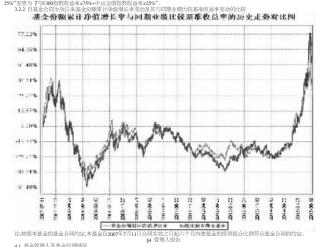
1.1 重要提示 本基金管理人员董单会、董事保证本规告所裁资料不存在虚假记载、误号性统述或重大遗漏。并对其内容的真实性、准确性和定整性承担 及法带的法律界化。本学年度报记已经三分之一以上验证董事签字简整、并由董康托签及、 本基金杆管人中国政业银行部份有限公司标准本基金合同规定于30年8月8日日度 「本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情 体务会计相关。把资租合报告内容,保证取标内容不存在虚假过度。以同性陈述或者重大遗漏。 未基金管理人类说证或专用,则被服务等的原则管理和定用基金营产(用不保证金金一定登利、 基金的过程业份并不代表其来来表现。投资有风险投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的拓聚规则书及其更新。

2.1 基金基本情况			§2 基金简介			
基金简称			益民创新优势混合			
基金主代码			560003			
基金运作方式			砂型开放式			
基金合同生效日		2	007年7月11日			
基金管理人		i	紀基金管理有限公司	ď		
基金托管人		-	中国农业银行股份有阶	公司		
报告期末基金份额总额	ij	1	,221,498,976.52份			
基金合同存续期		7	下定期			
2.2 基金产品说明						
投资目标			本基金主要投资于具 份额持有人实现较高	有持续创新能力的优势企业和潜在优势企业,为基金 风险水平下的较高收益。		
投資策略			本基金機計一些採取計、通訊从企採到III的的分析思路、从中企註序业里期 运行的大环境分析作为行助研究的出发点。用结合国内客乘经济、产业投 策、货币金融资金等经济环境的分析,从而判例国内各行业产业推销专事以 在在期,并从中投出能够分等全球经济增长的创新下业或主编。本基全对于 企业创新特色的发生并至受组用公方面,法人创新资产品及财务的 度创新和商业模式创新,本基金将以寻求创新溢价为目标、采综合构建基金 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出 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					
IJ	iΒ		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		
	姓名	刘伟		林葛		
信息披露负责人	联系电话	010-631055	56	010-66060069		
	电子邮箱	jcb@ymfund	.com	tgxxpl@abchina.com		
客户服务电话	'	400-650-88	08	95599		
传真		010-631005	88	010-68121816		
2.4信息披露方式						
登载基金半年度报告〕	E文的管理人互联	网网址	www.ymfund.com			
基金半年度报告备置为	也点		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			
31 主要会计数据和	H & thic	§3主要》	财务指标和基金净值	 現		
3.1 土安云订奴结和	R1951HPIV			金额单位:人民		
3.1.1 期间数据和指标			报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日)			
			MINI 2015-1711 - 2015-107150-17			

指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用:计人费用后实际收益水平要低于所列数字。 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)加除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益 교이 교호식자(요료) 단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款低数(为期末余額,不是当期发生数)。 응생 국제

报告期末 (2015年6月30日

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								
阶段	份額争值增长 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	-16.23%	3.92%	-5.44%	2.62%	-10.79%	1.30%		
过去三个月	8.51%	3.00%	8.45%	1.96%	0.06%	1.04%		
过去六个月	36.70%	2.32%	20.72%	1.70%	15.98%	0.62%		
过去一年	75.10%	1.78%	75.69%	1.38%	-0.59%	0.40%		
过去三年	82.54%	1.45%	64.41%	1.12%	18.13%	0.33%		
自基金合同生效 起至今	37.46%	1.55%	31.25%	1.35%	6.21%	0.20%		
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3	800指数收益率×75%+新	华巴克莱指数收益率		



经治	87.95	任职日期	离任日期	北郊从北平阪	19694
等字	研究发展部总经性 理。起民创新优全性 验证券投资基本基金心结合 基金。在1000年,2000年	2012年8月16日	-	13	空任中国有公司。 中国有公司。 第一届 中国有公司。 第一届 中国有公司。 第一届 中国有公司。 第一届 中国
3557107	投資都	2015年6月16日	-	6	曾任世德贝研师风限间师风限间师风限间师风限间师风限间所风限间所风限间所风限的间外风度的原始的原始的原始的原始的原始的原始的原始的原始的原始的原始的原始的原始的原始的

vx。 本基金在年初主要配置了业绩确定的成长类股票和国企改革类投资标的,由于所持股票涨幅巨大,但是公司在半年如此短的时间内并设 生根本性的变化因此本基金认为其股票价格已经脱离了其基本面出现了明显的泡沫,在此情况下大幅减持成长股,增加了低估值、国企

中国农业银行股份有限公司托管业务部 2015年8月18日 §6半年度财务会计报告(未经审计)

益民创新优势混合型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

资产	本期末 2015年6月30日	单位:人民币 上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	17,176,960.08	121,781,206.86
结算备付金	6,575,585.14	43,344,122.63
存出保证金	3,067,940.28	2,744,864.62
交易性金融资产	1.647.510.044.10	2,918,391,213.09
其中:股票投资	1,460,351,860,10	2,683,651,613.09
基金投资	-	-
债券投资	187,158,184.00	234,739,600.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	-	=
买人返售金融资产		190,000,000.00
应收证券清算款	7,585,140.78	60,364,746.78
应收利息	5,527,718.34	4,912,421.34
应收股利	-	-
应收申购款	640,729.86	11,742.77
递延所得税资产		-
其他资产		_
资产总计	1.688.084.118.58	3,341,550,318.09
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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	17,414.20	145,165,436.13
应付赎回款	22,873,805.97	4,037,558.22
应付管理人报酬	2,653,589.92	3,950,126.90
应付托管费	442,264.98	658,354.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,551,861.03	14,569,481.00
应交税费	2,474,068.58	2,474,068.58
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	547,397.78	484,745.39
负债合计	34,560,402.46	171,339,770.65
所有者权益:		
实收基金	1,221,498,976.52	3,201,205,708.65
未分配利润	432.024.739.60	-30,995,161.21
所有者权益合计	1,653,523,716.12	3,170,210,547.44
负债和所有者权益总计	1,688,084,118.58	3,341,550,318.09
注:报告截止日2015年6月30日.基金份额6 6.2 利润表 会计主体:益民创新优势混合型证券投资 本报告期: 2015年1月1日至2015年6月30		*0.197

		单位:人民币
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
the 1		
一、收人 1 利息收入	1,159,952,760.95	17,912,409.73
I.利息收入 其中:存款利息收入	7.269.035.18	11,467,752.12
	1.043.965.82	815,912.94
债券利息收入	4,471,949.06	5,311,051.14
资产支持证券利息收入	-	262,508.51
买人返售金融资产收入	1,753,120.30	5,078,279.53
其他利息收入	-	-
2.投资收益 假失以""填列)	1,217,256,746.22	-121,861,374.02
其中:股票投资收益	1,206,974,480.65	-131,934,267.99
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,001,495.45	-6,536,672.18
资产支持证券投资收益	-	-114,174.77
贵金属投资收益	-	-
行生工具收益	-	-
投利收益	9,280,770.12	16,723,740.92
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)	-64,636,652.11	128,305,203.66
4. 汇兑收益 惯失以 ""号填列)	-	-
5.其他收入 损失以 ""号填列)	63,631.66	827.97
减:二、费用	53,070,021.37	55,931,330.09
1.管理人报酬	21,042,456.79	21,485,885.02
2.托管费	3,507,076.15	3,580,980.85
3.销售服务费	_	_
4.交易费用	28,236,306.47	30,703,732.63
5.利息支出	115,418.49	949.66
其中:卖出回购金融资产支出	115,418.49	949,66
6.其他费用	168,763.47	159,781.93
三、利润总额 (亏损总额以""号值列)	1,106,882,739,58	-38,018,920,36
咸:所得税费用	-	-
四、净利润(争亏损以""号填列)	1,106,882,739,58	-38.018.920.36
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:2015年1月1日 至 2015年6月30日		

◆ (水) 本 (水) 和	130□		单位:人民币			
项目	20	本期 015年1月1日至2015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)	3,201,205,708.65	-30,995,161.21	3,170,210,547.44			
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数 (本期净利润)	-	1,106,882,739.58	1,106,882,739.58			
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)	-1,979,706,732.13	-643,862,838.77	-2.623.569.570.90			
其中:1.基金申购款	83,819,523.43	29,897,002.07	113,716,525.50			
2.基金赎回款	-2,063,526,255.56	-673,759,840.84	-2,737,286,096.40			
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动 (争值 减少以""号填列)	-	=	-			
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,221,498,976.52	432,024,739.60	1,653,523,716.12			
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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(胨金净值)	3,911,461,732.23	-851,060,488.46	3,060,401,243.77			
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数 (本期净利润)	-	-38.018.920.36	-38,018,920.36			
三、本期基金份額交易产生的基 金净值变动数 (净值减少以""号填列)	-236,328,022.08	55,013,022.51	-181,314,999.57			
其中:1.基金申购款	1,922,727.59	-463,254.72	1,459,472.87			
2.基金赎回款	-238,250,749.67	55,476,277.23	-182,774,472.44			
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动 (争值 减少以""号填列)	-	=	-			
五、期末所有者权益(基金净值)	3,675,133,710.15	-834,066,386.31	2,841,067,323.84			

报表明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
需学军
吴聪明
基金管理人负责人
生管会计工作负责人
会计机构负责人

2個。希腊上旬的到机上次面的2分下水500mm以近年47/87中止正面的18以近年4月96。 全计报表的编码的简明的第一个大多数。 多有报表表现现的按照则而的《企业会计准制》一基本推测。以及其后部也多考了中国证券设备基金业协会修订为效率的 他类异设就基础。 是一个大多数,企业会计模的。 就是一个大多数,中国证金为地位的《专注》中,是本种的信息被靠方面让多考了中国证券设备基金业协会修订为效率的 他类异设就基础 是一个大多数。中国企业分别的企业分别,他类较优越高的企业分别的企业分别。 这种类化数量是一个大多数。 这种类化数量是一个大多数的企业分别。 是一个大多数的企业分别。 是一个大多数的企业分别。

经查成果和基金净值变动情况等有关信息。
64.4 重要点计规度和全计估计。
本程告则会计恢复和全计估计。
本程告则会计恢复和实计估计。
64.5 会计恢复和实计估计。
64.5 会计恢复和实计估计。
64.5 会计恢复和实计估计。
64.5 会计恢复和实现。
64.5 会计恢复和实现。
64.5 会计恢复和实现。
64.5 会计恢复和实现。
64.5 会计标准电子机设置。
64.5 会计信息中央机会 电阻力 (1) 电阻力 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%。调整为1%。 区国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券,股票,交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再

這用30%的稅率計值个人的權稅。 總抵於即 国政保金局局稅(2005)100号文 使于股权分置点点流落有关股政发振向即的场面 的规定股权分置改革中非流通股股东 銀稅採即 国政保金局局稅(2005)100号文 使于股权分置成点流落有关股政发振向即的场面的规定股权分置改革中非流通股股东 服務採即 国家保全局局稅(2005)120号。 假武阳国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税及策的通知 的规定。自2008年 尼对信置存款利息所得暂免回收个人所得税。 宋规哲关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构
重庆国际信托有限公司	基金管理人控股股东
中山证券有限责任公司(中山证券")	基金管理人股东、基金代销机构
中国新纪元有限公司	基金管理人股东
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
国泓资产管理有限公司	基金管理人子公司
注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款	饮订立。

基金管理人子公司 上級二次確定發射在正常业务信期内据一般商业条款订立。 6.48 本排售期处上年度司比期间的决定方交易 6.48 出进进步大多埠平远往行的交易 6.48 出进步大多埠平远往行的交易 6.48 出进步大多埠平远往的交易 6.48 出进步大多埠平远往的交易 6.48 出进等处局处上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行破势交易。 6.48 出调参回即交易 6.48 出调参回即交易 6.48 出调参回即交易 6.48 出调参回取及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行储券包购交易。 6.48 出调参回取及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行储券回购交易。 6.48 出调参回取及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行储券回购交易。 6.48 出有、现定公易

6.48.1.4 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。 6.48.1.5应支付关联方的佣金 本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

本期 2015年1月1日至2015年6月30日 其中,支付销售机的综合中能中等 3.741.680.29 3.886.480.18 注基金管理管控制一均基金资产单位的1.5年要率计算。计算方法如下: HEA1.5%-当年天贸 用 为每日包计提的基金管理费 E 为前一日基金资产的值 基金管理人的管理费的工程。这里累计至每月月底。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及,是是是一种企业的管理费品,是是一种企业的管理及。

		单位:人民币元
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,507,076.15	3,580,980.85
H=Ex0.25%: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	一净值的0.25%的年费率计算。计算方法如下: 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

採息日。女行早期順延。 648.23 緒號B各費 本基金本招參閱及上年度可比期间光緒無服务费。 648.3 与某股进在行银行间间业市场价债券含回购交易 本基金本招參閱及上年度可比期间均均与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。 648.4 多类联介被专基金的债 648.4 名类联介被专基金的债 648.4 1 报告期内基金管理人互用固有资金投资本基金的情况

		DT8MT-11/:D
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
金合同生效日(2007年7月11日) 的基金份額	=	-
初持有的基金份額	8,426,308.25	8,426,308.25
间申购买人总份额	_	-
间因拆分变动份额	-	-
:期间赎回/卖出总份额	=	=
末持有的基金份額	8,426,308.25	8,426,308.25
末持有的基金份額	0.69%	0.23%

16.006-2-	e			20	015年6	月30日				2014年12	∃31⊟							
关联方: 称	Ď.			寺有的 金份智			持有的基 占基金总 比值	份额的		持有的 基金份額		持有的基 占基金总 比例	份额的					
重庆国 信托司 公员会 委员会	限					281,7					31,718.20		0.02%	5	28	1,718.20		0.01%
6.4.8.5	由关联	(方保管)	的银行	存款	会额及当	当期产生的	的利息收入					单位	±.人民⊓					
关助 名i	纺		20	015年1		期 2015年6	月30日			上年度可比 2014年1月1日至20		0⊟						
40	100		期末余额			当具	朝利息收入			期末余額	74	期利息收入						
中国农	业银行		17,	176.9	50.08		746	768.31		5,478,397.55		412	2,087.62					
6.4.9.1 6.4.10.1.2 证券	2 受限i	新发/增	灰业类	enn+														
代码	证券 名称	成功	1 0		流通空 限类型	ž įJu	期末信		数量(单位:张)	期末 成本总額	期末	估值总额	备注					
122380	名称 14編 华01	成功 认购I 2015年 月12日	日 日 日 日 日 7	流通 日 015年 月7日	流通空 限类型 新债济 通受同	き 认順位 价格 間 100.0	的 期末信 各 单位			成本总额		估值总额 247,000.00	备注					
122380	名称 14編 华01	成功 认购I	F6 20	流通 日 015年 月7日	流通空 限类型 新债济 通受同	き 认順位 价格 間 100.0	的 期末信 各 单位	î.	(单位:张)	成本总额			-					
122380	名称 14編 华01	成功 认购I 2015年 月12日	F6 20	流通 日 015年 月7日 等流过	流通空 限类型 新债济 通受附	泛 认购价格 100.0	的 期末信 各 单位	0.00	(单位:张)	成本总额	0 17,	247,000.00	-					

6.49.31 银行间市场储券正回购 本基金本报告期末无银行间市场储券正回购余额。 6.49.32 受易所市场储券正回购余额。 本基金本报告期末无役易所市场储券正回购余额。

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	1,460,351,860.10	86.51
	其中:股票	1,460,351,860.10	86.51
2	固定收益投资	187,158,184.00	11.09
	其中:债券	187,158,184.00	11.09
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	23,752,545.22	1.41
7	其他各项资产	16,821,529.26	1.00
8	合计	1,688,084,118.58	100.00

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	林、牧、渔业 54,591,947.30					
В	采矿业		=	=			
C	制造业		669,537,884.99	40.49			
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		242,791,875.35	14.68			
E	建筑业		171,955,379.87	10.40			
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		106,332,815.75	6.43			
L	租赁和商务服务业		135,784,123.80	8.21			
M	科学研究和技术服务业		-	-			
N	水利、环境和公共设施管理业		-	-			
0	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		62,427,031.04	3.78			
S	综合		-	-			
	合计		1,460,351,860.10	88.32			
7.3	明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	A strate (): 1 Plant			
				金额单位:人民币			
police proj	MIT THE CO	44.573 80.5		占据全资产净值比例			

占基金资产净值比(%)	公允价值	数量 段)	股票名称	股票代码	序号
8	135,784,123.80	2,048,026	中国国旅	601888	1
8	133,476,941.40	4,070,660	桂东电力	600310	2
6	103,338,844.73	5,169,527	安徽水利	600502	3
5	93,172,129.96	2,587,396	信质电机	002664	4
4	82,229,017.50	5,605,250	国电南自	600268	5
4	82,039,121.56	2,877,556	多氟多	002407	6
4	78,266,353.14	1,494,203	久立特材	002318	7
4	74,949,225.75	2,324,007	格力地产	600185	8
3	62,427,031.04	1,894,024	当代东方	000673	9
3	54,591,947.30	2,014,463	隆平高科	000998	10

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金額	占期初基金资产净值比例 66)
1	601166	兴业银行	312,689,353.56	9.86
2	601318	中国平安	279,929,038.78	8.83
3	600999	招商证券	223,496,278.60	7.05
4	600036	招商银行	190,049,599.18	5.99
5	601788	光大证券	189,277,753.93	5.97
6	600332	白云山	189,102,856.61	5.96
7	600502	安徽水利	182,400,092.18	5.75
8	600643	爱建股份	181,790,720.14	5.73
9	601688	华泰证券	162,966,425.17	5.14
10	600310	桂东电力	158,082,173.38	4.99
11	000090	天健集团	141,486,037.72	4.46
12	002594	比亚迪	139,787,809.52	4.41
13	000776	广发证券	137,806,043.81	4.35
14	000673	当代东方	131,781,176.09	4.16
15	002407	多氟多	129,224,636.58	4.08
16	600388	龙净环保	124,361,540.55	3.92
17	000831	五矿稀土	124,173,681.77	3.92
18	600000	浦发银行	124,002,112.37	3.91
19	000559	万向钱潮	120,913,042.60	3.81
20	600185	格力地产	113,837,693.23	3.59
21	601377	兴业证券	108,184,524.52	3.41
22	002664	信质电机	103,695,004.56	3.27
23	600326	西藏天路	100,429,734.28	3.17
24	002318	久立特材	100,105,450.82	3.16
25	002573	清新环境	93,807,303.71	2.96
26	000777	中核科技	93,596,951.75	2.95
27	600875	东方电气	92,934,059.83	2.93
28	000425	徐工机械	92,097,166.95	2.91
29	601607	上海医药	91,863,779.07	2.90
30	600268	国电南自	90,691,713.72	2.86
31	000998	隆平高科	89,003,984.59	2.81
32	000728	国元证券	85,142,361.79	2.69
33	600240	华业地产	83,120,893.79	2.62
34	002121	科陆电子	80,493,548.88	2.54
35	600820	隧道股份	77,471,860.30	2.44
36	000069	华侨城A	76,499,432.68	2.41
37	601328	交通银行	75,936,181.10	2.40
38	000001	平安银行	71,349,912.54	2.25
39	600761	安徽合力	63,566,558.14	2.01
		知此今恣声為他如此前20夕(

39 600761 安徽合力 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

1	601166	兴业银行	337,375,895.51	10.6
2	600000	浦发银行	310,087,809.90	9.7
3	601318	中国平安	293,904,054.86	9.2
4	601688	华泰证券	279,176,259.53	8.8
5	300274	阳光电源	272,881,379.13	8.6
6	601788	光大证券	225,376,092.45	7.1
7	600999	招商证券	216,983,204.64	6.8
8	600643	爱建股份	211,871,697.50	6.6
9	600820	隧道股份	206,966,413.49	6.5
10	600332	白云山	202,333,418.48	6.3
11	600036	招商银行	193,948,944.96	6.1
12	002594	比亚迪	188,288,893.47	5.9
13	002421	达实智能	188,213,736.55	5.9
14	000776	广发证券	187, 200, 296.90	5.9
15	000069	华侨城A	183,462,583.25	5.7
16	000728	国元证券	181,689,150.29	5.7
17	601988	中国银行	170, 266, 147.47	5.3
18	600016	民生银行	147,675,664.48	4.6
19	000090	天健集团	142,181,301.83	4.4
20	002315	焦点科技	138.858.377.90	4.3
21	600388	龙净环保	133,023,017.74	4.2
22	600326	西藏天路	131,543,190.75	4.1
23	000831	五矿稀土	130,688,965.41	4.1
24	000783	长江证券	125,060,827.60	3.9
25	000559	万向钱潮	122,114,430.49	3.8
26	600502	安徽水利	121,418,945.66	3.8
27	002413	常发股份	113,986,257.86	3.6
28	601607	上海医药	108,847,858.13	3.4
29	000777	中核科技	105,734,463.20	3.3
30	601328	交通银行	103,900,848.35	3.2
31	000425	徐工机械	103,241,175.00	3.2
32	601377	兴业证券	101,592,911.47	3.2
33	002573	清新环境	97.694.017.98	3.0
34	600240	华业地产	96,812,604.29	3.0
35	002407	多氟多	93,079,789.12	2.9
36	600340	华夏幸福	91,180,207.94	2.8
37	600310	桂东电力	87,922,904.85	2.7
38	000402	金融街	87,686,450.11	2.7
39	600875	东方电气	86,726,642.27	2.7
40	600030	中信证券	86,542,123.45	2.7
41	002335	科华恒盛	85,771,316.88	2.7
42	600208	新湖中宝	84,144,475.58	2.6
43	600097	开创国际	80,691,249.52	2.5
44	300055	万邦达	78,770,613.45	2.4
45	300315	掌趣科技	78,264,226.92	2.4
46	600068	葛洲坝	75,345,396.60	2.3
47	600150	中国船舶	74,102,034.68	2.3
48	000488	晨鸣纸业	72,613,987.02	2.2
49	000673	当代东方	72,291,949.13	2.2
50	002318	久立特材	72,236,530.71	2.2
51	600185	格力地产	72,023,983.95	2.2
52	000807	云铝股份	70.893.818.90	2.2
53	601000	唐山港	69,912,131.93	2.2
54	000001	平安银行	69,518,528.94	2.1
55	002241	歌尔声学	65,499,253.01	2.0
56	000707	由国武惠	65, 358, 212, 84	2.0

注: 集出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交教量)填列,不考虑相关交易费用。 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收人总额

买人股票	成本 成交)总额		7,707,616,510.98		
卖出股票	收人 (成交)总额		10,073,536,070.97		
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:		
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	147,582,000.00	8.93		
	其中:政策性金融债	147,582,000.00	8.93		
4	企业债券	17,366,784.00	1.05		
5	企业短期融资券	22,209,400.00	1.34		
6	中期票据	-	=		
7	可转债	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	187,158,184.00	11.32		

.0 391/1	19.22 / 1.07 国口多亚风	THEILINGTHE	LANGUT STIMSLY NO	977	金额单位:人民币
序号	债券代码	债券名称	数量 帐)	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	140444	14次发44	600,000	60,210,000.00	3.64
2	140223	14国开23	570,000	57,228,000.00	3.46
3	140230	14国开30	300,000	30,144,000.00	1.82
4	122380	14輪华01	172,470	17,247,000.00	1.04
5	041460067	14修正药业 CP001	60,000	6,071,400.00	0.37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资再本基金本报告期末末持有资产支持证券。 7.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细本基金本报告期末未持有贵金属。

本基金土招告期末末特有景金属。 79 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 本基金本报告期末本基金投资险股指期货交易情况记明 7.10原告期末本基金投资险股指期货役易情况记明 本基金基金合同的投资范围商标名包含股油财投资。 7.11居告期末本基金投资的国债期货交易情死记明 本基金基金合同的投资范围商末包含金国债期货投资。 7.12 投资组合报告附注

生结例正大的影响。 本基金投资的机人否证券的安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、处罚的情况 7.122 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。

7.12.3 與	床其他各项资产构成	单位:人民币
序号	名称	金額
1	存出保证金	3,067,940.28
2	应收证券清算款	7,585,140.78
3	应收股利	-
4	应收利息	5,527,718.34
5	应收申购款	640,729.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,821,529.26

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 %)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

		持有人结构						
持有人户数(户)	户均持有的基金份	机构投资	者	个人投资者	ŕ			
141170 30 7	額	持有份額	占总份额比例	持有份額	占总份额比 例			
57,802	21,132.47	87,084,555.	38 7.13%	1,134,414,421	.14 92.87%			
8.3 期末基金管理	人的从业人员持有本	基金的情况			,			
IJ	ŧΒ	持有份额总	总数 (分)	占据金总份	額比例			
基金管理人所有从业人员持有本基金			788,25	0.35	0.06%			
8.4 期末基金管理	人的从业人员持有本	开放式基金份额总量区间的	与情况					
	项目		持有基金的	分額总量的数量区间(万份)				
本公司高级管理人 开放式基金	员、基金投资和研究部	门负责人持有本			50-100			
本基金基金经理持	有本开放式基金				0			

§9 开放式基金份额变动	
	单位
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額总额	3,201,205,708.65
本报告期基金总申购份额	83,819,523.43
减:本报告期基金总赎回份额	2,063,526,255.56
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	=
本报告期期末基金份額总额	1,221,498,976.52

国金证券 (沪深)	2	1,501,316,274.70	8.44%	1,366,794.25	8.44%	-
银河证券	1	1,419,850,958.81	7.99%	1,292,628.55	7.99%	-
光大证券	2	1,374,919,398.61	7.73%	1,251,724.84	7.73%	-
民生证券 (沪深)	2	1,253,986,133.56	7.05%	1,141,630.08	7.05%	-
民族证券	1	1,104,123,535.36	6.21%	1,005,194.46	6.21%	-
国信证券	1	1,018,151,215.73	5.73%	926,925.36	5.73%	-
东兴证券	1	963,953,147.35	5.42%	877,580.13	5.42%	-
西部证券	1	879,071,745.24	4.94%	800,305.36	4.94%	-
中信建投(沪深)	2	816,329,275.99	4.59%	743,185.05	4.59%	-
招商证券	1	779,415,712.89	4.38%	709,573.15	4.38%	-
齐鲁证券	1	751,742,751.31	4.23%	684,385.34	4.23%	-
方正证券	1	696,429,932.95	3.92%	634,030.38	3.92%	-
浙商证券	1	672,226,374.08	3.78%	611,995.30	3.78%	-
平安证券	1	653,417,595.81	3.68%	594,872.02	3.68%	-
海通证券	2	557,555,572.99	3.14%	507,600.61	3.14%	-
国都证券	1	552,035,306.44	3.10%	502,572.41	3.10%	-
国泰君安	1	440,222,900.07	2.48%	400,778.71	2.48%	-
广州证券	1	398,582,708.91	2.24%	362,870.56	2.24%	-
国联证券	1	382,900,756.94	2.15%	348,594.03	2.15%	-
申万宏源	1	373,523,096.32	2.10%	340,054.96	2.10%	-
东北证券	1	322,259,717.31	1.81%	293,384.82	1.81%	-
中银国际	1	239,796,729.71	1.35%	218,311.49	1.35%	-
山西证券	1	186,335,204.31	1.05%	169,640.11	1.05%	-
广发证券	1	138,745,937,46	0.78%	126.314.34	0.78%	_
中金沪市	1	130,952,925.49	0.74%	119,219.29	0.74%	-
东方证券	1	109,428,965.46	0.62%	99,624.10	0.62%	-
兴业证券	1	62,403,051.67	0.35%	56,811.89	0.35%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	_
国元证券	1	-	-	-	-	_
西南证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券 (沪深)	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	_	-	-
高华证券	- 1	_	_	-	-	-

券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	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
国金证券(沪 深)	119,636.63	100.00%	1,050,000,000.00	8.26%	-	-
银河证券	-	-	450,000,000.00	3.54%	-	-
光大证券	-	-	260,000,000.00	2.05%	-	-
民生证券 (户 深)	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	1	-
国信证券	-	-	894,000,000.00	7.03%	-	-
东兴证券	-	-	750,000,000.00	5.90%	-	-
西部证券	-	-	820,000,000.00	6.45%	-	-
中信建投(沪深)	-	-	650,000,000.00	5.11%	-	-
招商证券	-	-	2,405,400,000.00	18.93%	-	-
齐鲁证券	-	-	354,600,000.00	2.79%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	1,214,300,000.00	9.56%	-	-
平安证券	-	-	-		-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	-	-		-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	3,300,000,000.00	25.97%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	
中银国际	-	-	250,000,000.00	1.97%	-	
山西证券	-	-	-		-	
广发证券	-	-	-	-	-	
中金沪市	-	-	310,000,000.00	2.44%	-	
东方证券	-	-	-	-	-	
兴业证券	-	1	-	-	-	
中金公司	-	-	-	-	-	
渤海证券	-	-	-	-	-	
中投证券	-	-	-	-	-	
华创证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	=	-	-	-	-
西南证券	-	=	-	1	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 (沪 深)	-	=	-	-	-	-
安信证券	-	-	-		-	-
中山证券	-	=	-	1	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

注,本公司租用券商交易带元的选择标准。 (1)基本商股仓结柜中限于资本充足则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进规行为而受到有关管理 纳砂处几主要服实力增大具备发现台运作所需的高级、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金 初時前上海上 面的信息服务。 (2)公司治理公司治理完善股东会,董事会,董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

○公司治理公司允厘定書股东会、董事会、监事会及管理层权费明确。内部管理规范、严格、具备键金的内控制度,并能满足投资组合运作高度增加资金。
(由河宋末方本街应的研究机场和规模是国等的专职研究人员以及研究水平处于产业领先水平的研究员研究覆盖面产,能涵盖宏观经济、行业、个息、债务、缩销等公司编码、标准在并令相关法理及社业规范的前肢下,根据公司的特定要求,提供专题研究检查研究报告应分析严重、规止性、发现并具备存储的风险资讯和股点规范能力。
(相愿者依于AB各交强的国际登记维生动分公司投资组合提供及时的市场信息及各种资值、公司联合调研、券商会议的信息和参加内金、或其基各某一反域的调研服务能力的优势。
(自然会》中格、方中保管规律、各、有效等例如于力能协助本公司特价给介金参加票、债券的分子元产新产品干涉方面经验主发、能帮助公司。 现或再合条一以加引即时服务能了即以实 (约翰全局单位为在投资销售业多上有较强的主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。能帮助公司托限资产管理业务(如00m、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、融资服券、金融期货

等)。
(6)其他因素在某一具体方面的特别优势。
2.本公司和用券商及易单元的程序。
(6)其他因素在某一具体方面的特别优势。
2.本公司和用券商及易单元的程序。
(1)基金的交易年元选转决验应鉴,研产部、金融工程部、投资部签集体讨论后遭阻上述标准填写 藝商选择标准评分表》,并据此提出权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。

公司管理层层域接权内容办理: 但寿能总学权相应的原位租用安排确定信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》第一本负责协调办理正式协 议签署等和长率宜、老宝东签署协议与协议范本不一载的、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、本投资制度基金增租用再定证券交易等工作。