

融通动力先锋股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

2.2 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

本报告期内,融通动力先锋股票型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通动力先锋股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,融通动力先锋股票型证券投资基金未进行利润分配。

2.3 托管人对本半年度报告中财务信息等情况的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通动力先锋股票型证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6.1 资产负债表

会计主体:融通动力先锋股票型证券投资基金
报告截止日: 2013年6月30日

单位:人民币元			
资 产	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	275,453,789.50	182,630,868.98	
结算备付金	10,356,764.00	3,029,907.65	
存出保证金	1,264,020.14	1,750,000.00	
交易性金融资产	1,497,720,975.55	1,634,811,839.96	
其中:股票投资	1,395,696,709.25	1,532,558,430.36	
基金投资	102,024,266.30	102,253,409.60	
债券投资	-	-	
资产支持证券投资	-	-	
衍生金融资产	-	-	
买入返售金融资产	-	-	
应收证券清算款	-	10,917,483.80	
应收利息	2,263,829.41	592,565.52	
应收股利	-	-	
应收申购款	-	-	
递延所得税资产	113,911.22	134,375.15	
其他资产	-	-	
资产总计	1,787,173,289.82	1,833,867,041.06	

单位:人民币元			
负债和所有者权益	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	30,229,643.07	74,095,648.94	
应付赎回款	730,748.12	1,009,257.42	
应付管理人报酬	2,224,354.54	2,068,305.19	
应付托管费	730,725.76	344,717.53	
应付销售服务费	-	-	
应付交易费用	-	-	
应交税费	-	3,767,193.34	
应付利息	-	-	
应付利润	-	-	
递延所得税负债	-	-	
其他负债	-	-	
负债合计	1,455,573.42	1,354,957.17	
负债合计	38,778,238.25	81,505,245.47	
所有者权益:			
实收基金	1,758,390,473.44	1,861,322,722.64	
未分配利润	-9,995,421.87	-108,960,927.05	
所有者权益合计	1,748,395,051.57	1,752,361,795.59	
负债和所有者权益总计	1,787,173,289.82	1,833,867,041.06	

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.994元,基金份额总额1,758,390,473.44份。

6.2 利润表

会计主体:融通动力先锋股票型证券投资基金
本报告期内: 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	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
一、收入	128,532,298.40	108,590,816.64	
1.利息收入	2,351,386.37	3,417,252.57	
2.股利收入	861,694.88	741,460.22	
3.债券利息收入	1,666,450.34	1,675,792.35	
4.其他利息收入	-	-	
5.公允价值变动收益	90,241.15	-	
6.其他收入	-	-	
二、费用	126,300,449.89	44,138,632.41	
1.销售费用	116,609,923.38	-55,639,760.57	
2.管理费用	346,072.39	-	
3.其他费用	-	-	
三、利润总额	9,352,454.22	11,501,128.16	
4.公允价值变动损益	-133,989.36	150,590,340.35	
5.其他收入	6,451.50	72,856.13	
6.其他费用	28,444,718.82	24,951,393.73	
7.其他收入	13,523,261.03	13,838,622.32	
8.其他费用	2,253,876.85	3,306,337.03	
9.其他收入	-	-	
10.其他费用	-	-	
11.其他收入	12,455,555.74	8,598,664.22	
12.其他费用	-	-	
13.其他收入	-	-	
14.其他费用	-	-	
15.其他收入	211,024.82	208,372.16	
16.其他费用	100,087,586.38	83,999,420.91	
17.其他收入	100,087,586.38	83,999,420.91	

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通动力先锋股票型证券投资基金
本报告期内: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	上期 2012年1月1日至2012年6月30日	
一、期初所有者权益(基金净值)	1,861,322,722.64	-108,960,927.05	1,752,361,795.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	100,087,586.58	100,087,586.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回及转换)	-102,932,249.20	-1,122,081.40	-104,054,330.60
四、本期基金投资收益	6,802,410.05	34,010.31	6,836,420.36
五、其他收入	-109,734,639.25	-1,156,091.71	-110,890,730.96
六、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,758,390,473.44	-9,995,421.87	1,748,395,051.57
八、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
九、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回及转换)	-102,932,249.20	-1,122,081.40	-104,054,330.60
十、本期基金投资收益	6,802,410.05	34,010.31	6,836,420.36
十一、其他收入	-109,734,639.25	-1,156,091.71	-110,890,730.96
十二、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
十三、期末所有者权益(基金净值)	1,758,390,473.44	-9,995,421.87	1,748,395,051.57

注:报表附注为本财务报表的组成部分。
本报表 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:
基金管理人 基金托管人
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4.1 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
6.4.2 差错更正的说明
本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。
6.4.3 关联方关系
6.4.3.1 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
本报告期内,本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。
6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

单位:人民币元			
关联方名称	与本基金的关系		
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构		
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构		
新时代证券股份有限公司(“新时代证券”)	基金管理人股东、基金代销机构		
注:下述关联方均在正常业务范围内按一般商业条款订约。			
6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易			
6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易			
6.4.4.1.1 股票交易			

注：上海证监股份有限公司（以下简称“上海证监”）为基金管理人、基金托管机构；新时代证券有限责任公司（以下简称“新时代证券”）为基金管理人股东、基金代销机构			
注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。			
6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易			
6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易			
6.4.4.1.1 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	成交金额 占当期股票 成交总额的比例	

6.4.4.1.2 权证交易
本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。
6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

6.4.4.1 应付关联方佣金

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
新时代证券	43,870.65	0.60%	-	-
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

注:1、上述基金托管费金额计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费和经手费后的净托管费为基数。
2、该托管费协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。
6.4.4.2 基金托管费
单位:人民币元

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	13,325,261.02	13,838,022.32	
其中:支付销售机构客户维护费	2,547,319.12	2,606,755.48	
注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为: 日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。			
6.4.4.2 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	2,253,876.85	2,306,337.03	
注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累			

计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。
6.4.4.4.2 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
本报告期末及上年度末,基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。
6.4.4.5 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	275,453,789.50	531,649.44	217,043,397.42	699,435.12

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
1.本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任主承销商或分销商所承销的证券;
2.本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期承销的股票。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明
本基金无其他关联交易事项的说明。
6.4.5 利润分配情况
本基金本报告期末未进行利润分配。
6.4.6 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.6.1 因认购新发及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	证券简称	成功认购日	可流通日	流通受限原因	认购价	期末市价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末公允价值
600221 海南航空	2012/4/13	2013/8/13	2013/8/13	2013/8/13	非公开发行股票受限	4.07	2.02	7,500,000	30,525,000.00	15,150,000.00
600221 海南航空	2013/6/7	2013/8/13	2013/8/13	2013/8/13	非公开发行股票受限	0.00	2.02	7,500,000	0.00	15,150,000.00
600633 新阳科技	2013/4/24	2014/4/22	2014/4/22	2014/4/22	非公开发行股票受限	13.90	15.25	1,720,000	23,908,000.00	26,230,000.00
002106 莱宝高科	2013/3/18	2014/3/18	2014/3/18	2014/3/18	非公开发行股票受限	16.52	15.35	1,000,000	16,520,000.00	15,350,000.00

注:①基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市之日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。
②本基金于2012年8月13日认购海南航空非公开发行股票,认购数量7,500,000股,认购单价4.07元。2013年6月7日,海南航空实施2012年度股东大会决议每10股转增10股分红方案。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。
6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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	1,395,696,709.25	78.10
	其中:股票	1,395,696,709.25	78.10
2	固定收益投资	102,024,266.30	5.71
	其中:债券	102,024,266.30	5.71
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	285,810,553.50	15.99
6	其他各项资产	6,641,760.77	0.20
7	合计	1,787,173,289.82	100.00

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、业	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	1,014,934,419.02	58.05	-
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	30,300,000.00	1.73	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	194,386,229.25	11.12	-
J 金融业	-	-	-
K 房地产业	43,904,000.00	2.51	-
L 租赁和商业服务业	-	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	85,942,060.98	4.92	-
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	26,230,000.00	1.50	-
S 综合	-	-	-
H 合计	1,395,696,709.25	79.83	-

金额单位:人民币元			
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1 权益投资	1,395,696,709.25	78.10	
其中:股票	1,395,696,709.25	78.10	
2 固定收益投资	102,024,266.30	5.71	
其中:债券	102,024,266.30	5.71	
3 资产支持证券	-	-	
4 买入返售金融资产	-	-	
5 银行存款和结算备付金合计	285,810,553.50	15.99	
6 其他各项资产	6,641,760.77	0.20	
7 合计	1,787,173,289.82	100.00	

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、业	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	1,014,934,419.02	58.05	-
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	30,300,000.00	1.73	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	194,386,229.25	11.12	-
J 金融业	-	-	-
K 房地产业	43,904,000.00	2.51	-
L 租赁和商业服务业	-	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	85,942,060.98	4.92	-
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	26,230,000.00	1.50	-
S 综合	-	-	-
H 合计	1,395,696,709.25	79.83	-

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
1	600535	天士力	1,809,092	70,825