基金管理人：诺安基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
送出日期：2013年8月27日

诺安保本混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月23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	诺安保本混合
基金主代码	320015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月13日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,465,903,463.70份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术运作，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，通过安全资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳健增长。
投资策略	本基金通过固定比例投资组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）策略和时间不变性投资组合保险（TIPP，Time Invariant Portfolio Protection）策略，在未来三年保本周期中，对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整，确保投资者的投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的收益资产投资策略，竭力为基金资产获取更高的增值回报。 本基金的投资策略由四部分组成：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	本基金保本周期是自基金合同生效日起三年，其流动性与银行三年期定期存款相似，因此本基金的业绩比较基准为：与保本期同期限的三年期银行定期存款税后收益率。 如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。

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		诺安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	张燕
	联系电话	0755-83026688	0755-83199084
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	yan_zhang@cmnchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95555
传真		0755-83026677	0755-83195210

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	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§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	27,942,266.32
本期利润	14,241,876.79
加权平均基金份额本期利润	0.0088
本期基金份额净值增长率	0.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	104,848,500.95
期末基金资产净值	1,570,751,964.65
期末基金份额净值	1.072

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人申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）扣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 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

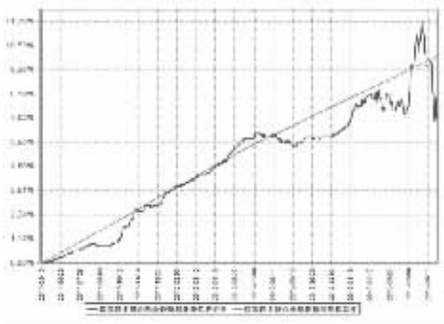
3.2 基金净值表现

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	-3.77%	0.52%	0.35%	0.02%	-4.12%	0.50%
过去三个月	-0.56%	0.38%	1.07%	0.01%	-1.63%	0.37%
过去六个月	0.56%	0.30%	2.14%	0.02%	-1.58%	0.28%
过去一年	1.13%	0.21%	4.31%	0.01%	-3.18%	0.20%
自基金合同生效起至今	7.20%	0.15%	10.02%	0.01%	-2.82%	0.14%

注：本基金的业绩比较基准为：与保本期同期限的三年期银行定期存款税后收益率。

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

截至2013年8月27日，本基金管理人共管理二十八只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张乐赛	固定收益部总监、诺安货币市场基金基金经理、诺安保本混合型证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理	2011年5月13日	-	8	硕士，具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心；2004年12月加入诺安基金管理有限公司，现任固定收益部总监。曾于2009年8月至2012年1月担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理。2006年8月起担任诺安货币市场基金的基金经理，2011年5月起担任诺安保本混合型证券投资基金的基金经理，2012年5月起担任诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间，诺安保本混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据 时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司对不同投资组合不同时间区间（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了分析，未发现投资组合之间存在违反公平交易原则的异常情况。此外，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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年上半年经济增速小幅下滑，CPI低位徘徊，政策面相对平稳，央行以灵活的公开市场操作来平滑资金的流动性，一季度资金面相对宽松，但进入二季度资金面逐步紧张，尤其是在半年底资金面出现了罕见的紧张状况，资金利率大幅飙升，债市和股市都是先扬后抑，资金面成为了决定市场的重要因素。面对如此市场环境，诺安保本混合型证券投资基金以高评级信用债为主要投资对象，注重久期的匹配，同时灵活控制股票仓位，谨慎参与股票二级市场，严格按照保本策略来操作，取得了较为理想的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.072元。本报告期基金份额净值增长率为0.56%，同期业绩比较基准收益率为2.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年下半年，经济难有起色，通胀仍会保持低位，资金面将维持紧平衡的状态，资金利率中枢将会有所提升，货币政策放松的概率不大，仍是稳字当头，债市和股市都会有波段操作的机会。下一阶段，诺安保本混合型证券投资基金将保持适度的债券仓位，做好久期的匹配，加强流动性的管理，适当参与股票市场，严格按照保本策略来操作，继续做好保本垫的积累。

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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，年度基金收益分配比例不得低于年度基金可分配收益的20%；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

§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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：诺安保本混合型证券投资基金

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	23,563,188.09	34,703,692.39
结算备付金	1,534,275.32	61,142.99
存出保证金	349,851.18	250,000.00
交易性金融资产	1,829,277,016.10	1,577,515,989.94
其中：股票投资	261,122,018.67	841,753.95
基金投资	-	-
债券投资	1,568,154,997.43	1,576,674,235.99
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	244,197,451.93
应收证券清算款	-	-
应收利息	37,531,783.38	27,313,351.40
应收股利	-	-
应收申购款	8,203.41	12,942.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,892,264,317.48	1,884,054,570.91
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	312,239,144.63	-
应付证券清算款	-	5,169,920.46
应付赎回款	6,590,361.61	1,953,450.18
应付管理人报酬	1,613,192.03	1,925,270.51
应付托管费	268,865.35	320,878.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	393,289.00	18,450.34
应交税费	-	-
应付利息	145,637.63	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	261,862.58	473,852.28
负债合计	321,512,352.83	9,861,822.17
所有者权益：		
实收基金	1,465,903,463.70	1,758,873,472.29
未分配利润	104,848,500.95	115,319,276.45
所有者权益合计	1,570,751,964.65	1,874,192,748.74
负债和所有者权益总计	1,892,264,317.48	1,884,054,570.91

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.072元，基金份额总额1,465,903,463.70份。

6.2 利润表

会计主体：诺安保本混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	31,448,251.74	87,197,371.73
1.利息收入	30,029,193.63	48,861,613.31
其中：存款利息收入	494,113.15	4,337,880.42
债券利息收入	28,705,704.15	41,884,045.79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	829,376.33	2,639,687.10
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	13,946,865.15	13,127,029.87
其中：股票投资收益	-7,119,447.41	-1,028,361.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	18,758,439.52	14,135,144.49
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,307,873.04	20,247.33
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-13,700,389.53	23,520,394.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,172,582.49	1,688,334.37
减：二、费用	17,206,374.95	16,908,533.96
1.管理人报酬	10,482,082.87	13,898,683.99
2.托管费	1,747,013.85	2,316,447.37
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,442,752.34	112,200.69
5.利息支出	3,296,974.11	347,237.25
其中：卖出回购金融资产支出	3,296,974.11	347,237.25
6.其他费用	237,551.78	233,964.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	14,241,876.79	70,288,837.77
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	14,241,876.79	70,288,837.77

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安保本混合型证券投资基金

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)	1,758,873,472.29	115,319,276.45	1,874,192,748.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,241,876.79	14,241,876.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-292,970,008.59	-24,712,652.29	-317,682,660.88
其中：1.基金申购款	3,223,952.51	259,269.73	3,483,222.24
2.基金赎回款	-296,193,961.10	-24,971,922.02	-321,165,883.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,465,903,463.70	104,848,500.95	1,570,751,964.65
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)	2,381,233,185.48	68,371,281.14	2,449,604,466.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,288,837.77	70,288,837.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-317,431,422.44	-14,458,930.27	-331,890,352.71
其中：1.基金申购款	28,958,853.25	1,384,751.88	30,343,605.13
2.基金赎回款	-346,390,275.69	-15,843,682.15	-362,233,957.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,063,801,763.04	124,201,188.64	2,188,002,951.68

报表附注为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：

_____奥成文_____ _____薛有为_____ _____薛有为_____

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 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期无差错更正。

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

本基金本报告期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

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记机构、销售机构
招商银行股份有限公司	托管人、代销机构

注：下述关联方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

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股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及其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

本基金本报告期及其上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

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	10,482,082.87	13,898,683.99
其中：支付销售机构的客户维护费	4,499,294.50	6,041,891.03

注：① 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提，计算方法如下：

H=E×1.20%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

② 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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	1,747,013.85	2,316,447.37

注：①基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

②基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支取。

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与关联方无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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人没有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除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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
招商银行股份有限公司	23,563,188.09	467,161.96	26,663,453.83	200,614.87

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

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。

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

本基金本报告期末不存在因认购新发或增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2013年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为312,239,144.63元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1182042	11京投MTN1	2013年7月1日	100.10	100,000	10,010,000.00
1182120	11京投MTN2	2013年7月1日	100.01	500,000	50,005,000.00
1182111	11沪国盛MTN2	2013年7月1日	99.99	800,000	79,992,000.00
1182214	11徐工MTN1	2013年7月5日	101.44	650,000	65,936,000.00
1182158	11国药控MTN1	2013年7月5日	99.92	400,000	39,968,000.00
1182223	11国药控MTN2	2013年7月5日	101.55	700,000	71,085,000.00
1182237	11中生物MTN1	2013年7月5日	102.64	170,000	17,448,800.00
合计				3,320,000	334,444,800.00

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0.00元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§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	261,122,018.67	13.80
	其中：股票	261,122,018.67	13.80
2	固定收益投资	1,568,154,997.43	82.87
	其中：债券	1,568,154,997.43	82.87
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	25,097,463.41	1.33
6	其他各项资产	37,889,837.97	2.00
7	合计	1,892,264,317.48	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	114,883,407.30	7.31
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	146,238,611.37	9.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	261,122,018.67	16.62

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	603000	人民网	1,686,919	74,072,613.29	4.72
2	000503	海虹控股	5,125,426	72,165,998.08	4.59
3	002426	胜利精密	5,006,889	64,588,868.10	4.11
4	000012	南 玻A	3,501,056	32,454,789.12	2.07
5	000748	长城信息	1,399,968	12,823,706.88	0.82
6	002031	巨轮股份	895,722	5,016,043.20	0.32

注：本基金本报告期末仅持有上述股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000503	海虹控股	75,255,090.50	4.02
2	603000	人民网	72,448,935.40	3.87
3	002426	胜利精密	58,468,620.96	3.12
4	002269	美邦服饰	49,899,483.34	2.66
5	600030	中信证券	46,193,537.95	2.46
6	000012	南 玻A	39,999,586.73	2.13
7	601901	方正证券	39,508,431.60	2.11
8	000090	深 天 健	34,774,651.27	1.86
9	000001	平安银行	34,066,463.76	1.82
10	600837	海通证券	30,130,725.06	1.61
11	000748	长城信息	26,245,516.72	1.40
12	600872	中炬高新	24,999,060.21	1.33
13	600118	中国卫星	21,904,488.87	1.17
14	601318	中国平安	19,893,550.45	1.06
15	600016	民生银行	19,848,354.17	1.06
16	300233	金城医药	17,792,924.95	0.95
17	601788	光大证券	14,999,178.80	0.80
18	000918	嘉凯城	6,801,365.31	0.36
19	002031	巨轮股份	6,592,513.92	0.35
20	601169	北京银行	5,580,405.00	0.30

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	45,585,420.33	2.43
2	601901	方正证券	41,099,049.74	2.19
3	002269	美邦服饰	37,636,265.91	2.01
4	000090	深 天 健	36,404,855.71	1.94
5	000001	平安银行	32,483,821.38	1.73
6	600837	海通证券	31,340,748.02	1.67
7	600872	中炬高新	27,909,611.91	1.49
8	600016	民生银行	21,404,345.69	1.14
9	601318	中国平安	20,566,411.26	1.10
10	300233	金城医药	19,930,881.14	1.06
11	600118	中国卫星	19,505,043.30	1.04
12	601788	光大证券	13,609,883.26	0.73
13	000748	长城信息	10,224,591.46	0.55
14	002426	胜利精密	10,054,720.93	0.54
15	000918	嘉凯城	5,534,857.02	0.30
16	601169	北京银行	5,298,621.14	0.28
17	002463	沪电股份	4,890,871.68	0.26
18	600858	银座股份	776,011.32	0.04

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

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	650,402,668.04
卖出股票收入(成交)总额	384,256,011.20

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	109,945,000.00	7.00
	其中：政策性金融债	109,945,000.00	7.00
4	企业债券	69,972,000.00	4.45
5	企业短期融资券	311,263,000.00	19.82
6	中期票据	916,821,000.00	58.37
7	可转债	160,153,997.43	10.20
8	其他	-	-
9	合计	1,568,154,997.43	99.83

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	120228	12国开28	1,100,000	109,945,000.00	7.00
2	1182214	11徐工MTN1	800,000	81,152,000.00	5.17
3	1182111	11沪国盛MTN2	800,000	79,992,000.00	5.09
4	1182079	11中石油MTN1	800,000	79,808,000.00	5.08
5	1182223	11国药控MTN2	700,000	71,085,000.00	4.53

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投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在