

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

8.4178%。B类基金的份额净收益率为0.4185%，业绩比较收益率为1.6832%。

4.5 管理人认为宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望：展望2013年下半年，由于金融去杠杆的传导使部分行业或者地区爆发局部性经济，经济增长速度有所回落，企业通胀压力不大。此外，央行采取了微调控的流动性管理手段，在一定程度上加强了其对货币供应量的调控能力，从而对CPI的控制能力也有所增强。当前整体宏观形势比较有利，债券市场，但另一方面，调控结构、降风险的需要使得未来资金面维持一个偏紧的状态，因此市场环境对流动性管理提出更高的要求。本基金仍将保持谨慎投资风格，同时维持较高比例的行业配置，并注重组合利率水平进行配置。债券持仓的期限和流动性综合考虑，进一步优化组合的期限结构，做好组合流动性管理。本基金仍将规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明：本基金估值程序严格按照中国证监会颁布的《证券投资基金估值业务指导意见》的要求，结合基金合同、基金招募说明书及相关法律法规进行估值。报告期内，基金估值程序未发生重大变化，估值程序符合基金合同及相关法律法规的要求。报告期内，基金估值程序未发生重大变化，估值程序符合基金合同及相关法律法规的要求。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明：根据基金合同的约定，本基金收益分配方式为现金分红，以每份基金份额收益为基础，按照投资者持有基金份额的时间，按季进行收益分配。报告期内，本基金共进行了6次基金收益分配，具体情况如下：第1次：2013年1月7日；第2次：2013年2月6日；第3次：2013年3月6日；第4次：2013年4月7日；第5次：2013年5月6日；第6次：2013年6月6日。

5.1 报告期内本基金托管人履职情况说明：报告期内，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本托管人”）在华泰柏瑞货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责履行了应尽的义务。

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：报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的约定，对本基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金净值计算、基金申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核。

5.3 托管人对本半年度报告中基金净值信息的真实、准确和完整发表意见：报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的约定，对本基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金净值计算、基金申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核。

6.1 资产负债表：截至2013年6月30日，本基金资产总额为2,571,459,241.84元，负债总额为1,041,258,214.17元，净资产总额为1,530,201,027.67元。

Table with columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年度末, 2013年6月30日, 2012年12月31日. Rows include 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

6.2 利润表：截至2013年6月30日，本基金利润总额为2,463,501,091.04元，净利润总额为2,463,501,091.04元。

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

6.3 所有者权益变动表：截至2013年6月30日，本基金所有者权益总额为2,463,501,091.04元。

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

Table with columns: 项目, 附注号, 本期, 上年度可比期间, 2013年1月1日至2013年6月30日, 2012年1月1日至2012年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

定期存款和大额存单、短期融资券、剩余期限在397天以内、含397天、的债券、期限在1年以内、含1年、的债券回笼、期限在1年以内、含1年、的中资银行理财产品、剩余期限在397天以内、含397天、的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金业绩比较基准为：当期银行活期存款收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2013年8月26日批准报出。

6.4.2 会计政策的编制基础：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项具体会计准则及其应用指南、企业会计准则解释、企业会计准则应用指南以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。中国注册会计师于2010年5月关于发布《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>》等问题的通知、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》、《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所示的基金行业业务核算等相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他规定的声明：本基金2013年半年度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 重要会计政策和会计估计：6.4.5 会计政策变更的说明：6.4.5.1 会计政策变更的说明：6.4.5.2 会计估计变更的说明：6.4.5.3 差错更正的说明

6.4.6 税项：根据财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知、财税[2005]107号、财税[2005]102号、财税[2008]1号、财税[2008]11号、财税[2009]157号、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》及其他相关法规规定，主要纳税事项如下：

1. 以公允价值计量的金融资产不属于营业税征收范围，不征收营业税。2. 对基金买卖股票产生的差价收入，营业税免征。3. 股权的股息、红利收入其他收入、薪金和劳务报酬等，按有关规定征收个人所得税。

6.4.7 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。

6.4.8 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.1 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.2 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.3 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.4 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.5 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.6 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.7 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.8 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.9 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.10 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.11 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.12 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.13 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.14 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.15 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.16 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.17 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.18 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.19 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.20 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.21 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.22 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.23 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.24 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.25 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.26 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.27 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.28 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.29 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.30 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.31 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.32 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.33 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.34 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.35 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.36 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.37 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.38 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.39 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.40 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.41 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.42 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.43 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.44 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.45 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.46 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.47 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.48 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.49 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.50 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.51 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.52 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.53 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.54 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.55 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.56 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.57 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.58 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.59 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.60 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.61 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.62 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.63 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.64 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.65 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.66 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.67 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.68 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.69 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.70 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.71 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.72 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.73 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.74 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.75 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.76 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.77 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.78 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.79 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.80 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.81 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.82 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.83 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.84 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.85 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.86 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.87 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.88 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.89 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.90 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.91 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.92 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.93 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.94 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.95 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.96 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.97 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.98 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.99 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.100 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.101 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.102 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.103 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.104 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.105 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.106 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.107 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.108 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.109 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.110 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.111 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.112 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.113 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.114 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.115 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.116 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.117 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.118 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.119 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.120 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.121 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.122 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.123 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.124 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.125 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.126 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.127 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.128 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.129 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.130 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.131 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.132 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.133 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.134 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.135 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.136 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.137 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.138 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.139 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.140 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.141 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.142 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.143 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.144 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.145 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.146 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.147 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.148 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.149 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.150 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.151 关联方关系及其交易的认定

6.4.8.152 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.153 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.154 关联方关系及其交易的认定：6.4.8.155 关联方关系及其交易的认定

Table with columns: 关联方名称, 证券代码, 证券名称, 发行方式, 基金在承销期内买入数量(单位:份), 总金额. Rows include 华泰证券股份有限公司, 华泰证券股份有限公司, etc.

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 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

Table with columns: 债券代码, 债券名称, 到期兑付日, 期末估值单价, 数量(张), 期末估值总额. Rows include 090411, 09农发11, etc.

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券正回购截至本报告期内期末(2013年6月30日)止，本基金未持有股票。

6.4.9.4 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券：6.4.9.1 因认购新发及增发证券于期末持有流通受限证券：6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票：6.4.9.3 银行间市场债券