益民创新优势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:益民基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2013年8月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

本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。

本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。

本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	益民创新优势混合
基金主代码	560003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年7月11日
基金管理人	益民基金管理有限公司
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	4,193,271,315.66份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的优势企业和潜在优势企业,为基金份额持有人实现较高风险水平下的较高收益。
投资策略	本基金着眼于全球视野,遵循从全球到国内的分析思路,从对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点,再结合国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析,从而判别国内各行业产业链传导的内在机制,并从中找出能够分享全球经济增长的创新行业或主题。本基金对于企业创新特性的定义将主要包括四大方面:技术创新、产品及服务创新、制度创新和商业模式创新。本基金将以寻求创新溢价为目标,来综合构建基金组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金产品定位于偏股型的混合型基金。风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

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		益民基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘伟	李芳菲
	联系电话	010-63105556	010-66060069
	电子邮箱	jcb@ymfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-650-8808	95599
传真		010-63100588	010-63201816

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.ymfund.com
基金半年度报告备置地点	北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼南翼13A

§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	470,400,028.53
本期利润	381,567,595.62
加权平均基金份额本期利润	0.0890
本期基金份额净值增长率	13.05%
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	-0.2512
期末基金资产净值	3,204,380,412.08
期末基金份额净值	0.7642

注: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。

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。

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)。

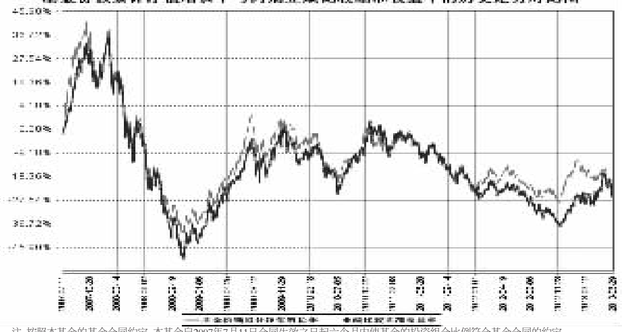
3.2 基金净值表现

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	-4.31%	1.97%	-11.78%	1.40%	7.47%	0.57%
过去三个月	5.64%	1.61%	-8.64%	1.09%	14.28%	0.52%
过去六个月	13.05%	1.50%	-9.04%	1.12%	22.09%	0.38%
过去一年	3.05%	1.28%	-6.69%	1.02%	9.74%	0.26%
过去三年	0.35%	1.18%	-6.89%	1.03%	7.24%	0.15%
自基金合同生效起至今	-22.40%	1.56%	-25.51%	1.40%	3.11%	0.16%

注:自2009年5月1日起益民创新优势混合型证券投资基金的业绩比较基准,由原来的"沪深300指数收益率×75%+新华巴克莱指数收益率×25%"变更为"沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%"。

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:按照本基金的基金合同约定,本基金自2007年7月11日合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准,于2005年12月12日正式成立。公司股东由重庆国际信托有限公司(出资比例49%)、中国新纪元有限公司(出资比例31%)、中山证券有限责任公司(出资比例20%)组成,注册资本为1亿元人民币,注册地:重庆,主要办公地点:北京。截止2013年6月末,公司管理的基金共有五只,均为开放式基金。其中,益民货币市场基金于2006年7月17日成立;益民红利成长混合型证券投资基金于2006年11月21日成立;益民创新优势混合型证券投资基金于2007年7月11日成立;益民多利债券型投资基金于2008年5月21日成立;益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金于2012年8月16日成立。

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		
李勇钢	益民货币市场基金基金经理、益民创新优势混合型证券投资基金基金经理、益民多利债券型证券投资基金基金经理	2011年9月26日	-	5	清华大学硕士。曾任中再资产管理股份有限公司研究员、投资经理。自2011年8月31日起任益民货币市场基金基金经理、益民多利债券型证券投资基金基金经理;自2011年9月26日起任益民创新优势混合型证券投资基金基金经理。
韩宁	益民创新优势混合型证券投资基金基金经理	2012年3月21日		12	中国有色金属材料总公司业务经理、闽发证券有限责任公司高级研究员、新时代证券有限责任公司高级研究员。自2005年加入益民基金管理有限公司,曾先后担任行业研究员、研究部副总经理。自2012年3月21日起任益民创新优势混合型证券投资基金基金经理。

注:此处的"任职日期"为基金合同生效日或根据公司决定确定的聘任日期,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券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

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关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 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,不存在直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

本报告期内,各投资组合1日、3日、5日同向交易价差大部分通过统计检验,不存在价差显著的情况。但因投资组合规模悬殊、投资组合经理对市场判断的差异及决策时机不同,导致投资组合间五组配对分析出现1日、3日、5日同向交易价差检验显著的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为,不同投资组合之间不存在交易所公开竞价同日反向交易,不存在报告期内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%的情形。

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

本基金在2013年初认为:"经济复苏进程并非坦途,政策放松力度有待观察,市场可能存在震荡和反复,以防御性和主题性机会为主,局部时点风险应密切关注。"2013年上半年,市场总体呈现M型走势,除了年初至春节以及5月份的反弹行情,市场基本处于下行调整态势,上证综指在6月的钱荒中创了1849的近年来新低点位;尽管大盘走势低迷,但市场仍然体现出了非常明显的结构、风格的分化特征,以创业板为代表的新兴成长股涨幅超过40%。

本基金年初至今较好地把握了行情波动的脉络,年初以权重股和成长股的均衡配置为主,一季度末大幅减持了银行、券商、建材等强周期行业,增持了传媒、电子元器件、计算机、环保、智慧城市等行业或个股。仓位方面,从年初到六月上旬,本基金的仓位一直稳定在80%左右,在新低之后的反弹过程中逐步降至60%附近。总的来看,截至六月末,本基金个股围绕中报业绩而精选了一批股票,从行业来看,传统的周期性行业相对较少;创业板、电子、传媒行业超配,但这些板块的配置比例从年初至今变化不大,多数个股都是从年初持有至今,不存在追涨追高的情况。

今年的资金状况和2010年比较相似:即趋势收紧,但存量资金相对宽裕,在此种情况下,大股票涨不动,小股票时常有热点出现,因此成长股将是今年投资的主战场。至于风格转换问题,我们认为大可不必过虑,大的风格转换需要催化剂,不会仅仅因为小股票涨多了,大股票跌多了就风格转换了。这种催化剂有可能是经济回暖和经济政策的变化,在看到变化之前,本基金不会去赌风格转换。同时我们也应该注意到,投资者在二季度创业板指数相对较低的情况下对其质疑却颇多,泡沫破碎的观点不绝于耳,但七月以来,市场对创业板的追捧已经到了近乎狂热的程度,投资者似乎在短短数周之内消弭了对创业板的分歧,纷纷唱多中小市值股票,而创业板的估值似乎已经没有了极限,本基金对此比较担忧,并在七月中旬大幅减持了创业板个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期末,本基金份额净值为0.7642元,本报告期份额净值增长率为13.05%,同期业绩比较基准收益率为-9.04%。

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,本基金认为,在"去产能、去杠杆"背景下经济将依然弱势,企业总体盈利难有实质改善,资金面边际上有所缓解但难以回到上半年的宽松局面,IPO重启预期尚未兑现,上述因素将制约股票市场的表现,下半年尤其是三季度末四季度初存在着较大的下行风险,因此本基金在下半年的主要操作思路是保持低仓位,充分做好防御。保留的部分仓位将围绕中报业绩精选个股、去伪存真,为组合表现寻找可靠的基本面支撑和安全垫。从行业配置上来看,周期股没有大机会,主要的操作思路还是在绩优成长股估值回调到一个合理的水平时增持成长股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述:

根据相关规定,本基金管理人成立估值委员会,估值委员会是基金估值的最高决策机构,负责公司估值相关决策及执行。成员由公司总经理、投资总监、运作保障部、金融工程部、监察稽核部、基金会计等相关人员组成。相关参与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验,熟悉相关法规和估值方法。

研究部行业研究员:研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究,参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定,并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责;相关参与人员应当具有多年的行业研究经验,能够较好的对行业发展趋势做出判断,熟悉相关法规和估值方法。

监察稽核部:监察稽核部参与估值流程的人员,应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督,发现问题及时要求整改;参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验,应当具备熟知与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法的专业能力,并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

金融工程部金融工程人员:金融工程人员负责估值相关数值的处理和计算,并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验,具备基金绩效评估专业能力,并熟悉相关法规和估值方法。

运作保障部基金会计:基金会计在估值流程中的相关工作职责是按照基金会计核算准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金拥有的各类有价证券、其他资产和负债进行核算,进而确定基金资产的公允价值。参与基金长期停牌股票估值方法的确定,复核由估值委员会提供的估值价格,并与相关托管行进行核对确认。如有不符合的情况出现,立即向估值委员会反映情况,并提出合理的调整建议。基金会计人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通,获悉的与基金估值相关的重大信息及时向公司及估值小组反馈。基金会计应当具备多年基金从业经验,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,具备熟悉及了解基金估值法规、政策和方法的专业能力。

2、基金经理参与或决定估值的程度:

基金管理公司估值委员会成员中不包括基金经理。基金经理不参与估值工作决策和执行的过程。

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担;

4、本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

5、在符合有关基金分红条件的情况下,基金收益分配每季度不超过三次,每年不超过十二次。基金合同生效不满三个月,收益可不分配。每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

在托管益民创新优势混合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《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》、《益民创新优势混合型证券投资基金托管协议》的约定,对益民创新优势混合型证券投资基金管理人—益民基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30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份额持有人利益的行为。

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,益民基金管理有限公司在益民创新优势混合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

本托管人认为,益民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益民创新优势混合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8月23日

§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:益民创新优势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	1,994,720.23	40,668,044.30
结算备付金	32,805,569.14	111,136,143.80
存出保证金	2,846,068.51	3,801,852.23
交易性金融资产	2,322,472,298.12	2,744,041,862.23
其中:股票投资	1,953,605,865.62	2,402,519,443.53
基金投资	-	-
债券投资	368,866,432.50	341,522,418.70
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	858,900,000.00	105,000,330.00
应收证券清算款	81,932,206.17	-
应收利息	4,909,782.10	4,881,471.14
应收股利	-	-
应收申购款	10,679.61	16,469.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	100,822.86	-
资产总计	3,305,972,146.74	3,009,546,173.41
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	82,145,429.97	35,054,682.25
应付赎回款	547,530.33	884,644.72
应付管理人报酬	4,009,209.05	3,550,258.76
应付托管费	668,201.51	591,709.80
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,892,761.15	9,647,771.78
应交税费	1,788,794.40	1,525,354.40
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	539,808.25	3,580,006.99
负债合计	101,591,734.66	54,834,428.70
所有者权益:		
实收基金	4,193,271,315.66	4,371,104,890.60
未分配利润	-988,890,903.58	-1,416,393,145.89
所有者权益合计	3,204,380,412.08	2,954,711,744.71
负债和所有者权益总计	3,305,972,146.74	3,009,546,173.41

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.7642元,基金份额总额4,193,271,315.66份。

6.2 利润表

会计主体:益民创新优势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	442,740,893.33	-10,339,624.49
1.利息收入	8,289,810.55	9,609,084.80
其中:存款利息收入	448,023.84	1,240,373.67
债券利息收入	4,813,387.29	6,323,039.77
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,028,399.42	2,045,671.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	523,280,441.52	-119,048,073.08
其中:股票投资收益	509,072,776.99	-140,174,689.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	142,713.36	3,109,330.73
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	14,064,951.17	18,017,286.12
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-88,832,432.91	99,076,045.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	3,074.17	23,318.26
减:二、费用	61,173,297.71	54,774,797.64
1.管理人报酬	23,376,413.99	25,552,136.57
2.托管费	3,896,068.96	4,258,689.40
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	33,740,295.51	24,797,330.00
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	160,519.25	166,641.67
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	381,567,595.62	-65,114,422.13
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	381,567,595.62	-65,114,422.13

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:益民创新优势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)	4,371,104,890.60	-1,416,393,145.89	2,954,711,744.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	381,567,595.62	381,567,595.62
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)	-177,833,574.94	45,934,646.69	-131,898,928.25
其中:1.基金申购款	3,150,186.32	-843,873.19	2,306,313.13
2.基金赎回款	-180,983,761.26	46,778,519.88	-134,205,241.38
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)	4,193,271,315.66	-988,890,903.58	3,204,380,412.08
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)	4,575,288,483.10	-1,115,046,508.97	3,460,241,974.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-65,114,422.13	-65,114,422.13
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)	-102,860,733.89	24,700,003.41	-78,160,730.48
其中:1.基金申购款	4,163,262.46	-996,509.41	3,166,753.05
2.基金赎回款	-107,023,996.35	25,696,512.82	-81,327,483.53
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)	4,472,427,749.21	-1,155,460,927.69	3,316,966,821.52

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:

雷学军　　吴晓明　　吴晓明

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 基金基本情况

益民创新优势混合型证券投资基金(以下简称"本基金")为经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2007]157号《关于同意益民创新优势混合型证券投资基金募集的批复》及基金部函[2007]155号《关于益民创新优势混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》核准后进行募集,由益民基金管理有限公司负责基金发起并担任基金管理人,中国农业银行股份有限公司担任基金托管人。

本基金自2007年6月18日至2007年7月8日止向境内个人投资者和机构投资者及合格境外机构投资者公开募集,募集期结束后经信永中和会计师事务所有限责任公司以XYZH/2006A10059-1号验资报告验证,并报中国证监会备案,中国证监会于2007年7月11日以基金部函[2007]184号《关于益民创新优势混合型证券投资基金备案确认的函》书面确认。经验资及备案后,本基金合同于2007年7月11日生效。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。

本基金设立时募集的实收基金本金为人民币7,231,963,653.33元,募集期间产生的利息6,159,321.48元,实收基金本息共计7,238,122,974.81元,上述募集的实收基金根据每份基金份额的面值人民币1.00元折合为7,238,122,974.81份基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券监督管理委员会发布《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>》的公告和中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合《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动情况等有关信息。

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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错更正事项。

6.4.6 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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85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问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金享有的税收优惠及主要税项列示如下:

1、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征收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。

4、对基金取得股票的股息、红利收入,根据财政部、国税总局、证监会发布之《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,从2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

5、基金买卖股票出让方按照0.10%缴纳印花税,受让方不缴纳印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内无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	与本基金的关系
益民基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记人、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
中山证券有限责任公司	基金管理人的股东、本基金的代销机构、本基金交易单元出租人
西南证券股份有限公司	基金管理人控股股东持股的公司、本基金的代销机构、本基金交易单元出租人
重庆国际信托有限公司工会委员会	基金管理人控股股东的工会组织,本基金的基金份额持有人
重庆国际信托有限公司	基金管理人控股股东
中国新纪元有限公司	基金管理人的股东

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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位: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	
	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
西南证券股份有限公司	64,047,187.09	0.29%	531,192,684.22	3.26%
中山证券有限责任公司	589,564,990.16	2.69%	-	-

6.4.8.1.2债券交易

金额单位: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	
	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
西南证券股份有限公司	-	-	83,169,149.20	54.91%

6.4.8.1.3债券回购交易

金额单位: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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
西南证券股份有限公司	40,000,000.00	0.33%	869,200,000.00	12.11%
中山证券有限责任公司	938,500,000.00	7.65%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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
西南证券股份有限公司	58,308.32	0.29%	-	-
中山证券有限责任公司	536,735.83	2.71%	255,015.86	2.14%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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
西南证券股份有限公司	451,512.55	3.30%	195,975.47	3.08%
中山证券有限责任公司	-	-	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买/卖经手费、证券结算风险基金和证券交易所买/卖证管费等)。

关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准,与其签订的交易单元租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	23,376,413.99	25,552,136.57
其中:支付销售机构的客户维护费	4,223,870.09	4,612,194.34

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%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 为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资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。

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	3,896,068.96	4,258,689.40

注: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

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三个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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均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

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(2007年7月11日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,426,308.25	8,426,308.25
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	8,426,308.25	8,426,308.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%	0.19%

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 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
重庆国际信托有限公司工会委员会	281,718.20	0.01%	281,718.20	0.01%

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
中国农业银行股份有限公司	1,994,720.23	140,201.59	115,635,315.91	1,096,225.49

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。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
600284	浦东建设	2013年6月24日	重大资产重组	9.50	-	-	6,072,447	62,335,097.82	57,688,246.50	-
300020	银江股份	2013年6月3日	重大资产重组	22.67	-	-	91,028	1,990,917.23	2,063,604.76	-

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

§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	1,953,605,865.62	59.09
	其中:股票	1,953,605,865.62	59.09
2	固定收益投资	368,866,432.50	11.16
	其中:债券	368,866,432.50	11.16
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	858,900,000.00	25.98
	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	34,800,289.37	1.05
6	其他各项资产	89,799,559.25	2.72
7	合计	3,305,972,146.74	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	-	-
B	采矿业	7,868,942.28	0.25
C	制造业	914,571,185.61	28.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	119,762,145.16	3.74
F	批发和零售业	37,908,654.96	1.18
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	601,618,792.17	18.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,402,000.00	0.04
L	租赁和商务服务业	165,730,586.84	5.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	53,882,400.00	1.68
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	49,617,158.60	1.55
S	综合	1,244,000.00	0.04
	合计	1,953,605,865.62	60.97

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	300088	长信科技	6,499,937	137,083,671.33	4.28
2	002241	歌尔声学	2,940,000	106,692,600.00	3.33
3	300058	蓝色光标	2,490,986	103,874,116.20	3.24
4	002421	达实智能	5,506,799	91,633,135.36	2.86
5	600637	百视通	3,061,000	85,708,000.00	2.67
6	600887	伊利股份	2,732,568	85,474,727.04	2.67
7	300273	和佳股份	3,611,036	77,348,391.12	2.41
8	300074	华平股份	4,200,000	76,020,000.00	2.37
9	000661	长春高新	750,000	73,432,500.00	2.29
10	300300	汉鼎股份	5,006,208	70,587,532.80	2.20

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人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	600016	民生银行	316,899,768.17	10.73
2	002241	歌尔声学	284,985,546.44	9.65
3	600383	金地集团	248,962,254.83	8.43
4	000001	平安银行	218,637,164.87	7.40
5	600765	中航重机	201,724,916.43	6.83
6	000024	招商地产	171,161,791.59	5.79
7	600637	百视通	160,367,503.17	5.43
8	600804	鹏博士	157,214,020.22	5.32
9	601166	兴业银行	153,474,127.49	5.19
10	000002	万 科A	152,806,137.35	5.17
11	000625	长安汽车	145,963,533.56	4.94
12	300251	光线传媒	136,033,116.51	4.60
13	002554	惠博普	133,412,919.83	4.52
14	300058	蓝色光标	132,581,798.10	4.49
15	600048	保利地产	131,550,836.73	4.45
16	600880	博瑞传播	130,110,818.72	4.40
17	300024	机器人	128,993,451.35	4.37
18	300088	长信科技	128,470,154.38	4.35
19	300070	碧水源	123,893,939.56	4.19
20	002421	达实智能	121,617,670.86	4.12
21	600585	海螺水泥	121,597,747.91	4.12
22	002273	水晶光电	119,698,367.86	4.05
23	300074	华平股份	117,526,162.56	3.98
24	600000	浦发银行	113,300,410.58	3.83
25	000009	中国宝安	112,957,730.30	3.82
26	600837	海通证券	112,100,202.15	3.79
27	300270	中威电子	106,343,278.76	3.60
28	600030	中信证券	104,923,043.81	3.55
29	601117	中国化学	104,545,261.11	3.54
30	600887	伊利股份	97,222,573.87	3.29
31	300182	捷成股份	96,975,466.19	3.28
32	600596	新安股份	95,281,910.11	3.22
33	600795	国电电力	94,692,582.12	3.20
34	000831	五矿稀土	93,793,159.53	3.17
35	601901	方正证券	92,343,901.44	3.13
36	600332	广州药业	92,308,589.82	3.12
37	300071	华谊嘉信	91,258,908.42	3.09
38	600519	贵州茅台	90,899,030.43	3.08
39	002148	北纬通信	89,958,077.68	3.04
40	600104	上汽集团	88,845,727.12	3.01
41	601928	凤凰传媒	87,936,318.86	2.98
42	601377	兴业证券	87,724,671.11	2.97
43	000792	盐湖股份	87,563,800.21	2.96
44	002456	欧菲光	87,020,168.18	2.95
45	002185	华天科技	85,599,920.81	2.90
46	002005	德豪润达	85,234,016.41	2.88
47	002236	大华股份	84,778,659.82	2.87
48	000661	长春高新	81,504,357.13	2.76
49	600089	特变电工	79,309,517.91	2.68
50	600366	宁波韵升	79,116,436.31	2.68
51	600372	中航电子	78,417,124.29	2.65
52	300315	掌趣科技	77,630,067.40	2.63
53	600284	浦东建设	77,503,276.53	2.62
54	000423	东阿阿胶	77,381,067.20	2.62
55	600990	四创电子	77,371,500.29	2.62
56	000100	TCL 集团	76,592,366.45	2.59
57	002249	大洋电机	75,729,581.94	2.56
58	300300	汉鼎股份	74,740,508.84	2.53
59	300273	和佳股份	73,865,372.10	2.50
60	002091	江苏国泰	72,110,000.46	2.44
61	601238	广汽集团	70,839,969.55	2.40
62	000868	安凯客车	68,180,794.44	2.31
63	600893	航空动力	68,051,402.74	2.30
64	600699	均胜电子	66,855,374.35	2.26
65	600011	华能国际	66,564,974.38	2.25
66	002375	亚厦股份	65,846,897.44	2.23
67	600312	平高电气	65,353,603.43	2.21
68	002138	顺络电子	63,190,351.76	2.14
69	002013	中航精机	62,948,220.07	2.13
70	300212	易华录	61,329,436.62	2.08
71	600387	海越股份	59,542,698.74	2.02
72	300075	数字政通	59,111,027.98	2.00

注:"买入金额"按买入成交金额(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

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	000001	平安银行	320,885,451.67	10.86
2	600016	民生银行	296,937,932.80	10.05
3	000002	万 科A	264,431,244.50	8.95
4	002241	歌尔声学	231,854,842.35	7.85
5	600030	中信证券	223,930,875.72	7.58
6	600383	金地集团	219,982,660.74	7.45
7	600765	中航重机	215,844,535.96	7.31
8	601166	兴业银行	213,569,760.23	7.23
9	600585	海螺水泥	207,211,452.92	7.01
10	600837	海通证券	195,942,003.93	6.63
11	000625	长安汽车	163,994,590.76	5.55
12	300251	光线传媒	162,101,823.53	5.49
13	600880	博瑞传播	158,549,051.35	5.37
14	300058	蓝色光标	156,370,076.89	5.29
15	000024	招商地产	156,113,326.50	5.28
16	002273	水晶光电	142,232,394.13	4.81
17	600804	鹏博士	138,984,844.23	4.70
18	300024	机器人	132,947,635.10	4.50
19	600048	保利地产	130,579,534.29	4.42
20	300212	易华录	129,855,314.72	4.39
21	000831	五矿稀土	123,317,469.16	4.17
22	600036	招商银行	120,796,245.04	4.09
23	002554	惠博普	119,161,144.99	4.03
24	300270	中威电子	118,392,467.56	4.01
25	002185	华天科技	116,941,105.59	3.96
26	600000	浦发银行	115,675,834.53	3.91
27	600596	新安股份	113,503,725.94	3.84
28	000009	中国宝安	110,582,156.94	3.74
29	000157	中联重科	106,233,677.78	3.60
30	600637	百视通	106,002,100.53	3.59
31	601117	中国化学	103,069,384.26	3.49
32	601377	兴业证券	97,566,242.45	3.30
33	600372	中航电子	94,924,506.58	3.21
34	300070	碧水源	91,163,376.95	3.09
35	600079	人福医药	90,229,075.99	3.05
36	601901	方正证券	89,802,265.60	3.04
37	600795	国电电力	88,521,361.99	3.00
38	600519	贵州茅台	87,614,421.17	2.97
39	600418	江淮汽车	87,364,083.06	2.96
40	000792	盐湖股份	86,824,170.26	2.94
41	600893	航空动力	86,410,087.63	2.92
42	600990	四创电子	86,115,127.95	2.91
43	000069	华侨城A	84,835,237.39	2.87
44	002005	德豪润达	83,290,118.09	2.82
45	300315	掌趣科技	81,700,943.25	2.77
46	000661	长春高新	80,964,248.43	2.74
47	000776	广发证券	80,116,118.99	2.71
48	600031	三一重工	79,774,162.03	2.70
49	600376	首开股份	78,522,074.09	2.66
50	600104	上汽集团	77,624,976.23	2.63
51	600089	特变电工	77,351,538.78	2.62
52	300075	数字政通	73,698,487.39	2.49
53	000100	TCL 集团	71,409,974.30	2.42
54	002091	江苏国泰	70,151,486.36	2.37
55	000568	泸州老窖	68,384,803.97	2.31
56	600699	均胜电子	67,631,084.57	2.29
57	601628	中国人寿	67,030,586.35	2.27
58	002138	顺络电子	66,533,346.53	2.25
59	000423	东阿阿胶	66,112,888.05	2.24
60	600366	宁波韵升	65,758,262.57	2.23
61	600486	扬农化工	65,386,878.83	2.21
62	600011	华能国际	65,085,174.19	2.20
63	002008	大族激光	63,571,736.52	2.15
64	000868	安凯客车	62,782,621.93	2.12
65	601818	光大银行	60,780,000.00	2.06
66	601318	中国平安	59,657,558.42	2.02
67	002013	中航精机	59,220,890.62	2.00

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。7.4.3 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	10,505,398,152.89
卖出股票收入(成交)总额	11,384,246,384.86

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	193,122,200.00	6.03
	其中:政策性金融债	189,129,000.00	5.90
4	企业债券	35,719,200.00	1.11
5	企业短期融资券	21,057,100.00	0.66
6	中期票据	-	-
7	可转债	118,967,932.50	3.71
8	其他	-	-
9	合计	368,866,432.50	11.51

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	120245	12国开45	1,400,000	139,258,000.00	4.35
2	110022	同仁转债	917,750	118,967,932.50	3.71
3	110215	11国开15	300,000	29,985,000.00	0.94
4	068019	06京投债	300,000	29,448,000.00	0.92
5	130218	13国开18	200,000	19,886,000.00	0.62

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.10.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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	2,846,068.51
2	应收证券清算款	81,932,206.17
3	应收股利	-
4	应收利息	4,909,782.10
5	应收申购款	10,679.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	100,822.86
8	其他	-
9	合计	89,799,559.25

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	110022	同仁转债	118,967,932.50	3.71

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。

7.10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
182,654	22,957.46	87,062,117.81	2.08%	4,106,209,197.85	97.92%

8.2 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	368,681.06	0.01%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0;
2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年7月11日)基金份额总额	7,238,122,974.81
本报告期期初基金份额总额	4,371,104,890.60
本报告期基金总申购份额	3,150,186.32
减:本报告期基金总赎回份额	180,983,761.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,193,271,315.66

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有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

基金管理人及基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

根据益民基金管理有限公司第一届董事会第三十四次会议决议,自2013年1月1日起,为本基金进行审计的会计师事务所改聘为安永华明会计师事务所。

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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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

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	
中投证券	1	1,556,581,300.51	7.11%	1,408,259.65	7.11%	-
东方证券	1	1,271,206,707.14	5.81%	1,130,867.93	5.71%	-
华创证券	1	1,262,933,716.81	5.77%	1,143,445.33	5.77%	-
国联证券	1	1,223,989,094.66	5.59%	1,102,121.54	5.56%	-
中金公司	2	1,111,925,705.60	5.08%	1,010,093.79	5.10%	-
兴业证券	1	1,102,787,881.26	5.04%	997,376.97	5.03%	-
国都证券	1	1,040,518,663.75	4.75%	931,525.13	4.70%	-
渤海证券	1	1,012,888,627.78	4.63%	914,109.17	4.61%	-
东兴证券	1	997,509,404.95	4.56%	908,132.31	4.58%	-
申银万国	1	973,291,464.15	4.45%	886,083.62	4.47%	-
海通证券	1	873,996,020.89	3.99%	795,686.16	4.01%	-
山西证券	1	864,076,735.23	3.95%	774,288.18	3.91%	-
招商证券	1	827,077,825.61	3.78%	752,972.04	3.80%	-
国信证券	1	793,965,010.03	3.63%	722,826.49	3.65%	-
中信建投	2	781,000,201.83	3.57%	707,735.04	3.57%	-
国泰君安	1	748,104,914.03	3.42%	681,075.25	3.44%	-
齐鲁证券	1	685,313,795.72	3.13%	623,910.21	3.15%	-
西部证券	1	668,724,497.88	3.05%	608,802.61	3.07%	-
浙商证券	1	646,925,601.47	2.96%	588,961.54	2.97%	-
中山证券	1	589,564,990.16	2.69%	536,735.83	2.71%	-
中信证券	1	551,352,212.90	2.52%	501,948.43	2.53%	-
安信证券	1	506,084,235.42	2.31%	460,738.31	2.32%	-
民生证券	2	439,887,108.43	2.01%	400,473.97	2.02%	-
国金证券	1	376,203,303.24	1.72%	342,495.30	1.73%	-
金元证券	1	292,496,574.04	1.34%	266,286.72	1.34%	-
光大证券	1	243,695,354.63	1.11%	215,646.06	1.09%	-
银河证券	1	201,209,050.67	0.92%	183,180.17	0.92%	-
高华证券	1	182,287,351.87	0.83%	165,955.74	0.84%	-
西南证券	1	64,047,187.09	0.29%	58,308.32	0.29%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	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	债券交易		债券回购交易		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
中投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	150,000,000.00	1.22%	-	-
兴业证券	9,687,440.00	1.96%	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	408,300,000.00	3.33%	-	-
申银万国	87,730,318.50	17.76%	405,500,000.00	3.31%	-	-
海通证券	7,539,080.00	1.53%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	74,869,191.80	15.15%	749,000,000.00	6.11%	-	-
国信证券	17,679,790.50	3.58%	2,438,700,000.00	19.89%	-	-
中信建投	-	-	1,080,000,000.00	8.81%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	68,514,934.10	13.87%	1,179,400,000.00	9.62%	-	-
西部证券	1,596,133.70	0.32%	511,700,000.00	4.17%	-	-
浙商证券	103,477,075.40	20.94%	893,200,000.00	7.28%	-	-
中山证券	-	-	938,500,000.00	7.65%	-	-
中信证券	32,611,022.70	6.60%	74,700,000.00	0.61%	-	-
安信证券	26,822,312.10	5.43%	808,600,000.00	6.59%	-	-
民生证券	-	-	1,784,200,000.00	14.55%	-	-
国金证券	55,747,858.10	11.28%	218,300,000.00	1.78%	-	-
金元证券	7,818,856.72	1.58%	193,800,000.00	1.58%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	290,000,000.00	2.37%	-	-
高华证券	-	-	98,000,000.00	0.80%	-	-
西南证券	-	-	40,000,000.00	0.33%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

注:1、本公司租用券商交易单元的选择标准:

(1)基本情况:包括但不限于资本充足,财务状况及最近三年盈利情况良好;经营行为规范,最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机构的处罚;主要股东实力强大;具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合进行证券交易的需要,并能为投资组合提供全面的信息服务;

(2)公司治理:公司治理完善,股东会、董事会、监事会及管理层权责明确,内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足投资组合运作高度保密的要求;

(3)研究实力:有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员;研究覆盖面广,能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各方面领域,并能在符合相关法规及执业规范的前提下,根据公司的特定要求,提供专题研究报告;研究报告应分析严谨,观点独立、客观,并具备较强的风险意识和风险测算能力;

(4)服务能力:具备较强的服务意识,能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会;或者具备某一区域的调研服务能力的优势;

(5)综合业务能力:在投资银行业务上有较强的实力,能协助本公司投资组合参与股票、债券的发行;在新产品开发方面经验丰富,能帮助公司拓展资产管理业务(如QDII、专户等集合理财产品);在证券创新品种开发方面处于行业前列(如交易所固定收益平台、融资融券、金融期货等);

(6)其他因素(在某一具体方面的特别优势)。

2、本公司租用券商交易单元的程序:

(1)基金的交易单元选择,投资总监、研究部、金融工程部、投资部经集体讨论后遵照上述标准填写《券商选择标准评分表》,并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全。必要时可要求券商提供相应证明文件;

(2)投资总监向投资决策委员会上报拟选券商名单、相应的席位租用安排以及相关评选材料;

(3)投资决策委员会审查拟选券商名单及相应的席位租用安排,审查通过后由总经理上报董事会,董事会对公司管理层有相应授权的,由公司管理层依据授权内容办理;

(4)券商名单及相应的席位租用安排确定后,集中交易部参照公司《证券交易单元租用协议》及《综合服务协议》范本负责协调办理正式协议签署等相关事宜。若实际签署协议与协议范本不一致的,由集中交易部将实际签署协议提交监察稽核部进行合规性审核。

3、本报告期内基金新增租用国都证券、西部证券交易单元2个。

益民基金管理有限公司
2013年8月28日