（上接B32版）

（6）重要提示；

① 基金发行期内不受理基金转入交易申请，该基金成立并开放申购赎回业务后受理基金转换业务。新基金的转换规定，以本公司公告为准。

② 本招募说明书仅对国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票、国联安红利股票、国联安增利债券A、国联安增利债券B、国联安主题驱动股票、国联安信心增益债券、国联安上证商品ETF联接、国联安货币、国联安优选行业股票、国联安中债信用债指数增强、国联安保本混合、国联安股债动态和国联安医药100指数的转换事项予以说明。

③ 本公司有权根据市场情况调整上述转换的程序及有关限制，但最迟应在调整生效前按照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

④ 本基金转换业务的解释权归本公司。

八、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

九、基金的投资方向

本基金以上证大宗商品股票ETF、上证大宗商品股票指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证大宗商品股票ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

十、基金的投资策略

（一）基金的投资策略

本基金为上证大宗商品股票ETF的联接基金，主要通过投资于上证大宗商品股票ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证大宗商品股票ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：在正常情况下，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

1、资产配置策略

本基金主要投资于上证大宗商品股票ETF、上证大宗商品股票指数成份股和备选成份股。本基金投资于上证大宗商品股票ETF的比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的5%。

2、目标ETF投资策略

（1）基金组合的构建原则

本基金对基金的投资仅限于指定的目标ETF，现时目标ETF仅指上证大宗商品股票ETF。

（2）基金组合的构建方法

本基金可以以成份股实物形式在一级市场申购及赎回上证大宗商品股票ETF基金份额；本基金可在二级市场上买卖上证大宗商品股票ETF基金份额，本基金在二级市场上买卖上证大宗商品股票ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

本基金作为上证大宗商品股票ETF的联接基金，主要通过成份股实物形式从一级市场申购ETF份额来构建ETF投资组合。不是一级市场最小申购赎回单位资产净值的部分可以从二级市场买入ETF份额或者投资于上证大宗商品股票指数的成份股和备选成份股等。每个交易日进行ETF份额二级市场现金买卖的交易金额原则上不超过当日目标ETF一个最小申购赎回单位的净值。

本基金通过租用的特定交易单元申购、赎回目标ETF份额。当上证大宗商品股票ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

（3）基金组合的调整

本基金为ETF联接基金，基金所构建的ETF投资组合将根据目标ETF的变动而发生相应变化。本基金将根据法律法规中的投资比例限制、申购和赎回情况、现金头寸，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3、股票投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购上证大宗商品股票ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合加以替换。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

4、债券投资策略

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于国债、央票、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性和提高基金资产的投资收益。

5、股指期货及其他金融衍生品的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证，充分了解股指期货及其他金融衍生品的特点和各种风险，以审慎的态度参与股指期货及其他金融衍生品。

（二）投资决策流程

1、投资依据

(1) 有关法律、法规、基金合同等的相关规定；

(2) 经济运行态势和证券市场走势。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3、投资程序

(1) 首先运用数量化模型以及各种风险监控指标，结合公司内外的研究报告，对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析，提出研究分析报告。

(2) 投资决策委员会依据相关研究分析报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

(3) 基金经理根据标的指数，结合研究分析报告，原则上依据指数成份股的权重构建资产组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的技术和方法，降低交易成本，控制投资风险。

(4) 交易部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易。

(5) 根据市场变化，定期和不定期评估基金投资绩效。风险管理部对基金投资计划的执行进行日常监督和风险控制。

(6) 基金经理密切跟踪标的指数的变动，结合成份股情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、绩效评估报告等，对投资组合进行监控和调整，以实现对跟踪误差的有效控制。

(7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并予以公告。

十一、投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：95%×上证大宗商品股票指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

随着市场环境的变化，如果标的指数不适用于本基金或投资的目标ETF变更标的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序变更本基金的标的指数，同时变更本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定的媒体上刊登公告；若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并及时公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金为上证大宗商品股票ETF的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

十三、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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责任。

本基金的托管人——中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。本投资组合报告所载数据截至2013年9月30日，本报告财务资料未经审计师审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,198,308.47	1.05
	其中：股票	3,198,308.47	1.05
2	基金投资	284,473,220.21	93.54
3	固定收益投资	42,378.00	0.01
	其中：债券	42,378.00	0.01
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	16,126,635.47	5.30
7	其他资产	287,520.34	0.09
8	合计	304,128,062.49	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2、期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金	股票型	契约型开放式（ETF）	国联安基金管理有限公司	284,473,220.21	93.69

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	190,639.39	0.06
B	采矿业	2,026,747.74	0.67
C	制造业	839,321.34	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	141,600.00	0.05
	合计	3,198,308.47	1.05

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

4、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600547	山东黄金	33,519	743,116.23	0.24
2	601857	中国石油	25,737	201,778.08	0.07
3	600362	江西铜业	11,020	178,413.80	0.06
4	600143	金发科技	28,366	176,152.86	0.06
5	600028	中国石化	34,197	151,834.68	0.05
6	600256	广汇能源	15,000	141,600.00	0.05
7	600489	中金黄金	13,121	128,060.96	0.04
8	601899	紫金矿业	47,343	123,091.80	0.04
9	601088	中国神华	6,600	110,022.00	0.04
10	601958	金钼股份	13,206	109,213.62	0.04

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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	42,378.00	0.01
8	其他	-	-
9	合计	42,378.00	0.01

6、报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110020	南山转债	420	42,378.00	0.01

7、报告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。

8、报告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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

（3）本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

11、投资组合报告附注

（1）本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	73,121.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,939.05
4	应收利息	4,392.74
5	应收申购款	206,067.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	287,520.34

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110020	南山转债	42,378.00	0.01

（5）报告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。

十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说书。

本基金第1款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

4.基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（二）与基金销售有关的费用

1.申购费

（1）申购费率为：

本基金对通过本公司直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划等集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

通过基金管理人的直销中心申购本基金的特定投资群体申购费率为：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M<100万	0.12%
100万≤M<500万	0.05%
500万≤M<1000万	0.01%
M≥1000万	1000元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率为：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<500万	0.5%
500万≤M<1000万	0.1%
M≥1000万	1000元/笔

（2）申购费的收取方式和用途

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

申购费用由申购基金份额的基金投资人承担，不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（3）申购份额的计算方式

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 /（1+ 申购费率）

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

对于1000万元（含1以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 绝对数额的申购费金额

申购费用以人民币元为单位，四舍五入，保留至小数点后二位；申购份数采取四舍五入的方法保留小数点后二位，由此产生的误差计入基金财产。

2. 赎回费

（1）赎回费率为：

持有时间（天）	赎回费率
0-90	0.5%
91-729	0.25%
730及以上	0%

（2）赎回费的收取和用途

本基金的赎回费由赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，所收赎回费总额的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

（3）基金赎回金额的计算方式

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，其中：

赎回总额 = 赎回数量 × T日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

赎回金额、赎回费用以人民币元为单位，四舍五入，保留小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

3.转换费率

目前，基金管理人已开通了本基金与旗下部分开放式基金之间的转换业务，具体实施办法和转换费率详见相关公告。基金转换费用由投资者承担，基金转换费用由转出基金赎回费用和基金申购补差费用构成，其中转出基金赎回费按照基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

4.投资者通过本公司网上交易系统（www.efunds.com.cn）进行申购、赎回和转换的交易费率，请具体参照我公司网站上的相关说明。

5.基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他有关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。

6. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购、赎回和转换费率。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2013年7月16日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“二、释义”部分，更新了部分内容，并相应更新了相关部分的表述。
2. 在“三、基金管理人”部分，更新了部分内容。
3. 在“四、基金托管人”部分，根据最新资料进行了更新。
4. 在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额发售机构和会计师事务所信息。
5. 在“八、基金份额的申购、赎回”部分，更新了部分内容。
6. 在“九、基金转换”部分，更新了部分内容。
7. 在“十一、基金的投资”部分，补充了本基金2013年第3季度投资组合报告的内容。
8. 在“十二、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩数据。
9. 在“十六、基金的费用与税收”部分，更新了部分表述。
10. 在“二十四、其他应披露事项”部分，根据相关公告的内容进行了更新。

易方达基金管理有限公司
2014年1月15日

（上接B30版）

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王翔

联系人：吴阿婷

电话：0755-82721106-8642

传真：0755-82029055

客户服务电话：400-920-0022

公司网站：http://licaike.hexun.com

（二）基金注册登记机构

易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人：叶俊英

电话：400 881 8088

传真：020-38799249

联系人：余贤斌

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

负责人：王立华

联系电话：（010）88092188

传真：（010）88092150

联系人：王立华

经办律师：陈华、杨科

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

首席合伙人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真电话：（021）23238800

经办注册会计师：薛竞、庄贤

联系人：沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称：易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证100ETF、深证100价格指数成份股及备选成份股、新股(一级市场初次发行和增发)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常情况下，本基金资产中投资于深证100ETF的比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如果法律法规允许，本基金指数化投资（指对深证100ETF、深证100价格指数成份股及备选成份股的投资）的比例可以提高到基金资产净值的100%，同时业绩比较基准进行相应变更，该事项无须经基金份额持有人大会同意。

八、基金的投资策略

本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争最终将年化跟踪误差控制在4%以内。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证100ETF的买卖。

待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：深证100价格指数收益率×95%+活期存款利率(税后) ×5%。

十、基金的风险收益特征

本基金为深证100ETF的联接基金，主要通过投资于深证100ETF追踪业绩比较基准表现，业绩表现与深证100价格指数的表现密切相关。因此，本基金具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。理论上，本基金预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2014年1月6日复核了本投资组合报告。

本投资组合报告关于数据的期间为2013年7月1日至2013年9月30日。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,534,097.92	0.05
	其中：股票	3,534,097.92	0.05
2	基金投资	6,127,354,946.35	94.49
3	固定收益投资	293,593,500.00	4.53
	其中：债券	293,593,500.00	4.53
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,774,302.48	0.55
7	其他各项资产	24,622,039.26	0.38
8	合计	6,484,878,886.01	100.00

2. 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式（ETF）	易方达基金管理有限公司	6,127,354,946.35	94.67

3. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	158.36	0.00
B	采矿业	56,299.38	0.00
C	制造业	565,957.55	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123.36	0.00
E	建筑业	340.52	0.00
F	批发和零售业	989.45	0.00
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	729.20	0.00
J	金融业	431,174.20	0.01
K	房地产业	2,476,848.14	0.04
L	租赁和商务服务业	117.76	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	943.60	0.00
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	210.40	0.00
S	综合	206.00	0.00
	合计	3,534,097.92	0.05

4. 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	000024	招商地产	103,114	2,474,736.00	0.04
2	000333	美的集团	12,782	552,693.68	0.01
3	000001	平安银行	36,165	429,640.20	0.01
4	002155	辰州矿业	5,710	55,558.30	0.00
5	000002	万科A	154	1,406.02	0.00
6	000651	格力电器	40	1,062.40	0.00
7	002024	苏宁云商	77	989.45	0.00
8	000858	五粮液	32	576.00	0.00
9	000895	双汇发展	12	557.40	0.00
10	000063	中兴通讯	32	531.20	0.00

5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	293,593,500.00	4.54
	其中：政策性金融债	293,593,500.00	4.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	293,593,500.00	4.54

6. 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	130218	13国开18	1,750,000	173,827,500.00	2.69
2	130201	13国开01	500,000	49,875,000.00	0.77
3	130236	13国开36	400,000	39,948,000.00	0.62
4	120419	12农发19	300,000	29,943,000.00	0.46

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7. 报告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。

8. 报告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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

(2) 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。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	986,084.90
2	应收证券清算款	17,397,564.18
3	应收股利	-
4	应收利息	4,771,385.68
5	应收申购款	1,467,004.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,622,039.26

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002155	辰州矿业	55,558.30	0.00	重大事项停牌

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本基金合同生效日为2009年12月1日，基金合同生效以来（截至2013年6月30日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	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
基金合同生效至2009年12月31日	0.10%	0.55%	1.49%	1.52%	-1.39%	-0.97%
2010年1月1日至2010年12月31日	-0.50%	1.60%	-3.88%	1.64%	3.38%	-0.04%
2011年1月1日至2011年12月31日	-28.96%	1.32%	-29.60%	1.34%	0.64%	-0.02%
2012年1月1日至2012年12月31日	2.39%	1.36%	2.00%	1.38%	0.39%	-0.02%
2013年1月1日至2013年6月30日	-9.05%	1.45%	-9.87%	1.46%	0.82%	-0.01%
基金合同生效至2013年6月30日	-34.11%	1.42%	-36.86%	1.46%	2.75%	-0.04%

十三、费用概览

（一）与基金运作相关的费用

1. 基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费；

(2)基金托管人的托管费；

(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用；

(4)基金合同生效以后的信息披露费用；

(5)基金份额持有人大会费用；

(6)基金的证券交易费用；

(7)基金的银行汇划费用；

(8)按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

① 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.6%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

② 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.2%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3-7项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3. 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

① 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

② 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

③（基金合同）生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

④ 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（二）与基金销售有关的费用

1. 申购费率

① 本基金的前端申购费率：

本基金前端收费模式对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

A、前端申购费率：

申购金额（M）	前端申购费率
M<100万元	0.8%
100万元≤M<500万元	0.5%
M≥500万元	每笔1000元

注：上述前端申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他选择前端收费模式申购本基金基金份额的投资者。

B、特定申购费率：

申购金额（M）	特定申购费率
M<100万元	0.24%
100万元≤M<500万元	0.15%
M≥500万元	每笔1000元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台、选择前端收费模式申购本基金基金份额的养老金客户，包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

② 本基金的后端申购费率：

本基金基金份额的后端申购费率见下表：

持有时间（N）	后端申购费率
1年以内（含）	1.0%
1年-3年（含）	0.6%
3年-5年（含）	0.4%
5年以上	0

③ 本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。

2、赎回费率

① 本基金的的赎回费率如下表：

持有时间（T）	赎回费率
1年以内（含）	2%
1年—2年（含）	1%
2年—3年（含）	0.5%
3年以上	0%

注：上表中，1年按365天计算。

② 投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费归入基金财产的比例为赎回费总额的100%。

3、基金的转换费

① 期端转前端

基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。其中，转出基金赎回费是按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用；转入基金申购补差费是按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式，转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率