融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

【2014】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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年8月26日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2014年8月20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2014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	融通标普中国可转债指数增强	
基金主代码	161624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月26日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	95,139,042.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通标普中国可转债指数增强A	融通标普中国可转债指数增强C
下属分级基金的交易代码:	161624	161625
报告期末下属分级基金的份额总额	61,824,618.79份	33,314,423.55份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分,采取积极配置策略,利用可转债兼具债券和股票的特性,力争实现在控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上,为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。对主动投资部分,采取积极配置策略,力争在有效跟踪标的指数的基础上,获取超越基准的业绩表现。如果未来可转债市场出现流动性不足、券种数量下降或其它不可预见的异常情况,导致本基金无法有效对指数进行跟踪和合理配置,本基金可选择在主动投资部分适当增加对其它金融工具的投资比例,以作为对可转债投资的临时性替代。
业绩比较基准	标普中国可转债价格指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。

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		融通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	李芳菲
	联系电话	(0755)26948666	(010)66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088.(0755)26948088	95599
传真		(0755)26935005	(010)68121816

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

基金级别	融通标普中国可转债指数增强A	融通标普中国可转债指数增强C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-4,633,134.42	-2,945,390.63
本期利润	1,317,001.68	513,955.94
加权平均基金份额本期利润	0.0161	0.0103
本期基金份额净值增长率	3.13%	2.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0937	-0.0981
期末基金资产净值	59,024,073.01	31,648,969.77
期末基金份额净值	0.955	0.950

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)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

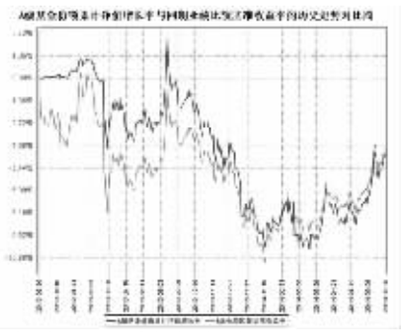
融通标普中国可转债指数增强A

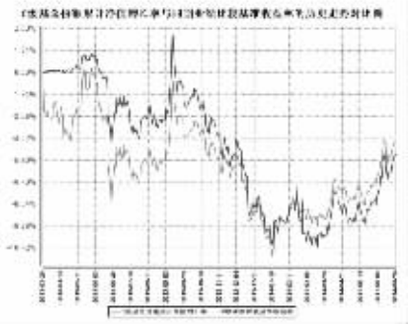
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.35%	0.44%	2.89%	0.43%	0.46%	0.01%
过去三个月	5.76%	0.42%	5.20%	0.36%	0.56%	0.06%
过去六个月	3.13%	0.48%	4.16%	0.42%	-1.03%	0.06%
过去一年	-2.15%	0.49%	1.52%	0.45%	-3.67%	0.04%
自基金合同生效起至今	-4.50%	0.48%	-4.27%	0.52%	-0.23%	-0.04%

融通标普中国可转债指数增强C

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	3.26%	0.47%	2.89%	0.43%	0.37%	0.04%
过去三个月	5.56%	0.43%	5.20%	0.36%	0.36%	0.07%
过去六个月	2.93%	0.48%	4.16%	0.42%	-1.23%	0.06%
过去一年	-2.56%	0.49%	1.52%	0.45%	-4.08%	0.04%
自基金合同生效起至今	-5.00%	0.47%	-4.27%	0.52%	-0.73%	-0.05%

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2014年6月30日,公司管理的基金共有二十五只:一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金;二十四只开放式基金,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、融通通泰保本混合基金、融通通泽一年目标触发式混合基金、融通通祥一年目标触发式混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源一年目标触发式混合基金和融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金。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(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		
王超	本基金的基金经理、融通债券基金经理、融通七天理财债券基金经理	2013年12月27日	-	7	金融工程硕士,经济学、数学双学士,7年证券从业经验,具有证券从业资格。2007年7月至2012年8月在深圳发展银行(现更名为平安银行)工作,主要从事债券自营交易盘投资与理财投资管理。2012年8月加入融通基金管理公司任投资经理。
张李陵	本基金的基金经理、融通债券基金经理、融通七天理财债券基金经理	2013年3月26日	2014年1月7日	8	清华大学经济学硕士、理学学士,具有证券从业资格。2006年7月至2012年7月在招商银行总行工作,主要从事债券投资和交易。2012年7月加入融通基金管理有限公司。

注:任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

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、《融通标普中国可转债指数增强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(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

2014年一季度,受经济数据大幅低于预期的影响,股票市场延续了去年四季度下跌的趋势;进入二季度后,受出口需求改善和稳增长政策的影响,经济下行趋势得到了抑制,PMI数据连续改善。资金面出现了进一步的宽松,银行间质押式回购利率明显下行,资金面非常宽松。股票市场在政策维稳的影响下表现较为平稳,2000点附近的支撑效应显著,2季度上证指数在2000点至2070点区间窄幅震荡,而转债受到债底价值提升和风险偏好的共同推动而小幅上涨。

本基金在此期间根据市场表现适时灵活地调整了转债的仓位水平,适度错配了部分转债以增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A类基金份额净值增长率为3.13%,C类基金份额净值增长率为2.93%,同期业绩比较基准收益率为4.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,由于PMI数据已经连续4个月改善,且稳增长的政策依然在发酵,从经济环比的角度来看,经济最差的时间已经过去。此外,利率中枢也有望进一步保持在相对低位水平,因此从基本面和债底价值来看,转债投资价值较高。预计3季度上证指数的底部可能逐步抬高,占比较大的金融股转债相对具备较高的投资价值。本基金在3季度将密切关注大盘转债的投资机会,适时提高其配置比例。

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、固定收益部、国际业务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

在托管融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金合同》、《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金托管协议》的约定,对融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金管理人—融通基金管理有限公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,融通基金管理有限公司在融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《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

本托管人认为,融通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	4,449,236.57	11,166,329.27
结算备付金	1,201,744.30	3,341,149.98
存出保证金	28,088.55	24,950.66
交易性金融资产	92,832,385.70	150,828,515.40
其中:股票投资	4,352,830.00	-
基金投资	-	-
债券投资	88,479,555.70	150,828,515.40
资产支持证券投资	-	
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	673,204.43	-
应收利息	279,567.04	765,775.27
应收股利	-	-
应收申购款	18,277.35	1,092.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	99,482,503.94	166,127,812.64
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	7,000,000.00	4,000,000.00
应付证券清算款	-	2,948,682.22
应付赎回款	1,614,875.79	154,186.95
应付管理人报酬	37,969.35	76,666.12
应付托管费	7,593.89	15,333.22
应付销售服务费	8,029.33	20,066.33
应付交易费用	11,508.56	175.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	129,484.24	135,046.82
负债合计	8,809,461.16	7,350,156.66
所有者权益:		
实收基金	95,139,042.34	171,683,898.28
未分配利润	-4,465,999.56	-12,906,242.30
所有者权益合计	90,673,042.78	158,777,655.98
负债和所有者权益总计	99,482,503.94	166,127,812.64

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额总额95,139,042.34份;其中融通标普中国可转债指数增强A基金份额净值0.955元,基金份额为61,824,618.79份;融通标普中国可转债指数增强C基金份额净值0.950元,基金份额为33,314,423.55份。

6.2 利润表

会计主体:融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月26日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入	2,623,482.44	-5,218,141.62
1.利息收入	750,982.09	6,465,606.20
其中:存款利息收入	43,112.69	4,541,304.73
债券利息收入	670,151.04	1,408,223.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	37,718.36	516,078.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-7,543,542.80	-917,580.06
其中:股票投资收益	-176,554.06	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-7,383,727.74	-917,580.06
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	16,739.00	-
3.公允价值变动收益	9,409,482.67	-10,871,906.59
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	6,560.48	105,738.83
减:二、费用	792,524.82	1,993,646.91
1.管理人报酬	300,708.64	1,020,344.75
2.托管费	60,141.71	204,068.98
3.销售服务费	68,490.70	319,836.70
4.交易费用	24,946.62	5,696.56
5.利息支出	187,282.82	322,120.72
其中:卖出回购金融资产支出	187,282.82	322,120.72
6.其他费用	150,954.33	121,579.20
三、利润总额	1,830,957.62	-7,211,788.53
减:所得税费用	-	-
四、净利润	1,830,957.62	-7,211,788.53

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	171,683,898.28	-12,906,242.30	158,777,655.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,830,957.62	1,830,957.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-76,544,855.94	6,609,285.12	-69,935,570.82
其中:1.基金申购款	757,128.38	-59,955.57	697,172.81
2.基金赎回款	-77,301,984.32	6,669,240.69	-70,632,743.63
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)	95,139,042.34	-4,465,999.56	90,673,042.78
项目	上年度可比期间 2013年3月26日(基金合同生效日)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)	1,309,454,237.09	-	1,309,454,237.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,211,788.53	-7,211,788.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-954,917,045.36	-1,450,662.96	-956,367,708.32
其中:1.基金申购款	21,082,542.58	178,859.95	21,261,402.53
2.基金赎回款	-975,999,587.94	-1,629,522.91	-977,629,110.85
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)	354,537,191.73	-8,662,451.49	345,874,740.24

注: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:

_____奚星华_____ _____朱建华_____ _____刘美丽_____

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 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

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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构

注:下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

本基金本报告期未租用关联方的交易单元。

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月26日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	300,708.64	1,020,344.75
其中:支付销售机构的客户维护费	158,597.41	555,007.21

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0.50%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×0.50%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月26日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,141.71	204,068.98

注:支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通标普中国可转债指数增强A	融通标普中国可转债指数增强C	合计
中国农业银行	-	56,784.88	56,784.88
融通基金管理有限公司	-	7,152.13	7,152.13
合计	-	63,937.01	63,937.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年3月26日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通标普中国可转债指数增强A	融通标普中国可转债指数增强C	合计
中国农业银行	-	292,134.27	292,134.27
融通基金管理有限公司	-	6,705.49	6,705.49
合计	-	298,839.76	298,839.76

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。

6.4.4.4 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

报告期内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,基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月26日(基金合同生效日)至2013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
中国农业银行	4,449,236.57	27,834.79	943,820.14	62,134.85

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、本基金本报告期未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期承销的证券。

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 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.6 期末(2014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

本基金本报告期未未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

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中作为抵押的债券

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

截至本报告期末2014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7,000,000.00元,于2014年7月1日到期。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	4,352,830.00	4.38
	其中:股票	4,352,830.00	4.38
2	固定收益投资	88,479,555.70	88.94
	其中:债券	88,479,555.70	88.94
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,650,980.87	5.68
7	其他各项资产	999,137.37	1.00
8	合计	99,482,503.94	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

序号	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	337,400.00	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	363,750.00	0.40
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	-	-
J	金融业	3,651,680.00	4.03
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	4,352,830.00	4.80

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	601318	中国平安	32,000	1,258,880.00	1.39
2	601166	兴业银行	120,000	1,203,600.00	1.33
3	000001	平安银行	120,000	1,189,200.00	1.31
4	600820	隧道股份	75,000	363,750.00	0.40
5	601989	XD中国重	70,000	337,400.00	0.37

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	601318	中国平安	3,076,935.36	1.94
2	000001	平安银行	2,988,596.52	1.88
3	601166	兴业银行	2,361,689.00	1.49
4	600036	招商银行	1,687,839.07	1.06
5	600820	隧道股份	350,250.00	0.22
6	601989	中国重工	341,300.00	0.21
7	002185	华天科技	150,150.00	0.09

注:"买入金额"是指买入股票成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

7.4.2 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	601318	中国平安	1,799,879.89	1.13
2	000001	平安银行	1,699,550.00	1.07
3	600036	招商银行	1,587,600.00	1.00
4	601166	兴业银行	1,202,900.00	0.76
5	002185	华天科技	165,000.00	0.10

注:"卖出金额"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	10,956,759.95
卖出股票收入(成交)总额	6,454,929.89

注:"买入股票成本(成交)总额"和"卖出股票收入(成交)总额"均按成交单价乘以成交数量填列,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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	88,479,555.70	97.58
8	其他	-	-
9	合计	88,479,555.70	97.58

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	113001	中行转债	220,000	22,393,800.00	24.70
2	113005	平安转债	140,000	14,954,800.00	16.49
3	110023	民生转债	152,440	14,146,432.00	15.60
4	110015	石化转债	125,000	13,496,250.00	14.88
5	113002	工行转债	90,000	9,486,000.00	10.46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	28,088.55
2	应收证券清算款	673,204.43
3	应收股利	-
4	应收利息	279,567.04
5	应收申购款	18,277.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	999,137.37

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	22,393,800.00	24.70
2	113005	平安转债	14,954,800.00	16.49
3	110023	民生转债	14,146,432.00	15.60
4	110015	石化转债	13,496,250.00	14.88
5	113002	工行转债	9,486,000.00	10.46
6	113003	重工转债	2,744,745.20	3.03
7	110024	隧道转债	2,697,500.00	2.97
8	110018	国电转债	2,087,200.00	2.30
9	110020	南山转债	1,900,800.00