中海蓝筹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:中海基金管理有限公司
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

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称"农业银行")根据本基金合同规定,于2013年8月26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	中海蓝筹混合
基金主代码	398031
交易代码	398031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月3日
基金管理人	中海基金管理有限公司
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	72,102,817.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过研究股票市场和债券市场的估值水平和价格波动,调整股票、固定收益资产的投资比例,优先投资于沪深300指数的成份股和备选成份股中权重较大、基本面较好、流动性较高、价值相对低估的上市公司以及收益率相对较高的固定收益类品种,适当配置部分具备核心优势和高成长性的中小企业,兼顾资本利得和当期利息收益,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	一级资产配置:根据股票和债券估值的相对吸引力模型(ASSVM,A Share Stocks Valuation Model),动态调整一级资产的权重配置。 股票投资:采取核心—卫星投资策略(Core-Satellite Strategy),核心组合以沪深300指数的成份股和备选成份股中权重较大、基本面较好、流动性较高的上市公司为标的,利用"中海综合估值模型",精选其中价值相对被低估的优质上市公司;卫星组合关注A股市场中具备核心优势和高成长性的中小企业,自下而上、精选个股,获取超越市场平均水平的收益。 债券投资:从宏观经济入手,采用自上而下的分析方式,把握市场利率水平的运行态势,根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期的选择。在久期确定的基础上,重点选择流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种,采取积极主动的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中债国债指数×40%
风险收益特征	本基金属混合型证券投资基金,为证券投资基金中的较高风险品种。 本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

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		中海基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	李芳菲
	联系电话	021–38429808	010–66060069
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400–888–9788、021–38789788	95599
传真		021–68419525	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.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号2905–2908室及30层

§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	14,508,767.61
本期利润	11,405,506.07
加权平均基金份额本期利润	0.1621
本期基金份额净值增长率	19.01%
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	0.0367
期末基金资产净值	74,752,432.57
期末基金份额净值	1.0367

注1:以上所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注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。

3.2 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

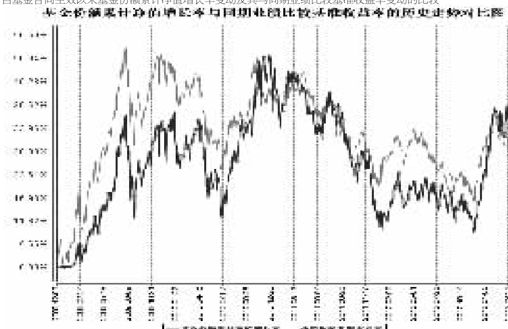
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去一个月	–6.13%	1.32%	–9.65%	1.15%	3.52%	0.17%
过去三个月	6.94%	1.27%	–6.71%	0.88%	13.65%	0.39%
过去六个月	19.01%	1.26%	–6.87%	0.91%	25.88%	0.35%
过去一年	23.52%	1.09%	–5.21%	0.82%	28.73%	0.27%
过去三年	26.75%	1.05%	–3.73%	0.82%	30.48%	0.23%
自基金合同生效日起至今	45.95%	1.10%	20.58%	0.96%	25.37%	0.14%

注1:"自基金合同生效起至今"指2008年12月3日(基金合同生效日)至2013年6月30日。

注2:本基金的业绩比较基准为沪深300指数×60%+中债国债指数×40%,我们选取市场认同度很高的沪深300指数、中债国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为30%~80%,在一般市场状况下,本基金股票投资比例会控制在60%左右,债券投资比例控制在40%左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重,以使业绩比较更加合理。

本基金业绩基准指数每日按照60%、40%的比例对基础指数进行再平衡,然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

基金管理人自2004年3月18日成立以来,始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行基金管理人的责任和义务,依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系,为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至2013年6月30日,共管理证券投资基金15只。

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		
王巍	本基金基金经理、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理	2012年7月11日	–	13	王巍先生,清华大学工商管理专业硕士。历任北方证券有限公司投资经理;Emperor Investment Management Ltd.(安铂瑞投资管理公司)研究员、组合经理;海通证券股份有限公司高级投资经理。2012年4月进入本公司工作,任职于投研中心。2012年7月至今任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2013年2月至今任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理。
陈忠	本基金基金经理	2013年3月12日	–	4	陈忠先生,北京大学分析化学专业博士。2008年7月进入本公司工作,历任中海基金管理有限公司助理分析师、分析师、高级分析师、高级分析师兼基金经理助理。2013年3月至今任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注2: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

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司依据2011年修订的《中海基金公平交易管理办法》,从投资决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估等方面对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投资决策内部控制方面:(1)公司研究平台共享,基金经理和专户投资经理通过研究平台平等获取研究信息。(2)公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,除分管投资副总及投资总监因工作管理的需要外,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

交易执行内部控制方面:(1)对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理根据研究报告独立确定申购价格和数量,在获配额度确定后,由交易部遵循公平原则对获配额度进行分配,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。(2)投资交易指令统一通过交易室下达,通过启用公平交易模块,保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实。(3)根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数被动投资组合外)的同日反向交易。(4)债券场外交易,交易部在银行间市场上公平公正地进行询价,并由风险管理部对询价收益率偏离、交易对手及交易方式进行事前审核。

行为监控和分析评估方面:(1)公司每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。(2)公司对2013年上半年所有组合在日内、3日、5日所有同向交易数据进行了采集,对于相关采集样本进行了95%置信区间,假设溢价率为0的t统计检验,绝大多数样本通过相关检验。(3)对2013年上半年所有组合同向交易的交易占优情况进行了统计,在同向交易采集样本数大于30个的前提下,日内、3日、5日的期间窗口下,部分组合对比的统计值未满足交易占优比45%–55%的比例。需要指出的是,组合的同向交易的样本数越大,组合之间的交易占优情况满足交易占优比45%–55%的比例越高。(4)对于不同时间期间的同组合反向交易,公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析,未发现异常情况。不同时间期间的不同组合的反向交易,公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析,未发现异常交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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年上半年市场行情分化明显,以TMT和医药为代表的成长股表现出了明显的强势,以煤炭、有色等为代表的周期品行业表现明显落后。年初金融等权重板块延续了去年末的强劲走势,周期股反弹带动大盘创出年内高点;在2月份指数见顶之后,市场开始重新担心实体经济的恶化程度,成长股渐次活跃;3月份地产政策"新国五条"出台,导致了地产链的进一步下行。成长股主要体现在信息服务(包括传媒)、电子、医药、信息设备、环保等几个行业,上半年均取得正收益,其中传媒行业指数(中信一级分类)上涨54%,领涨所有行业分类指数。

投资策略方面,年初时配置相对均衡,价值股配置权重较大。在3月份之后逐步开始增加成长股的配置,坚持低估值+高成长的选股策略,兼顾均衡配置的思路。

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1.0367元(累计净值1.4317元)。报告期内本基金净值增长率为19.01%,高于业绩比较基准25.88个百分点。

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,证券市场还将呈现宽幅震荡的格局。宏观层面,经济探底的过程还没有结束,但也确实越来越临近经济底部,政策面上保增长的迹象开始出现,因此证券市场也处在筑底的阶段。当然偏弱的经济数据还会不时打击市场的情绪,同时IPO开闸只是个时间问题,成长股的估值也已经处于比较高的位置。配置中,我们仍将坚守低估值+高成长的思路构建组合,选择业绩增长确定、估值相对有优势的品种进行配置。目前阶段,超配的是医药、地产、一部分的TMT和交运设备子行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组,组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等,成员均具有多年基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理,但对于非活跃投资品种,投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定,本基金本报告期内未发生利润分配。

§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

在托管中海蓝筹灵活配置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《中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金托管协议》的约定,对中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金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,中海基金管理有限公司在中海蓝筹灵活配置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,中海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中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、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。

§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:中海蓝筹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	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		3,927,052.13	849,303.83
结算备付金		785,797.68	584,068.28
存出保证金		86,064.57	–
交易性金融资产		66,250,081.49	59,371,744.43
其中:股票投资		50,869,392.69	46,066,424.43
基金投资		–	–
债券投资		15,380,688.80	13,305,320.00
资产支持证券投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		3,000,000.00	–
应收证券清算款		1,032,663.37	–
应收利息		472,457.30	322,963.42
应收股利		15,200.00	–
应收申购款		126,581.78	2,174.24
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		75,695,898.32	61,130,254.20
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		180,444.09	–
应付赎回款		83,708.87	44,081.29
应付管理人报酬		92,986.32	72,310.96
应付托管费		15,497.74	12,051.84
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		346,205.70	266,036.91
应交税费		3,477.60	3,477.60
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		221,145.43	180,028.16
负债合计		943,465.75	577,986.76
所有者权益:			
实收基金		72,102,817.87	69,508,686.87
未分配利润		2,649,614.70	–8,956,419.43
所有者权益合计		74,752,432.57	60,552,267.44
负债和所有者权益总计		75,695,898.32	61,130,254.20

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0367元,基金份额总额72,102,817.87份。

6.2 利润表

会计主体:中海蓝筹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	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		13,243,624.33	4,621,322.39
1.利息收入		259,403.36	232,171.65
其中:存款利息收入		33,911.71	27,078.05
债券利息收入		213,208.89	205,093.60
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		12,282.76	–
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		16,081,852.07	1,653,010.90
其中:股票投资收益		15,599,205.08	1,531,769.67
基金投资收益		–	–
债券投资收益		12,546.65	–2,365.30
资产支持证券投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		470,100.34	123,606.53
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		–3,103,261.54	2,735,038.82
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		5,630.44	1,101.02
减:二、费用		1,838,118.26	1,425,023.42
1.管理人报酬		514,334.34	491,542.21
2.托管费		85,722.37	81,923.63
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		1,086,864.26	670,556.44
5.利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用		151,197.29	181,001.14
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		11,405,506.07	3,196,298.97
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		11,405,506.07	3,196,298.97

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中海蓝筹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)	69,508,686.87	–8,956,419.43	60,552,267.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	11,405,506.07	11,405,506.07
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)	2,594,131.00	200,528.06	2,794,659.06
其中:1.基金申购款	14,926,463.71	458,403.45	15,384,867.16
2.基金赎回款	–12,332,332.71	–257,875.39	–12,590,208.10
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)	72,102,817.87	2,649,614.70	74,752,432.57
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)	91,524,923.23	–17,687,826.97	73,837,096.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	3,196,298.97	3,196,298.97
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)	–20,163,635.84	3,024,487.66	–17,139,148.18
其中:1.基金申购款	2,163,515.47	–356,068.76	1,807,446.71
2.基金赎回款	–22,327,151.31	3,380,556.42	–18,946,594.89
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)	71,361,287.39	–11,467,040.34	59,894,247.05

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:

黄鹏 宋宇 曹伟

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

中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监许可【2008】816号《关于核准中海蓝筹灵活配置型证券投资基金募集的批复》核准募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司;有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2008年12月3日生效,该日的基金份额总额为746,402,589.05份。

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")、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和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

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

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

本基金在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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

6.4.6.1

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。

6.4.6.2

基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

6.4.6.3

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。对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,暂不征收企业所得税。

6.4.6.4

基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6.5

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。

6.4.7.2 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
中海基金管理有限公司("中海基金")	基金管理人、直销机构
农业银行	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司("国联证券")	基金管理人的股东、代销机构

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
国联证券	12,099,029.92	1.70%	102,580,158.29	23.38%

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
国联证券	–	–	3,309,900.00	56.60%

债券回购交易

注:本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.2 权证交易

注:本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 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
国联证券	11,015.07	1.71%	11,015.07	3.18%
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
国联证券	87,690.34	23.91%	87,690.34	55.22%

注:上述佣金按市场佣金率计算,已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

沪市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】–股票交易经手费–股票交易证管费–证券结算风险基金

深市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】–股票交易经手费–股票交易证管费–证券结算风险基金

国联证券符合我司选择证券经营机构、使用其席位作为基金专用交易席位的标准,与其签订的席位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	514,334.34	491,542.21
其中:支付销售机构的客户维护费	89,764.17	77,112.17

注: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为每日应支付的基金管理费,E为前一日的基金资产净值)

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

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	85,722.37	81,923.63

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为每日应支付的基金托管费

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。

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

注:本基金在本报告期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

注:本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注: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
农业银行	3,927,052.13	27,952.25	1,058,117.90	23,434.26

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002524	光正钢构	2013年4月24日	2014年4月25日	非公开发行流通受限	7.50	4.45	380,000	1,500,000.00	1,691,000.00	–

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28日	临时停牌	24.43	2013年7月30日	26.87	57,100	1,092,972.00	1,394,953.00	–
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	临时停牌	28.55	2013年7月24日	31.41	47,426	1,092,537.71	1,354,012.30	–

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,因此无抵押债券。

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,因此无抵押债券。

§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	50,869,392.69	67.20
	其中:股票	50,869,392.69	67.20
2	固定收益投资	15,380,688.80	20.32
	其中:债券	15,380,688.80	20.32
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	3,000,000.00	3.96
	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	4,712,849.81	6.23
6	其他各项资产	1,732,967.02	2.29
7	合计	75,695,898.32	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	1,981,740.96	2.65
B	采矿业	–	–
C	制造业	27,320,711.36	36.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	3,117,224.80	4.17
F	批发和零售业	–	–
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	774,867.00	1.04
J	金融业	–	–
K	房地产业	13,035,372.07	17.44
L	租赁和商务服务业	1,890,511.20	2.53
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	2,748,965.30	3.68
S	综合	–	–
	合计	50,869,392.69	68.05

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	000002	万 科A	313,900	3,091,915.00	4.14
2	600048	保利地产	281,700	2,791,647.00	3.73
3	000625	长安汽车	291,700	2,709,893.00	3.63
4	002241	歌尔声学	74,200	2,692,718.00	3.60
5	600518	康美药业	132,800	2,553,744.00	3.42
6	002450	康得新	90,400	2,529,392.00	3.38
7	002353	杰瑞股份	35,852	2,473,788.00	3.31
8	000731	四川美丰	279,288	2,320,883.28	3.10
9	600376	首开股份	404,700	2,246,085.00	3.00
10	600703	三安光电	113,482	2,228,786.48	2.98

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	600048	保利地产	7,167,612.40	11.84
2	600383	金地集团	6,538,563.44	10.80
3	000731	四川美丰	5,853,398.90	9.67
4	000002	万 科A	5,589,053.64	9.23
5	000656	金科股份	5,510,794.63	9.10
6	002140	东华科技	4,820,635.69	7.96
7	002415	海康威视	4,694,108.80	7.75
8	002148	北纬通信	4,684,641.83	7.74
9	601117	中国化学	4,320,214.27	7.13
10	000024	招商地产	4,158,104.31	6.87
11	002375	亚厦股份	4,031,555.66	6.66
12	002408	齐翔腾达	3,828,609.88	6.32
13	002106	莱宝高科	3,791,199.40	6.26
14	300113	顺网科技	3,711,288.42	6.13
15	000400	许继电气	3,664,949.36	6.05
16	002524	光正钢构	3,540,393.20	5.85
17	600547	山东黄金	3,516,695.23	5.81
18	000540	中天城投	3,221,227.25	5.32
19	002310	东方园林	3,218,685.37	5.32
20	002450	康得新	3,165,191.00	5.23
21	603000	人民网	3,093,294.27	5.11
22	601166	兴业银行	3,002,869.13	4.96
23	600376	首开股份	2,975,668.02	4.91
24	600703	三安光电	2,937,753.94	4.85
25	600108	亚盛集团	2,934,778.60	4.85
26	000625	长安汽车	2,841,006.27	4.69
27	300058	蓝色光标	2,822,780.96	4.66
28	601601	中国太保	2,690,098.38	4.44
29	002241	歌尔声学	2,551,602.00	4.21
30	600406	国电南瑞	2,503,107.14	4.13
31	002353	杰瑞股份	2,437,830.82	4.03
32	300115	长盈精密	2,429,391.80	4.01
33	600518	康美药业	2,407,888.37	3.98
34	002005	德豪润达	2,392,275.95	3.95
35	600267	海正药业	2,318,012.54	3.83
36	600489	中金黄金	2,299,505.97	3.80
37	002550	千红制药	2,262,897.00	3.74
38	002325	洪涛股份	2,254,301.17	3.72
39	600801	华新水泥	2,221,929.56	3.67
40	002042	华孚色纺	2,214,600.43	3.66
41	000920	南方汇通	2,202,159.89	3.64
42	300014	亿纬锂能	2,194,715.00	3.62
43	600261	阳光照明	2,183,378.02	3.61
44	600315	上海家化	2,143,145.84	3.54
45	600468	百利电气	2,127,864.36	3.51
46	601668	中国建筑	2,126,608.00	3.51
47	300027	华谊兄弟	2,080,675.55	3.44
48	002081	金 螳 螂	2,074,619.36	3.43
49	600366	宁波韵升	2,063,681.04	3.41
50	300083	劲胜股份	2,050,935.45	3.39
51	300136	信维通信	2,047,832.23	3.38
52	601886	江河创建	2,045,836.01	3.38
53	000848	承德露露	2,019,197.84	3.33
54	600348	阳泉煤业	2,018,500.21	3.33
55	000718	苏宁环球	2,017,784.77	3.33
56	600067	冠城大通	1,959,923.63	3.24
57	600422	昆明制药	1,920,610.16	3.17
58	600970	中材国际	1,902,136.16	3.14
59	600809	山西汾酒	1,895,154.34	3.13
60	600800	一汽轿车	1,887,626.00	3.12
61	002055	得润电子	1,874,253.34	3.10
62	300077	国民技术	1,774,623.60	2.93
63	002080	中材科技	1,756,437.67	2.90
64	300207	欣旺达	1,756,286.08	2.90
65	300005	探路者	1,744,980.46	2.88
66	000028	国药一致	1,716,950.21	2.84
67	002049	同方国芯	1,700,718.47	2.81
68	300197	铁汉生态	1,699,877.30	2.81
69	601318	中国平安	1,677,628.00	2.77
70	600373	中文传媒	1,664,311.00	2.75
71	000063	中兴通讯	1,651,404.00	2.73
72	002305	南国置业	1,624,067.00	2.68
73	600016	民生银行	1,590,952.00	2.63
74	300079	数码视讯	1,460,096.70	2.41
75	600837	海通证券	1,453,655.15	2.40
76	002244	滨江集团	1,445,198.20	2.39
77	300034	钢研高纳	1,439,373.48	2.38
78	000961	中南建设	1,421,847.94	2.35
79	600266	北京城建	1,418,088.00	2.34
80	600028	中国石化	1,407,374.00	2.32
81	002236	大华股份	1,406,685.46	2.32
82	300182	捷成股份	1,399,110.00	2.31
83	600633	浙报传媒	1,395,687.33	2.30
84	601928	凤凰传媒	1,385,990.82	2.29
85	300205	天喻信息	1,384,940.28	2.29
86	300273	和佳股份	1,380,158.35	2.28
87	002690	美亚光电	1,379,262.40	2.28
88	300024	机器人	1,368,517.43	2.26
89	300315	掌趣科技	1,346,586.20	2.22
90	601139	深圳燃气	1,343,218.34	2.22
91	600006	东风汽车	1,321,560.00	2.18
92	600600	青岛啤酒	1,312,443.00	2.17
93	600199	金种子酒	1,306,740.50	2.16
94	000001	平安银行	1,304,687.80	2.15
95	000423	东阿阿胶	1,300,388.00	2.15
96	600581	八一钢铁	1,297,254.78	2.14
97	601377	兴业证券	1,284,715.80	2.12
98	600104	上汽集团	1,283,447.20	2.12
99	600031	三一重工	1,281,766.00	2.12
100	600507	方大特钢	1,277,627.56	2.11
101	002091	江苏国泰	1,277,023.55	2.11
102	600157	永泰能源	1,273,976.00	2.10
103	000069	华侨城A	1,261,032.00	2.08
104	002500	山西证券	1,260,215.00	2.08
105	600276	恒瑞医药	1,237,928.00	2.04
106	000860	顺鑫农业	1,234,124.00	2.04
107	000661	长春高新	1,211,980.68	2.00

注:本报告期内,累计买入股票金额是以股票成交金额(成交单价乘以成交数量)列示的,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	601166	兴业银行	6,677,073.96	11.03
2	600383	金地集团	6,439,856.73	10.64
3	002140	东华科技	5,145,883.85	8.50
4	002148	北纬通信	5,051,716.11	8.34
5	000024	招商地产	5,043,264.38	8.33
6	601117	中国化学	4,964,059.25	8.20
7	002106	莱宝高科	4,677,498.77	7.72
8	600016	民生银行	4,674,756.57	7.72
9	002415	海康威视	4,586,330.52	7.57
10	000656	金科股份	4,541,578.41	7.50
11	600048	保利地产	4,489,273.38	7.41
12	002038	双鹭药业	4,404,078.84	7.27
13	000400	许继电气	3,929,767.33	6.49
14	300113	顺网科技	3,812,154.89	6.30
15	600547	山东黄金	3,646,758.83	6.02
16	000731	四川美丰	3,625,282.65	5.99
17	002408	齐翔腾达	3,510,002.93	5.80
18	600468	百利电气	3,483,566.08	5.75
19	000540	中天城投	3,450,680.57	5.70
20	603000	人民网	3,296,228.97	5.44
21	002310	东方园林	3,248,532.20	5.36
22	002375	亚厦股份	3,140,942.18	5.19
23	600489	中金黄金	3,026,061.56	5.00
24	002524	光正钢构	2,831,066.41	4.68
25	300014	亿纬锂能	2,708,097.81	4.47
26	300115	长盈精密	2,696,900.51	4.45
27	601601	中国太保	2,694,950.25	4.45
28	002005	德豪润达	2,537,084.69	4.19
29	002081	金 螳 螂	2,465,298.98	4.07
30	000002	万 科A	2,457,566.59	4.06
31	002325	洪涛股份	2,454,374.43	4.05
32	000920	南方汇通	2,434,692.12	4.02
33	600267	海正药业	2,380,149.44	3.93
34	300024	机器人	2,339,266.58	3.86
35	000848	承德露露	2,330,476.87	3.85
36	002042	华孚色纺	2,318,675.44	3.83
37	002080	中材科技	2,272,707.24	3.75
38	002550	千红制药	2,263,557.46	3.74
39	600366	宁波韵升	2,222,156.07	3.67
40	300083	劲胜股份	2,166,560.01	3.58
41	000718	苏宁环球	2,097,694.00	3.46
42	601886	江河创建	2,089,988.27	3.45
43	601668	中国建筑	2,072,970.00	3.42
44	300197	铁汉生态	2,040,224.49	3.37
45	600406	国电南瑞	2,036,627.16	3.36
46	300136	信维通信	2,028,001.78	3.35
47	002299	圣农发展	2,017,996.83	3.33
48	002244	滨江集团	2,010,396.87	3.32
49	600067	冠城大通	1,971,988.83	3.26
50	000800	一汽轿车	1,965,474.00	3.25
51	002500	山西证券	1,964,563.31	3.24
52	002055	得润电子	1,949,838.78	3.22
53	600809	山西汾酒	1,902,985.56	3.14
54	600801	华新水泥	1,885,795.68	3.11
55	600422	昆明制药	1,883,480.37	3.11
56	600157	永泰能源	1,862,834.79	3.08
57	600261	阳光照明	1,834,384.00	3.03
58	300077	国民技术	1,798,169.37	2.97
59	002049	同方国芯	1,794,214.84	2.96
60	300005	探路者	1,791,405.20	2.96
61	600348	阳泉煤业	1,786,752.39	2.95
62	600376	首开股份	1,773,960.10	2.93
63	002305	南国置业	1,757,409.41	2.90
64	601318	中国平安	1,727,310.46	2.85
65	600373	中文传媒	1,704,507.35	2.81
66	000661	长春高新	1,695,586.74	2.80
67	300205	天喻信息	1,691,993.18	2.79
68	000063	中兴通讯	1,647,029.00	2.72
69	300207	欣旺达	1,597,328.64	2.64
70	300315	掌趣科技	1,578,002.00	2.61
71	601101	昊华能源	1,561,636.80	2.58
72	000629	攀钢钒钛	1,543,696.82	2.55
73	600108	亚盛集团	1,524,431.01	2.52
74	000961	中南建设	1,523,652.76	2.52
75	000028	国药一致	1,523,321.48	2.52
76	601928	凤凰传媒	1,458,978.72	2.41
77	300182	捷成股份	1,456,834.00	2.41
78	002690	美亚光电	1,450,002.49	2.39
79	600837	海通证券	1,444,240.45	2.39
80	600633	浙报传媒	1,442,266.00	2.38
81	300079	数码视讯	1,431,638.97	2.36
82	300034	钢研高纳	1,422,636.07	2.35
83	000999	华润三九	1,415,982.82	2.34
84	600028	中国石化	1,377,751.00	2.28
85	000937	冀中能源	1,373,961.08	2.27
86	601699	潞安环能	1,342,194.59	2.22
87	300228	富瑞特装	1,341,194.35	2.21
88	002091	江苏国泰	1,340,607.67	2.21
89	300027	华谊兄弟	1,335,290.66	2.21
90	000001	平安银行	1,330,608.22	2.20
91	600600	青岛啤酒	1,328,141.62	2.19
92	600507	方大特钢	1,324,964.15	2.19
93	600036	招商银行	1,319,581.39	2.18
94	002620	瑞和股份	1,310,486.00	2.16
95	000860	顺鑫农业	1,304,918.80	2.16
96	300273	和佳股份	1,303,188.00	2.15
97	600276	恒瑞医药	1,296,329.50	2.14
98	002007	华兰生物	1,272,646.36	2.10
99	601139	深圳燃气	1,271,488.40	2.10
100	600104	上汽集团	1,265,268.33	2.09
101	600006	东风汽车	1,261,365.00	2.08
102	600031	三一重工	1,255,782.06	2.07
103	002462	嘉事堂	1,253,705.73	2.07
104	600109	国金证券	1,252,217.80	2.07
105	300105	龙源技术	1,249,543.62	2.06
106	000423	东阿阿胶	1,248,090.00	2.06
107	000887	中鼎股份	1,225,931.40	2.02
108	600581	八一钢铁	1,212,015.13	2.00

注:本报告期内,累计卖出股票金额是以股票成交金额(成交单价乘以成交数量)列示的,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	352,159,500.69
卖出股票收入(成交)总额	360,395,918.11

注:本报告期内,买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额(成交单价乘以成交数量)列示的,不考虑相关交易费用。

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	8,196,389.00	10.96
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	7,184,299.80	9.61
8	其他	–	–
9	合计	15,380,688.80	20.58

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	122009	08新湖债	44,150	4,656,059.00	6.23
2	113001	中行转债	38,740	3,878,261.40	5.19
3	110015	石化转债	33,120	3,306,038.40	4.42
4	112015	09泛海债	31,330	3,164,330.00	4.23
5	122013	08北辰债	3,760	376,000.00	0.50

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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

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基金合同规定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	86,064.57
2	应收证券清算款	1,032,663.37
3	应收股利	15,200.00
4	应收利息	472,457.30
5	应收申购款	126,581.78
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,732,967.02

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	113001	中行转债	3,878,261.40	5.19
2	110015	石化转债	3,306,038.40	4.42

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: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

本基金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
5,415	13,315.39	10,523,911.68	14.60%	61,578,906.19	85.40%

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	29,230.25	0.0405%

注: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;本基金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(2008年12月3日)基金份额总额	746,402,589.05
本报告期期初基金份额总额	69,508,686.87
本报告期基金总申购份额	14,926,463.71
减:本报告期基金总赎回份额	12,332,332.71
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	72,102,817.87

§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

本报告期内,本基金增聘陈忠先生为基金经理。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为江苏公证天业会计师事务所有限公司,本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

本报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员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

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	
民生证券	2	185,219,453.90	26.05%	168,097.57	26.11%	–
国信证券	1	103,212,870.57	14.52%	93,686.08	14.55%	–
光大证券	1	82,669,703.88	11.63%	73,777.64	11.46%	–
中信证券	2	54,359,838.63	7.64%	49,489.26	7.69%	–
长江证券	1	47,814,046.00	6.72%	43,529.62	6.76%	–
红塔证券	1	42,689,199.40	6.00%	38,864.32	6.04%	–
中信建投	1	30,462,416.49	4.28%	27,732.96	4.31%	–
银河证券	2	26,947,521.95	3.79%	24,196.95	3.76%	–
华创证券	1	25,443,206.42	3.58%	23,163.21	3.60%	–
安信证券	1	22,894,022.99	3.22%	20,842.61	3.24%	–
国泰君安	1	21,512,060.32	3.03%	19,584.37	3.04%	–
国金证券	1	19,091,046.60	2.68%	17,380.33	2.70%	–
华宝证券	1	18,042,398.69	2.54%	15,965.73	2.48%	–
国联证券	1	12,099,029.92	1.70%	11,015.07	1.71%	–
招商证券	1	9,341,980.34	1.31%	8,266.79	1.28%	–
海通证券	1	9,256,622.70	1.30%	8,191.26	1.27%	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
齐鲁证券	1	–	–	–	–	–
宏源证券	1	–	–	–	–	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
中航证券	1	–	–	–	–	–

注1:本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准,具体评分指标分为研究支持和服务支持,研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等;服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准,并参照我公司券商研究服务质量评分标准,确定拟租用交易单元的所属券商名单;由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判,草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿;报监察稽核部审核后确定租用交易单元。

注2:本报告期内退租了国元证券的上海交易单元和国元证券的深圳交易单元。

注3:上述佣金按市场佣金率计算,已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

注4: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。

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
民生证券	9,126,029.01	47.97%	–	–	–	–
国信证券	2,869,426.42	15.08%	–	–	–	–
光大证券	331,425.11	1.74%	–	–	–	–
中信证券	229,641.10	1.21%	–	–	–	–
长江证券	379,537.37	1.99%	3,700,000.00	16.74%	–	–
红塔证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	1,393,586.78	7.32%	–	–	–	–
银河证券	151,745.24	0.80%	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	4,085,585.30	21.47%	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
国金证券	459,127.43	2.41%	18,400,000.00	83.26%	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–
国联证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
中航证券	–	–	–	–	–	–

中海基金管理有限公司

2013年8月28日