

(上接B301版)

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	561,082.00
2	应收证券清算款	377,765.12
3	应收利息	1,203,934.35
4	应收股利	4,686,089.64
5	应收申购款	226,726.11
6	其他资产	6,318,880.81
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,318,880.81

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	100999	华夏幸福	84,967,965.00	3.46	重大资产重组
2	500027	华信证券	70,235,000.00	3.60	重大资产重组

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	609,599,165.95	66.74
2	固定收益投资	225,595,414.60	24.70
3	其中:债券	225,595,414.60	24.70
4	买入返售金融资产	-	-
5	其中:买断式回购的买入返售	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	71,947,689.84	7.88
7	其他资产	6,318,880.81	0.69
8	合计	913,661,151.20	100.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	2,605,818.80	0.29
B	采矿业	44,624,976.75	5.26
C	制造业	238,602,483.25	28.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	13,029,769.25	1.43
E	建筑业	12,978,073.69	1.98
F	交通运输和仓储业	11,055,814.74	1.22
G	信息技术	10,589,576.28	1.21
H	住宿和餐饮业	20,068,624.30	2.36
I	信息传输、软件和信息技术服务	149,335,720.17	16.42
J	房地产业	27,260,163.89	3.17
K	租赁和商务服务业	6,961,859.02	0.77
L	批发和零售业	59,809,463.53	6.58
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	居民服务、修理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	1,713,275.28	0.19
S	综合	5,963,546.40	0.66
合计		609,599,165.95	67.02

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	300070	碧水源	1,511,000	56,934,706.08	6.28
2	300090	盛运股份	671,478	20,735,240.64	2.36
3	600016	民生银行	2,329,584	19,964,534.88	2.29
4	600036	招商银行	1,467,143	17,018,858.80	1.87
5	002050	豫兴特钢	1,277,310	14,233,040.70	1.60
6	300263	康华药业	834,409	13,709,339.47	1.51
7	600181	东方明珠	348,976	12,130,405.76	1.33
8	002358	嘉瑞电子	902,207	11,918,154.47	1.31
9	601166	兴业银行	793,370	11,718,074.90	1.29
10	300157	东方明珠	314,743	10,883,042.34	1.20

本基金本报告期末未持有权证。

8) 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

本基金未投资股指期货。

2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

9) 基金投资组合报告附注

1) 2013年6月14日豫兴特钢机械股份有限公司发布公告:2013年6月9日,公司董事会2013年第1次临时会议上审议通过《关于公司违法违规事项调查结论报告》编号:豫兴特钢公告【2013-012号】,通知内容如下:甄玉斌,因职务侵占、私藏枪支和内幕交易行为被追究刑事责任;会议决定对公司涉嫌挪用资金罪独立立案调查,请予以配合。

本基金管理人通过对上述行为进行深入了解和分析,认为本基金已经持有该股票的时间较长,主要是基于国家大力支持发展新兴产业的政策,且盛运股份又环保行业中的领先地位,龙头公司,基金管理人长期看好环保行业的发展前景及公司的长期投资价值,根据基金公司规定,高管投资决策是由于个人原因,对公生产经营没有影响,因此,该事项不影响我们对公司长期投资价值的判断。

报告期内,本基金投资的前十名证券中的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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十名资产支持证券明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
7) 基金投资组合报告附注  
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。

10) 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。

11) 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。

12) 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。

13) 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。

14) 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。

15) 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。

16) 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。

17) 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。

18) 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。

19) 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。

20) 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。

21) 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。

2) 基金投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	609,599,165.95	66.74
2	固定收益投资	225,595,414.60	24.70
3	其中:债券	225,595,414.60	24.70
4	买入返售金融资产	-	-
5	其中:买断式回购的买入返售	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	71,947,689.84	7.88
7	其他资产	6,318,880.81	0.69
8	合计	913,661,151.20	100.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	2,605,818.80	0.29
B	采矿业	44,624,976.75	5.26
C	制造业	238,602,483.25	28.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	13,029,769.25	1.43
E	建筑业	12,978,073.69	1.98
F	交通运输和仓储业	11,055,814.74	1.22
G	信息技术	10,589,576.28	1.21
H	住宿和餐饮业	20,068,624.30	2.36
I	信息传输、软件和信息技术服务	149,335,720.17	16.42
J	房地产业	27,260,163.89	3.17
K	租赁和商务服务业	6,961,859.02	0.77
L	批发和零售业	59,809,463.53	6.58
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	居民服务、修理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	1,713,275.28	0.19
S	综合	5,963,546.40	0.66
合计		609,599,165.95	67.02

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	120105	09:20:00	220,600	22,280,600.00	8.82
2	1101032	11:27:00	200,000	20,050,000.00	7.94
3	1080119	10:57:00	200,000	20,032,000.00	7.93
3	100019	10:00:00	200,000	20,032,000.00	7.93
5	122080	11:08:00	164,240	16,864,163.20	6.68

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	120105	09:20:00	220,600	22,280,600.00	8.82
2	1101032	11:27:00	200,000	20,050,000.00	7.94
3	1080119	10:57:00	200,000	20,032,000.00	7.93
3	100019	10:00:00	200,000	20,032,000.00	7.93
5	122080	11:08:00	164,240	16,864,163.20	6.68

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	120105	09:20:00	220,600	22,280,600.00	8.82
2	1101032	11:27:00	200,000	20,050,000.00	7.94
3	1080119	10:57:00	200,000	20,032,000.00	7.93
3	100019	10:00:00	200,000	20,032,000.00	7.93
5	122080	11:08:00	164,240	16,864,163.20	6.68

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

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	130021	13:01:00	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08:01:15	300,000	30,005,000.00	5.50
3	120138	12:01:38	300,000	29,898,000.00	5.20
4	130102	13:01:02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	120218	12:02:18	200,000	19,886,000.00	2.19

公告送出日期:2013年8月24日

	其中:管理过公募基金的名称及期间	基金主代码	基
	是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否	