去一年	-4.28%	0.81%	-4.77%	0.82%	0.49%	-0.01%
过去三年	7.98%	0.97%	-3.65%	0.82%	11.63%	0.15%
自基金合同生效起至今	57.10%	1.04%	-19.38%	1.10%	76.48%	-0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×上证国债指数。

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



§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

截至2013年8月27日,本基金管理人共管理二十八只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金。

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		
夏俊杰	诺安灵活配置混合型证券投资基金基金经理,诺安平衡证券投资基金基金经理,诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理	2010年3月12日	-	7	硕士,具有基金从业资格。曾任嘉实基金行业研究员;2008年9月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、机构理财部投资经理,2010年3月起任诺安灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2011年4月起任诺安平衡证券投资基金基金经理,2012年11月起任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期为公司作出决定并对外公告之日;

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》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安灵活配置混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令, 交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据 "时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司对不同投资组合不同时间区间 (日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行了分析,未发现投资组合之间存在违反公平交易原则的异常情况。此外,不存在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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

经济缓慢下行,流动性尚可,市场在这样的背景下将结构行情演绎至极致,以创业板为代表的 "新兴产业"大幅上涨,而传统行业不断创出新低,尽管这种结构严重分化的走势在2010年表现过,但这次应该是有过之而无不及,本基金在中小市值股票的配置上严重不足,致使上半年业绩表现落后同业,之所以一直不看好创业板,主要是担心经济下行后中小公司业绩风险更大, 同时股东的大量减持使得未来业绩的可持续性不容乐观,但就像2000年的网络科技股革命一样, 尽管今天我们已经记不得当时炒作的股票有什么,但这10多年来确实涌现了腾讯、阿里、百度等几个互联网巨头,因此,加大个股研究力度,找出未来的新蓝筹应是未来研究和投资的重点,这也是本基金在投资策略上未来需要改进的地方。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.940元。本报告期基金份额净值增长率为-2.59%,同期业绩比较基准收益率为-6.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年的6月是不平凡的一个月,或许有望成为中国经济划时代的一个转折点,它不仅仅让中国的银行体系遭遇了史无前例的 "钱荒风波",甚至也很有可能成为新一届政府货币政策彻底转向的开端。上半年的经济数据是促成这一政策转向的重要推力,应该说,前5月是过去几年政策的延续,无论是M2还是融资总量数据都延续了快速增长的态势,远远超出政府年初目标,然而与此相对应的是经济增长依然乏力,资金继续流向房地产和地方融资平台,结构转型显然无望,继续采取拖延战术的后果不言而喻,所以,当我们理解了这件事的必然性之后,我们自然就不能再低估政府彻底改革的勇气和决心了,当然, "紧缩时代"的到来也许不会一蹴而就,政府力度也会相机调整,但方向是确定的,而随着大的 "货币紧缩时代"的到来, "金融去杠杆"也将成为必然,尽管我们对中国经济未来的长期增长前景充满信心,但我们也必须重视改革所付出的即期的代价,任何一个国家的去杠杆过程都将是异常艰辛和痛苦的,金融市场作为一个放大器,必然也会做出相应的反应。在此,我们要强调,尽管这一情景的发生不一定是大概率事件,但作为投资者,特别是一名典型的风险厌恶者,在面对可能发生的系统风险时,追求 "本金安全"将是第一要务。总之,本基金仍会继续坚守 "谨慎勤勉"的原则, "优化结构", "精选个股",力争创造更好的投资业绩,最后感谢各位持有人对本基金的信任!

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定,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六次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%, 基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。

本报告期内,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

本报告期内, 本基金托管人在对诺安灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,诺安灵活配置混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安灵活配置混合型证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	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	350,768,044.63	275,661,591.28
结算备付金	60,828,876.49	59,063,824.64
存出保证金	2,082,153.06	1,389,650.80
交易性金融资产	1,492,325,563.74	3,620,390,602.56
其中:股票投资	1,461,190,757.34	3,508,644,492.16
基金投资	-	-
债券投资	31,134,806.40	111,746,110.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,206,540,349.91	593,500,000.00
应收证券清算款	33,858,007.47	66,776,035.52
应收利息	1,154,435.45	476,784.77
应收股利	1,016,227.11	-
应收申购款	954,995.69	1,923,813.96
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,149,528,653.55	4,619,182,303.53
负债和所有者权益	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	-	-
应付赎回款	3,396,940.07	2,841,754.29
应付管理人报酬	4,297,950.59	5,704,513.41
应付托管费	716,325.10	950,752.25
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,599,912.33	1,782,744.56
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	209,949.65	1,459,938.17
负债合计	11,221,077.74	12,739,702.68
所有者权益:		
实收基金	3,337,451,451.05	4,771,557,017.90
未分配利润	-199,143,875.24	-165,114,417.05
所有者权益合计	3,138,307,575.81	4,606,442,600.85
负债和所有者权益总计	3,149,528,653.55	4,619,182,303.53

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.940元,基金份额总额3,337,451,451.05份。

6.2 利润表

会计主体:诺安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

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
一.收入	8,607,640.66	380,503,291.06
1.利息收入	16,705,816.69	8,660,996.13
其中:存款利息收入	2,952,123.47	3,545,589.58
债券利息收入	300,777.10	64,716.25
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,452,916.12	5,050,690.30
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	155,465,496.50	-123,382,713.83
其中:股票投资收益	124,706,647.55	-147,565,616.36
基金投资收益	-	-
债券投资收益	11,755,251.63	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	19,003,597.32	24,182,902.53
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-165,722,090.29	494,693,310.10
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,158,417.76	531,698.66
减:二.费用	51,648,129.21	40,250,934.74
1.管理人报酬	32,689,809.98	29,580,944.07
2.托管费	5,448,301.62	4,930,157.38
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	13,299,489.88	5,530,812.31
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	210,527.73	209,020.98
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-43,040,488.55	340,252,356.32
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	-43,040,488.55	340,252,356.32

6.3 所有者权益 (基金净值)变动表

会计主体:诺安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

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(基金净值)	4,771,557,017.90	-165,114,417.05	4,606,442,600.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-43,040,488.55	-43,040,488.55
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)	-1,434,105,566.85	9,011,030.36	-1,425,094,536.49
其中:1.基金申购款	959,832,982.63	11,395,232.69	971,228,215.32
2.基金赎回款	-2,393,938,549.48	-2,384,202.33	-2,396,322,751.81
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)	3,337,451,451.05	-199,143,875.24	3,138,307,575.81
项目	上年度可比期间 2012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)	3,994,746,813.32	-397,312,362.00	3,597,434,451.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	340,252,356.32	340,252,356.32
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)	460,553,369.12	-22,315,318.06	438,238,051.06
其中:1.基金申购款	937,557,061.26	-48,657,130.58	888,899,930.68
2.基金赎回款	-477,003,692.14	26,341,812.52	-450,661,879.62
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)	4,455,300,182.44	-79,375,323.74	4,375,924,858.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

奥成文 薛有为 薛有为

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本基金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一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记机构、销售机构
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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	32,689,809.98	29,580,944.07
其中:支付销售机构的客户维护费	2,722,115.66	1,916,797.53

注:①基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

②基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.4.2.2 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	5,448,301.62	4,930,157.38

注:①基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:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

②基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购)交易

本基金本报告期及其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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

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
基金合同生效日(2008年5月20日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	105,725,991.19	105,725,991.19
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	105,725,991.19	105,725,991.19
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.17%	2.37%

注:基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.4.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度可比期间 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳市捷隆投资有限公司	16,611,295.68	0.50%	16,611,295.68	0.35%

注:投资本基金费率按照本基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.4.5 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
中国工商银行股份有限公司	350,768,044.63	2,445,559.47	214,039,454.30	3,293,679.56

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.5 期末 (2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末不存在因认购新发或增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 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
600688	S上石化	2013年6月28日	股权分置改革	8.19	-	-	2,816,404	15,521,689.07	23,066,348.76	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止, 本基金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为0.00元,无债券作为质押。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0.00元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证监会公告 [2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》有关规定,本基金自2008年9月16日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对本基金持有的长期停牌股票进行估值。

本基金所持有的股票石基信息 (002153)自2013年3月1日起,采用指数收益法进行估值,对本基金当日净利润和资产净值的影响为增加人民币11,611,056.97元。根据石基信息复牌后的市场表现及基金的实际情况, 经与基金托管人协商一致,于2013年4月3日起对该股票恢复采用市价估值方法进行估值。

§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	1,461,190,757.34	46.39
	其中:股票	1,461,190,757.34	46.39
2	固定收益投资	31,134,806.40	0.99
	其中:债券	31,134,806.40	0.99
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,206,540,349.91	38.31
	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	411,596,921.12	13.07
6	其他各项资产	39,065,818.78	1.24
7	合计	3,149,528,653.55	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	520,257,861.04	16.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	269,734,271.59	8.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	91,008,543.84	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	18,370,357.51	0.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	243,056,642.10	7.74
J	金融业	281,920,768.92	8.98
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	26,204,810.64	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,637,501.70	0.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,461,190,757.34	46.56

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	601318	中国平安	5,819,067	202,270,768.92	6.45
2	600011	华能国际	23,841,727	127,314,822.18	4.06
3	600570	恒生电子	10,000,000	125,000,000.00	3.98
4	600104	上汽集团	7,223,106	95,417,230.26	3.04
5	601601	中国太保	5,000,000	79,650,000.00	2.54
6	600887	伊利股份	2,450,308	76,645,634.24	2.44
7	600021	上海电力	18,563,923	76,483,362.76	2.44
8	002153	石基信息	3,755,491	75,184,929.82	2.40
9	600511	国药股份	5,000,000	71,700,000.00	2.28
10	000895	双汇发展	1,836,431	70,592,407.64	2.25

提示: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.lionfund.com.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	601318	中国平安	363,433,799.02	7.89
2	601288	农业银行	188,035,223.69	4.08
3	601601	中国太保	180,706,327.54	3.92
4	600016	民生银行	133,865,106.12	2.91
5	600547	山东黄金	116,617,371.43	2.53
6	600585	海螺水泥	111,315,457.06	2.42
7	600497	驰宏锌锗	91,184,255.52	1.98
8	000002	万 科A	81,070,445.59	1.76
9	002092	中泰化学	76,785,541.72	1.67
10	000060	中金岭南	68,388,965.95	1.48
11	000983	西山煤电	67,038,515.64	1.46
12	600383	金地集团	56,228,588.64	1.22
13	600030	中信证券	56,011,259.72	1.22
14	000401	冀东水泥	55,042,520.73	1.19
15	000012	南 玻A	54,406,798.95	1.18
16	600739	辽宁成大	49,838,785.94	1.08
17	601939	建设银行	47,079,556.32	1.02
18	000157	中联重科	47,028,997.34	1.02
19	601336	新华保险	46,531,170.95	1.01
20	600153	建发股份	46,291,365.08	1.00

注:本报告期累计买入金额按买卖成交金额,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

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	000623	吉林敖东	223,617,954.03	4.85
2	601288	农业银行	179,373,823.55	3.89
3	000423	东阿阿胶	170,071,000.80	3.69
4	600383	金地集团	155,786,044.23	3.38
5	600795	国电电力	147,403,871.65	3.20
6	600030	中信证券	146,019,334.55	3.17
7	600016	民生银行	129,143,804.59	2.80
8	600028	中国石化	125,775,713.66	2.73
9	002022	科华生物	121,486,679.28	2.64
10	600027	华电国际	120,470,989.68	2.