

10			-	
----	--	--	---	--

11				
----	--	--	--	--

12			-	-
13			-	-
14			-	-
15			-	-
16			-	-
17			-	-
18			-	-
19			-	-
20			-	-
<b>累入金額”財政赤字の交際費、社交費、娯楽門下交際費、特別、不孝、娯楽、慈善、慈善田</b>				

7.5.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细				金额单位:人民币
序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产 净值比例(%)
1	COME ELECTRICAL APPLIANCES	493 HK	9,862,130.25	2.63
2	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	8,832,639.47	2.36

3	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	5,461,329.89	1.46
4	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	2,715,770.42	0.72
5	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	POT US	1,789,008.19	0.48
6	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	1,472,029.52	0.39
7			--	--
8			--	--
9			--	--
10			--	--
11			--	--
12			--	--
13			--	--
14			--	--
15			--	--
16			--	--
17			--	--
18			--	--
19			--	--
20			--	--

注：卖出金额=按买卖成交金额×按买入价/卖出成交金额×期间，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入/卖出金额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本(成交)总额	14,466,705.34
卖出收入(成交)总额	30,132,907.74

注：买入成本、卖出收入均按买卖成交金额×成交单价/卖出成交金额×期间，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	RYDEX S&P EQUAL WEIGHT ETF	ETP基金	契约开放式	Guggenheim Funds Distributors, LLC.	34,085,212.46	11.39

2	PIMCO TOTAL RETURN ETF	ETF基金 契约型开 放式	PIMCO Investments LLC.	29,258,734.12	9.78
3	VANGUARD INTERMEDIATE-TERM B	ETF基金 契约型开 放式	The Vanguard Group, Inc.	26,473,131.29	8.85
4	SELECTOR IVY ASSET STRGY-C5	ETF基金 契约型开 放式	Lemuria Asset Management Luxembourg	22,164,398.66	7.41
5	HANG SENG H-SHARE	ETF基金 契约型开 放式	Hang Seng Investment	20,708,991.82	6.92

	INDEX ETF		開放式	Management Ltd.			
6	SPDR S&P DIVIDEND ETF	ETF基金	契約型開放式	State Street Global Advisors Inc.	17,983,538.86		6.01
7	CHINAAMC CSI 300 IDX ETF-CNY	ETF基金	契約型開放式	China Asset Management (Hong Kong) Limited	15,047,701.74		5.03
	WISDOMTREE JAPAN		開放式	WISDOMTREE Asset			

8	WISDOMTREE JAPAN HEDGED EQ	ETF基金	契约型开 放式	WisdomTree Asset Management Inc.	9,891,548.80	3.31
9	TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR	ETF基金	契约型开 放式	State Street Global Advisors Inc.	8,919,645.46	2.98
10	SPDR S&P EMERGING LATIN AMER	ETF基金	契约型开 放式	State Street Global Advisors Inc.	8,864,231.55	2.96

7.11.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

金额单位:人民币元	
序号	名称 金额
1	存出保证金 -
2	应收证券清算款 -
3	应收股利 765,014.59

4	应收利息	2,700.38
5	应收申购款	2,861.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	770,576.78
7.11.4	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。	
7.11.5	期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	
	本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。	

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项  
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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
12,234	31,096.25	8,768,794.80	2.30%	371,662,668.05	97.70%

基金管理人所有从业人员持有本基金	73,130.25	0.0192%
------------------	-----------	---------

注:截至本报告期末,基金管理人高级管理人员、基金经理及研究部负责人持有本基金份额总量的数量区间为0;本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年3月3日)基金份额总额	1,059,555,414.92
--------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	432,885,391.11
本报告期基金总申购份额	939,098.99
减:本报告期基金总赎回份额	53,393,027.16
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	380,431,462.94
-------------	----------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

**10 重大事件揭示**

**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内没有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,基金管理人无重大人事变动。  
本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼  
本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变  
本报告期内基金投资策略没有发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况  
2013年5月31日,根据公司第三届董事会第五次会议决议,公司改聘安永华明会计师事务所(特殊普通合)担任公司旗下基金会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚或处分等情况  
本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	15,139,926.26	33.95%	219,398.37	35.96%	-

(Hong Kong) Ltd						
CLSA Ltd	-	14,025,400.18	31.45%	42,968.24	7.04%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	11,683,109.63	26.20%	237,906.01	38.99%	-
Morgan Stanley	-	1,962,168.81	4.40%	9,094.47	1.49%	-

KNIGHT	-	1,789,008.19	4.01%	100,798.44	16.52%	-
FUNDSETTLE	-	-	-	-	-	-
中信証券	-	-	-	-	-	-
安信証券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

申银万国	-	-	-
招商证券	-	-	-

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受托责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行。

2、根据相关法规与基金管理人ODII业务团队按照以下标准，对ODII投资交易

元进行选择: (一) 交易执行能力。主要指境外券商是否对交易指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有: 订单及成交回报的准确性和及时性、券商按报价的准确性和及时性、交易保密能力等; (二) 研究团队的实力和水平。衡量境外券商的研究能力的指标主要有: 宏观经济研究、行业研究、市场走势分析、专题研究报告的水平, 以及推荐投资工具的有效性等; (三) 服务水平。主要是指是否与基金管理人有较强的长期合作意愿并积极提供个性化服务; (四) 交易成本。主要指费用

是否总体可控,交易佣金相较于交易执行水平以及投研支持服务而言是否合理、优惠。符合上述条件的境外券商是QDII业务团队考虑长期合作的对象,可成为备选券商,经QDII投资决策委员会审核批准,由交易室相关人员与其开设证券账户。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券面名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	194,968,385.39	31.69%
CSF&A, Inc.	-	-	-	-	-	-	11,620,004.22	2.20%

CLSA Ltd		—	—	—	—	14,620,094.22	2.58%
Goldman Sachs Asia LLC	—	—	—	—	—	246,879,073.27	40.12%
Morgan Stanley	—	—	—	—	—	30,979,157.97	5.03%
KNIGHT	—	—	—	—	—	113,495,667.55	18.44%
FUNSETTLE	—	—	—	—	—	14,379,004.22	2.34%
Others (100%)							

[illegible]

二〇一三年八月二十八日