融通内需驱动股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人：融通基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2013年8月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通内需驱动股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2013年8月22日复核了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通内需驱动股票
基金主代码	161611
前端交易代码	161611
后端交易代码	161661
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月22日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	858,268,535.61份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益，实现基金资产可持续的稳定增值。
投资策略	本基金重点投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业，根据经济演进的规律和产业变迁的路径，“自上而下”确定资产配置与行业配置比例，在行业配置下“自下而上”精选个股。本基金股票资产主要投资于治理规范、经营稳健、财务良好和盈利能力强的内需驱动型的优秀公司，但是，只有满足“规范、独特、简单、成长”特性的龙头公司才有可能成为我们的核心资产，对这部分资产，我们将长期持有，充分分享中国经济长期高速增长和企业做大做强所带来的巨大收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	赵会军
	联系电话	(0755)26948666	(010)66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755)26948088	95588
传真		(0755)26935005	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	46,113,037.70
本期利润	41,986,447.48
加权平均基金份额本期利润	0.0631
本期基金份额净值增长率	11.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2464
期末基金资产净值	646,822,729.29
期末基金份额净值	0.754

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益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）减除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润；期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率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	-6.91%	1.86%	-12.66%	1.50%	5.75%	0.36%
过去三个月	1.07%	1.50%	-9.30%	1.17%	10.37%	0.33%
过去六个月	11.87%	1.39%	-9.71%	1.20%	21.58%	0.19%
过去一年	15.29%	1.21%	-7.57%	1.10%	22.86%	0.11%
过去三年	-12.08%	1.44%	-8.83%	1.10%	-3.25%	0.34%
自基金合同生效起至今	-16.03%	1.50%	-10.61%	1.22%	-5.42%	0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2013年6月30日，公司管理的基金共有二十只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；十九只开放式基金，即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健行业股票基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金和融通通泰保本混合基金。其中，融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周珺	本基金的基金经理	2012年1月5日	-	5	硕士研究生，具有基金从业资格。2008年3月至今，就职于融通基金管理有限公司，从事宏观策略研究、行业研究、周期性研究工作。

注：任职日期和离任日期按基金管理人对外披露的任职日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通内需驱动股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年A股再次演绎春季躁动，一季度以地产、证券为主的周期股大幅上涨，顺接了12年底经济见底预期和对改革红利的期待。然而从3月份开始，市场风向突变，中小板、创业板为主的成长股大幅上涨。从格局来说，这两年走势很相像，不同的是，今年走的更极致，在流动性偏宽松的格局下，创业板产然出现牛市的风采，从最早的医药、环保到电子、软件、计算机再到传媒、互联网，热点此起彼伏。回顾整个2013年上半年，在春季躁动之后，煤炭、水泥、有色等个股大幅下跌创出阶段新低，而中小板、创业板多达近50只个股涨幅翻倍，近200只个股创出历史新高。市场已经坦这种走势的巨大差异告诉了结构转型的必要性和重要性。

本基金年初出现了配置上的动摇，但在2月份开始果断将配置重点放在了反映经济转型的成长股上，重点投资医药、环保、油气设备、广告、电子等板块上。先选择市场空间大、政策鼓励的行业，继而选择细分行业中的龙头和业绩反复超预期的新龙头。总体而言，在成长股上涨的第一波中，本基金无论行业配置和个股选择都表现较好。但进入5月份，行情演绎进入第二波后，本基金受限于对估值和业绩的困扰，错失了信息设备、信息服务和手游等行业的投资机会。此外，本基金年初在周期股的波段操作上不是特别成功，造成了不小交易损耗，虽然配置比例不重，但在趋势向下的行业中做波段确实是火中取栗，本基金今后在配置的基础上还是要尽力控制波段操作的损耗。

总体而言，本基金在配置基础上力求把握市场的主要矛盾，以竞争结构良好的传统行业龙头和优质的成长股为组合的主要方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为11.87%，同期业绩比较基准收益率为-9.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来以创业板为主的成长股涨幅远超绝大多数投资者预期，本基金认为主要有两点原因：1、流动性宽松格局下，资金的逐利行为追求市场空间大，想象空间大的标的，而IPO停止和创业板再融资未开刚，使得这种资金博弈行为缺乏对手盘，引起踩风效应；2、更为重要的是，我们认为中国经济新旧经济的转折点越来越近，如果转型成功，创业板中出现数家500亿甚至上千亿市值的公司都是可以期待，这种类似风投的方法在新一届领导层力主改革的声浪下更容易获得市场绝大多数投资者的认同。

从当前创业板指数的走势来看，本基金判断一个牛市资产下跌需要两种信号出现：1、供给的大规模增加，IPO开闸后一到两个大市值创业板公司的高估值发行；2、需求的大规模收缩，流动性预期的改变，这可能需要关注美元走势和房地产博弈下央行的货币政策。

本基金仍会在成长股中保持较大比例，等待供给和需求两方面预期的变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见，参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，风险管理部负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息，基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通内需驱动股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，融通内需驱动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内需驱动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，融通内需驱动股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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内需驱动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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通内需驱动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	87,063,595.07	48,555,557.69
结算备付金	6,056,766.25	2,131,588.94
存出保证金	425,079.16	3,443,250.59
交易性金融资产	546,059,587.09	336,311,437.12
其中：股票投资	516,182,587.09	316,339,437.12
基金投资	-	-
债券投资	29,877,000.00	19,972,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	20,000,150.00	-
应收证券清算款	17,612,177.80	20,000,425.95
应收利息	689,023.30	197,159.88
应收股利	1,093,446.68	-
应收申购款	6,002,981.71	81,591.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	685,002,807.06	410,721,011.97
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	33,636,648.77	-
应付赎回款	781,784.95	250,334.06
应付管理人报酬	795,744.99	484,135.92
应付托管费	132,624.14	80,689.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,198,397.93	1,074,006.09
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	634,876.99	555,313.06
负债合计	38,180,077.77	2,444,478.47
所有者权益：		
实收基金	858,268,535.61	606,105,500.59
未分配利润	-211,445,806.32	-197,828,967.09
所有者权益合计	646,822,729.29	408,276,533.50
负债和所有者权益总计	685,002,807.06	410,721,011.97

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.754元，基金份额总额858,268,535.61元。

6.2 利润表

会计主体：融通内需驱动股票型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

资产	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	52,245,657.15	36,449,565.05
1.利息收入	828,783.98	575,399.09
其中：存款利息收入	293,276.93	229,426.72
债券利息收入	354,248.61	335,158.47
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	181,258.44	10,813.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益	55,439,505.16	-96,234,870.67
其中：股票投资收益	51,914,179.74	-98,298,890.68
基金投资收益	-	-
债券投资收益	125,937.13	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,399,388.29	2,064,020.01
3.公允价值变动收益	-4,126,590.22	132,098,805.23
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	103,958.23	10,231.40
减：二、费用	10,259,209.67	8,289,439.02
1.管理人报酬	3,687,558.91	2,979,429.49
2.托管费	614,593.16	496,571.59
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	5,817,894.82	4,629,959.23
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	139,162.78	183,478.71
三、利润总额	41,986,447.48	28,160,126.03
减：所得税费用	-	-
四、净利润	41,986,447.48	28,160,126.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通内需驱动股票型证券投资基金

本报告期：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		
	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)	606,105,500.59	-197,828,967.09	408,276,533.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,986,447.48	41,986,447.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	252,163,035.02	-55,603,286.71	196,559,748.31
其中：1.基金申购款	404,550,341.50	-90,795,013.28	313,755,328.22
2.基金赎回款	-152,387,306.48	35,191,726.57	-117,195,579.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-		
五、期末所有者权益(基金净值)	858,268,535.61	-211,445,806.32	646,822,729.29
项目	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	623,624,594.15	-243,572,535.48	380,052,058.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,160,126.03	28,160,126.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-7,660,165.37	2,374,710.22	-5,285,455.15
其中：1.基金申购款	20,405,486.93	-7,536,287.61	12,869,199.32
2.基金赎回款	-28,065,652.30	9,910,997.83	-18,154,654.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	615,964,428.78	-213,037,699.23	402,926,729.55

注：后附6.4报表附注为本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：

基金管理公司负责人：奚星华　主管会计工作负责人：朱建华　会计机构负责人：刘美丽

6.4 报表附注

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

本基金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一致。

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

本报告期与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

项目	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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

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管理费	3,687,558.91	2,979,429.49
其中：支付销售机构的客户维护费	871,088.45	772,033.39

注：支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.4.2.2 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	614,593.16	496,571.59

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无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

本报告期及上年度可比期间基金管理人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，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

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 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	
	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	87,063,595.07	226,615.62	50,074,686.67	211,399.76

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

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副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 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/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	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600633	浙报传媒	2013-4-24	2014-4-22	非公开发行	13.90	15.25	410,000	5,699,000.00	6,252,500.00	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300133	华策影视	2013-5-28	重大资产重组	24.43	2013-7-30	26.87	519,880	12,189,733.64	12,700,668.40	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

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	516,182,587.09	75.35
	其中：股票	516,182,587.09	75.35
2	固定收益投资	29,877,000.00	4.36
	其中：债券	29,877,000.00	4.36
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,150.00	2.92
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	93,120,361.32	13.59
6	其他各项资产	25,822,708.65	3.77
7	合计	685,002,807.06	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	329,810,478.72	50.99
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	7,155,600.00	1.11
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	43,127,270.00	6.67
J	金融业	28,348,145.80	4.38
K	房地产业	43,698,481.69	6.76
L	租赁和商务服务业	26,233,470.00	4.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,694,672.48	2.27
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	23,114,468.40	3.57
S	综合	-	-
	合计	516,182,587.09	79.80

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	占基金资产净值比例(%)
1	300058	蓝色光标	629,100	26,233,470.00	4.06
2	000002	万　科A	2,604,381	25,653,152.85	3.97
3	300228	富瑞特装	317,000	25,360,000.00	3.92
4	002236	大华股份	650,000	24,849,500.00	3.84
5	002241	歌尔声学	600,000	21,774,000.00	3.37
6	300273	和佳股份	960,000	20,563,200.00	3.18
7	600535	天士力	494,258	19,350,200.70	2.99
8	300088	长信科技	900,000	18,981,000.00	2.93
9	000651	格力电器	649,969	16,288,223.14	2.52
10	600315	上海家化	350,000	15,746,500.00	2.43
71	002653	海思科	9,969,619.36	2.44
72	002305	南国置业	9,959,093.98	2.44
73	002250	联化科技	9,930,163.59	2.43
74	002477	雏鹰农牧	9,871,042.97	2.42
75	600184	光电股份	9,859,168.60	2.41
76	600315	上海家化	9,717,807.13	2.38
77	600703	三安光电	9,650,047.30	2.36
78	002405	四维图新	9,629,714.63	2.36
79	000400	许继电气	9,557,678.51	2.34
80	300037	新宙邦	9,314,316.54	2.28
81	300197	铁汉生态	9,255,291.09	2.27
82	300090	盛运股份	9,213,777.98	2.26
83	300026	红日药业	9,041,360.60	2.21
84	002550	千红制药	8,918,816.92	2.18
85	600804	鹏博士	8,761,618.00	2.15
86	002385	大北农	8,654,795.03	2.12
87	300274	阳光电源	8,624,072.42	2.11
88	600518	康美药业	8,518,343.11	2.09
89	000002	万　科A	8,515,053.14	2.09
90	300072	三聚环保	8,393,591.01	2.06
91	600372	中航电子	8,341,539.98	2.04
92	600880	博瑞传播	8,316,793.03	2.04
93	300083	劲胜股份	8,187,601.52	2.01

注：“买出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,029,243,698.55
卖出股票收入(成交)总额	1,877,287,648.10

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	29,877,000.00	4.62
	其中：政策性金融债	29,877,000.00	4.62
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	29,877,000.00	4.62

7.6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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120238	12国开38	200,000	19,932,000.00	3.08
2	130201	13国开01	100,000	9,945,000.00	1.54

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截止本报告期末，本基金未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

7.10.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	425,079.16
2	应收证券清算款	17,612,177.80
3	应收股利	1,093,446.68
4	应收利息	689,023.30
5	应收申购款	6,002,981.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,822,708.65

7.10.4 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。

7.10.5 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
20,441	41,987.60	182,005,767.54	21.21%	676,262,768.07	78.79%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,020,948.56	0.1190%

注：1.本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间：10-50万份（含）；

2.本报告期末本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间：0。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年4月22日）基金份额总额	2,955,174,216.52
本报告期期初基金份额总额	606,105,500.59
本报告期基金总申购份额	404,550,341.50
减：本报告期基金总赎回份额	152,387,306.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	858,268,535.61

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币