

通乾证券投资基

【2013】半年度报告摘要

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总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,符合相关法律法规及基金合同的规定。

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况说明
本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关的规定,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法、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确和完整发表意见
本托管人复核审查了本报告中的财务信息内容的真实性、准确和完整发表意见,认为报告中的财务数据真实、准确、完整。

6.1 资产负债表
会计主体:通乾证券投资基
报告截止日:2013年6月30日

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
银行存款	201,178,365.55	26,433,352.63
结算备付金	13,438,319.14	6,384,176.22
存出保证金	1,029,407.10	1,924,714.39
交易性金融资产	1,879,148,305.35	1,969,647,201.85
其中:股票投资	1,425,178,305.35	1,544,822,201.85
基金投资	-	-
债券投资	453,970,000.00	424,825,000.00
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	-	46,881,310.62
应收利息	4,497,438.19	8,339,935.66
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,099,291,835.33	2,059,610,691.37

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	27,678,500.95	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,637,578.05	2,452,527.40
应付托管费	439,596.34	408,754.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,719,053.75	2,210,564.78
应交税费	1,830,675.94	1,830,675.94
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,234,462.40	1,094,500.00
负债合计	37,539,867.34	7,997,022.67
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	61,751,967.90	51,613,668.70
所有者权益合计	2,061,751,967.90	2,051,613,668.70
负债和所有者权益总计	2,099,291,835.33	2,059,610,691.37

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0309元,基金份额总额2,000,000,000.00份。

6.2 利润表
会计主体:通乾证券投资基
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

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	39,390,802.50	61,095,887.55
1.利息收入	8,200,294.07	7,817,125.90
其中:存款利息收入	365,981.73	429,658.21
债券利息收入	7,559,866.17	7,296,214.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	274,446.17	91,253.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益	132,422,335.12	-67,282,277.26
其中:股票投资收益	125,623,453.08	-73,576,143.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	328,839.63	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,470,042.41	6,293,866.03
3.公允价值变动收益	-101,231,826.69	120,537,928.69
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	-	23,110.22
减:二、费用	29,252,053.30	22,459,034.70
1.管理人报酬	15,916,636.42	14,834,228.53
2.托管费	2,652,772.73	2,472,371.38
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,438,253.57	4,912,063.20
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	244,840.58	240,371.59
三、利润总额	10,138,299.20	38,636,852.85
减:所得税费用	-	-
四、净利润	10,138,299.20	38,636,852.85

6.3 所有者权益 基金净值 变动表
会计主体:通乾证券投资基
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

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	39,390,802.50	61,095,887.55
1.利息收入	8,200,294.07	7,817,125.90
其中:存款利息收入	365,981.73	429,658.21
债券利息收入	7,559,866.17	7,296,214.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	274,446.17	91,253.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益	132,422,335.12	-67,282,277.26
其中:股票投资收益	125,623,453.08	-73,576,143.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	328,839.63	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,470,042.41	6,293,866.03
3.公允价值变动收益	-101,231,826.69	120,537,928.69
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	-	23,110.22
减:二、费用	29,252,053.30	22,459,034.70
1.管理人报酬	15,916,636.42	14,834,228.53
2.托管费	2,652,772.73	2,472,371.38
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,438,253.57	4,912,063.20
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	244,840.58	240,371.59
三、利润总额	10,138,299.20	38,636,852.85
减:所得税费用	-	-
四、净利润	10,138,299.20	38,636,852.85

6.4 所有者权益 基金净值 变动表
会计主体:通乾证券投资基
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

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、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	51,613,668.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,138,299.20	10,138,299.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-	-
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)	2,000,000,000.00	61,751,967.90

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、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-23,188,484.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,636,852.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-	-
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)	2,000,000,000.00	15,448,368.69

报表附注为财务报表的重要组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注
6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本报告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1月1日至2013年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.2 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。

6.4.3 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。

6.4.4 关联方关系
6.4.4.1 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。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金发起人
中国建设银行	基金托管人
陕西国际信托股份有限公司(陕西国投)	基金发起人

注:下述关联交易均在日常业务范围内按照一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.5.1.1 股票交易
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股票交易。

6.4.5.1.2 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。

6.4.5.1.3 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无应支付关联方的交易佣金。

6.4.5.2 关联方报酬
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	15,916,636.42	14,834,228.53
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

6.4.5.2.1 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	2,652,772.73	2,472,371.38

注:支付基金托管人中国建设银行的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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.5.3 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。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
份额单位:份

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
基金合同生效日(2013年8月29日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末基金份额比例	0.50%	0.50%

注:基金管理人投资本基金的交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

6.4.5.4.2 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
份额单位:份

关联方名称	持有本基金份额	持有本基金比例
陕国投	5,000,000.00	0.25%

6.4.5.5 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
中国建设银行	201,178,365.55	301,359.53

注:本基金银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
1.本基金本报告期及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承销商或分销商所承销的证券;

2.本基金本报告期及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)在承销期内承销的证券。

6.4.5.7 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。

6.4.6 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/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

证券代码	证券名称	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
002106	莱宝高科	2013-3-18	非公开发行	16.52	15.35	2,000,000	33,040,000.00	30,700,000.00	-
600633	新华百货	2013-4-24	非公开发行	13.90	15.03	1,710,000	23,769,000.00	25,701,300.00	-

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的股票。

6.4.6.3 期末债券正回购交易作为流动受限的债券
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。

6.4.6.3.3 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.4 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.5 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.6 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.7 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.8 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.9 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.10 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.11 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.12 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.13 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.14 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.15 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.16 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.17 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.18 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.19 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.20 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.21 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.22 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.23 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.24 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.25 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.26 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.27 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.28 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.29 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.30 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.31 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.32 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.33 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.34 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.35 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.36 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.37 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.38 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.39 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.40 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.41 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.42 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.43 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.44 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.45 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.46 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.47 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.48 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.49 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6.3.50 其他交易品种债券正回购
本基金本报告期末未持有因从事其他交易品种债券正回购交易而作为抵押的债券。