

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年八月二十八日

1 重要提示及目录

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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月27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。

本报告期内基金未发生审计。
本报告期内基金未发生审计。
本报告期内基金未发生审计。

2.1 基金基本情况	
基金简称	新华中小市值优选股票
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月28日
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	302,865,076.88份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	在有效控制风险的前提下,精选各行业中具有成长性且价格合理的中小市值股票进行投资,力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金以合理价格成长选股策略(CARP)为核心,精选各行业中具有成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险收益品种,预期风险和收益均高于混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人	
项目	基金管理人 基金托管人
名称	新华基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司
姓名	齐岩 田青
联系电话	010-88423386 010-67595096
电子邮箱	qianf@nfcfund.com.cn tiangqing_ld@ccb.com
客户服务电话	4008198866 010-67595096
传真	010-88423310 010-66275865

2.4 信息披露方式	
登载基金半年度报告正文的互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

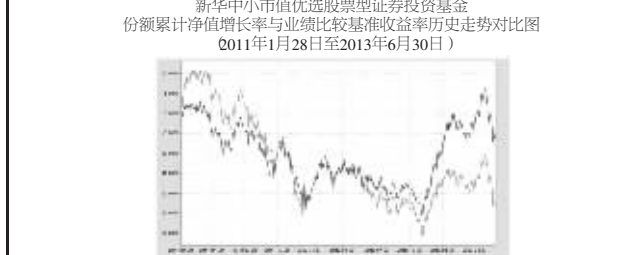
3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要会计数据和财务指标	金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	65,308,018.32
本期利润	40,387,029.25
加权平均基金份额本期利润	0.1036
本期基金份额净值增长率	8.74%
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	-0.0543
期末基金资产净值	286,408,900.81
期末基金份额净值	0.946

注:1、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;2、以上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(例如基金申购费、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。
3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低值(即期末未实现,不是当期发生数)。
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	份额净值增长率比较基准②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去一个月	-10.33%	1.46%	-12.48%	1.55%	2.15%	-0.09%
过去三个月	-0.42%	1.17%	-5.85%	1.21%	5.43%	-0.04%
过去六个月	8.74%	1.23%	-2.58%	1.17%	11.32%	0.06%
过去一年	13.98%	1.13%	-5.12%	1.14%	19.10%	-0.01%
自基金成立起至今	-5.40%	1.14%	-22.53%	1.17%	17.13%	-0.03%

注:1、本基金业绩投资部分的业绩比较基准采用中证700指数收益率,债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率,复合业绩比较基准为80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率。
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。
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



注:本基金于 2011年1月28日基金合同生效。

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

新华基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批复,于2004年12月9日注册成立。注册地为重庆市,是我国西部首家基金管理公司。

截至2013年6月30日,新华基金管理有限公司旗下管理着十只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华资源优选灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮动股票型证券投资基金、新华中小市值优选股票型证券投资基金、新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金和新华行业轮动灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理、基金经理助理、基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理任期		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桂秋源	本基金基金经理、新华资源优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2011-07-12	-	6	工学、金融学双硕士,历任中国石化石油化工科学研究院工程师,于2007年加入新华基金管理公司,历任行业、有色、轻工、建材等行业分析助理,策略分析师,新华优选成长股票型证券投资基金基金经理助理,投资助理,现任新华资源优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华中小市值优选股票型证券投资基金基金经理。

注:1、首任基金经理,任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司作出决定之日。
2、非首任基金经理,任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。
3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。
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,新华基金管理有限公司作为新华中小市值优选股票型证券投资基金的管理人,按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中小市值优选股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,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持有人谋求最大利益,运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。
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
根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》,制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。
场内交易,投资指令统一由中央交易室下达,并且由交易系统公平交易模块,根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方进行交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。
场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,中央交易室根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配;如有异议,由中央交易室报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会,对公平交易的结果进行评估和审议。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中央交易室下达投资指令,中央交易室向银行间市场或交易所进行对手询价,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。
4.3.2 异常交易的专项说明
本报告期内,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率率本的采集,通过平均溢价率、买入溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情形,发现重大异常情形,且不存在报告期内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年上半年权重重股,中期表现不佳,而创业板、题材概念股持续走高。本基金年初持有的环保概念股表现较好,带动基金业绩走强。后期传媒、信息服务类个股反复走强,而它们不在其中,基金业绩有所滑落。如何在有泡沫的市场中进行投资,是需要我们认真思考的问题。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.946元,本报告期份额净值增长率为8.74%,同期业绩比较基准增长率为-2.58%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
未来一段时间,稳增长+托底”将不断交替。我们认为市场上空空间不大。由于概念性的品种上半年表现过于突出,我们对看好低估值品种的投资机会。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
4.6.1 有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工
4.6.1.1 估值工作小组的职责分工
公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、基金管理部、中央交易室、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。
估值工作小组职责:
① 制定估值制度并在必要时修改;
② 确保估值方法符合现行法规;
③ 批准证券估值的方法和程序;
④ 对异常估值做出决策。
运作保障部负责人是估值工作小组的组长,运作保障部负责人在基金会计或者其两个估值授权人员(估值工作小组)的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。
估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。
4.6.1.2 基金会计的职责分工
基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司基金管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后,基金会计定期将证券估值向估值工作小组报告,至少每月一次。
基金会计职责:
① 获得独立、完整的证券价格信息;
② 每日证券估值;

新华中小市值优选股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;
 - ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;
 - ⑤ 对每日证券价格和估值结果进行记录;
 - ⑥ 对估值调整和人工作记录;
 - ⑦ 向估值工作小组提供月度估值报告。
- 基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。
4.6.1.3 基金管理部的职责分工
① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的询问;
② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;
③ 评价并确认基金会计提供的估值报告;
④ 向估值工作小组报告任何他确认认为可能的估值偏差。
4.6.1.4 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;
② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;
③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。
4.6.1.5 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;
③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;
④ 评价估值估值方法是否恰当或违反证券公允价格的法规;
⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部询问;
⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
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
本报告期内,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信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,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 报告期内,本基金未实施利润分配。
5.4 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见
本托管人复核了本报告期内基金管理人提供的估值报告、基金会计报告、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。

6 半年度财务会计报告 (未经审计)	
6.1 资产负债表	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	50,215,372.28	43,598,010.69
结算备付金	389,366.12	594,057.42
存出保证金	177,427.66	-
交易性金融资产	190,967,710.04	294,974,773.94
其中:股票投资	190,967,710.04	294,974,773.94
基金投资	-	-
债券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	62,900,000.00	30,000,000.00
应收证券清算款	-	2,250,639.43
应收利息	64,054.83	37,225.71
应收股利	-	-
应收申购款	4,538.71	28,080.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	304,718,469.64	371,482,788.05

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	-	-
应付账款	-	-
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	16,287,594.83	-
应付赎回款	142,189.81	207,833.95
应付管理人报酬	374,287.52	433,137.60
应付托管费	62,381.28	127,189.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	854,560.19	364,170.53
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	588,555.20	680,558.19
负债合计	18,309,568.83	1,757,889.87
所有者权益:		
实收基金	302,865,076.88	424,788,914.82
未分配利润	-16,456,176.07	-55,064,016.64
所有者权益合计	286,408,900.81	369,724,898.18
负债和所有者权益总计	304,718,469.64	371,482,788.05

注:报告期末2013年6月30日,基金份额净值0.946元,基金份额总额302,865,076.88份。

6.2 利润表	
会计主体:新华中小市值优选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	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	45,119,448.44	13,058,053.92
1.利息收入	688,907.11	254,940.40
其中:存款利息收入	331,891.32	254,940.40
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	357,015.79	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	69,280,962.84	-44,109,316.96
其中:股票投资收益	68,023,603.19	-46,029,903.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,257,359.65	1,920,586.79
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-24,920,989.07	56,869,098.78
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	70,567.56	43,331.70
减:一、费用	4,732,419.19	4,709,228.28
1.管理人报酬	2,790,672.54	3,028,246.78
2.托管费	465,112.13	504,707.79
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,272,955.89	974,249.26
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	203,678.63	202,024.45
二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	40,387,029.25	8,348,825.64
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	40,387,029.25	8,348,825.64

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:新华中小市值优选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

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)	424,788,914.82	-55,064,016.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	40,387,029.25
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-121,923,837.94	-1,779,188.68
其中:1.基金申购款	29,772,888.29	-822,276.03
2.基金赎回款	-151,696,726.23	-956,912.65
四、本期期间基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	302,865,076.88	-16,456,176.07

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	495,000,975.18	-91,356,572.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,348,825.64
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-39,025,585.99	5,503,856.96
其中:1.基金申购款	16,824,113.58	-2,383,451.42
2.基金赎回款	-55,849,699.57	7,887,308.38
四、本期期间基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	455,975,389.19	-77,503,890.33

本报附注为财务报表的组成部分。
本本报6.1.8、财务报表由下列负责人签署:
基金管理人公司负责人:陈勇,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐瑞峰

6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况
新华中小市值优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)“证监许可[2010]1403号文件”关于核准新华中小市值优选股票型证券投资基金募集的批复,由新华基金管理有限公司作为发起人,于2011年1月4日至2011年1月4日向社会公开募集,首次募集资产总额742,965,884.43元,其中募集资产认购资金金额742,773,420.20元,募集资产产生利息192,464.23元,并经国富浩华会计师事务所有限公司验资签字[2011]第1号验资报告予以验证。2011年1月28日办理基金备案手续,基金

合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华中小市值优选股票型证券投资基金招募说明书》及《新华中小市值优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券、资产支持证券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%,其中中小市值股票投资占基金股票资产的比例不低于80%。债券投资占基金资产的比例范围为0-40%。资产支持证券投资占基金资产净值比例范围为70-20%,权证投资占基金资产净值比例范围为0-3%。现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理有限公司于2013年8月28日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础
本基金会计核算以持续经营为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”),中国证券投资基金业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华中小市值优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 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的情况
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。

6.4.5 会计政策变更的说明
本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明
本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明
本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]111号文《关于调整证券(股票)交易印花税征收方式的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号文《关于上市公司股息红利个人所得税政策补充通知》、自2008年4月24日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

① 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

② 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和印花税。

③ 基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

④ 基金买卖股票于2008年4月24日前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起按0.1%的税率缴纳。经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从2008年9月19日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将现行的对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据按0.1%的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据的出让按0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

⑤ 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 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
本报告期内本基金不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。

6.4.7.2 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
新华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.8.1.1 股票交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行股票交易。
6.4.8.1.2 权证交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。
6.4.8.1.3 债券交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。
6.4.8.1.4 债券回购交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。
6.4.8.1.5 支付关联方的佣金
本报告期及上年度可比期间,本基金未与关联方支付关联方的佣金。
6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费

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	2,790,672.54	3,028,246.78
其中:支付销售机构的客户维护费	1,391,730.34	1,504,143.98

注:基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提,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。
本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额,上年度可比期间列示的支付销售机构的客户维护费为当期支付金额。

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销售费	465,112.13	504,707.79

注:基金销售费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提确认。
其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。
6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场交易的各关联方交易
本报告期及上年度可比期间,本基金未与关联方进行银行间债券(含回购)交易。
6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。
6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
报告期末,除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。
6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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	50,215,372.28	321,583.61
期末余额	321,583.61	44,356,478.13
当期利息收入	-	251,550.16

6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本基金在报告期内未参与关联方承销证券。
6.4.9 期末本基金持有的公允价值受限资产的情况
6.4.9.1 因认购未缴足证券及于期末持有的公允价值受限证券
本报告期末本基金未持有因认购未缴足证券而公允价值受限的证券。
6.4.9.2 期末未缴足的暂时停牌等公允价值受限资产

股票代码	股票名称	停牌日期	期末公允价值	数量(股)	期末公允价值	期末公允价值	备注
601886	江河创建	2013-06-20	12,200,000.00	13,78	1,244,940	13,423,019.97	15,188,268.00
300094	银信证券	2013-06-21	21,000,000.00	21.00	-	238,035	4,119,474.33

6.4.9.3 期末债券公允价值变动情况
6.4.9.3.1 银行间市场债券公允价值
本基金报告期内未发生银行间市场债券