华富强化回报债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2013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。

基金托管人中国建设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2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富强化回报债券(场内简称:华富强债)
基金主代码	164105
交易代码	164105
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2010年9月8日
基金管理人	华富基金管理有限公司
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	1,999,206,694.42份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年10月11日

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上,力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素,研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险,以确定各类金融资产的配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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		华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	田青
	联系电话	021-68886996	010-67595096
	电子邮箱	manzh@hffund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

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.hffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§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	84,504,574.26
本期利润	76,010,285.39
加权平均基金份额本期利润	0.0380
本期基金份额净值增长率	3.72%
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	0.0423
期末基金资产净值	2,083,860,831.67
期末基金份额净值	1.042

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,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3)期末可供分配利润,采用期末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。表中的"期末"均指报告期最后一日,即6月30日。

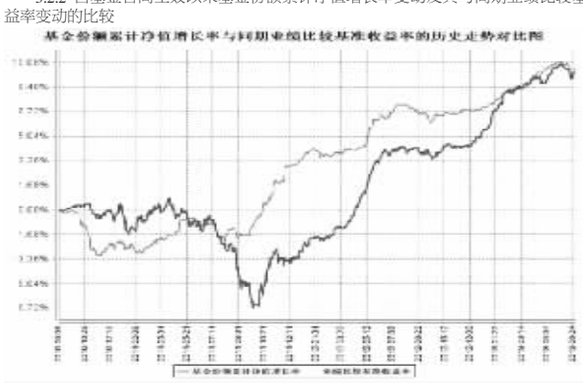
3.2 基金净值表现

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	-0.48%	0.10%	-0.38%	0.16%	-0.10%	-0.06%
过去三个月	0.77%	0.10%	0.98%	0.10%	-0.21%	0.00%
过去六个月	3.72%	0.11%	2.42%	0.08%	1.30%	0.03%
过去一年	5.22%	0.10%	2.84%	0.07%	2.38%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.43%	0.18%	9.65%	0.11%	-0.22%	0.07%

注:业绩比较基准收益率=中证全债指数,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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:根据《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%。本基金还可以参与新股申购、股票增发和要约收购类股票投资,并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%。在封闭期结束后,本基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2010年9月8日到2011年3月8日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定。

§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

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立,注册资本1.2亿元,公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司。截止2013年6月30日,本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金和华富保本混合型证券投资基金十一只基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张钫	华富强化回报债券基金基金经理	2011年4月26日	-	十一年	上海社会科学院金融学硕士,研究生学历,历任上海远东资信评估有限公司研究员、房地产评级部经理、集团与证券评级部副经理,新华财经有限公司资信评级部高级经理,2009年5月加入华富基金管理有限公司,任债券研究员、华富强化回报债券基金基金助理。

注:任职日期指公司作出决定之日,证券从业年限的计算标准上,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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

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

上半年,市场感受到经济下行的容忍度在提高,经济结构的调整是一个艰难长期的过程。一季度热钱带来的流动性扩张超过预期,反之,二季度末的钱荒也使得金融风险暴露在眼前。在这一背景下,债券市场经历了过山车的行情。

信用债市场从"供需两旺"过渡到去杠杆化阶段,杠杆套利的模式经历了一次回归。在经济下台阶、债务规模不断上升的过程中,信用风险开始暴露,信用风险定价和流动性风险溢价结合在一起,对市场造成冲击,一定程度上也蕴含着未来的投资机会。

本基金上半年逐步降低信用债的仓位,保持了组合的灵活性,在行业和个券的信用风险管理上提前布局,取得了较好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2010年9月8日正式成立。截止2013年6月30日,本基金份额净值为1.042元,累计份额净值为1.093元。本报告期,本基金净值增长率为3.72%,同期业绩比较基准收益率为2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年,控制增量、盘活存量成为经济和市场的主线,货币政策出现大的变化仍有诸多制约。金融系统经历了6月末"钱荒"考验后,会主动调整期限和杠杆,作好准备,但阶段性的紧张仍有可能发生。经济低迷、周期性产业的衰退,引发信用基本面的不利预期,加强信用风险管理仍是下半年的重要工作。

经过前期市场的急剧调整,中短期债券品种配置价值显现。在信用债泥沙俱下的过程中,可关注公司治理良好,基本面可靠,周期底部企稳,财务逐步改善的行业个券,加强调研。随着收益率的上行,部分优质城投债的配置价值也在提升。我们后续的策略是,保持组合的灵活性,均衡配置。

本基金将在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,稳健地做好配置策略,积极而不激进,均衡投资,以三年封闭期的综合收益率较高为重要目标,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定,成立了估值委员会,并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理,成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本报告期内实施了2012年度的第一次利润分配,分红基准日为2012年12月31日,分配金额为101,959,540.54元。本期利润76,010,285.39元,期末可供分配利润为84,654,137.25元,本期利润未进行分配。

§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,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,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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为101959540.54元。

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

本托管人复核审查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。

§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:华富强化回报债券型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	606,340.29	16,636,904.40
结算备付金		8,903,457.96	47,136,222.13
存出保证金		158,497.80	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,802,326,126.49	2,905,879,381.18
其中:股票投资		40,436,900.00	49,580,327.60
基金投资		-	-
债券投资		1,761,889,226.49	2,856,299,053.58
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	477,218,595.82	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	36,195,125.27	51,392,431.53
应收股利		486,400.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,325,894,543.63	3,021,294,939.24
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		238,000,000.00	905,000,000.00
应付证券清算款		347,102.18	2,627,101.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,029,146.74	1,064,734.39
应付托管费		343,048.91	354,911.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,244.79	15,598.04
应交税费		-	-
应付利息		74,431.60	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,218,737.74	2,422,507.12
负债合计		242,033,711.96	911,484,852.42
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,999,206,694.42	1,999,206,694.42
未分配利润	6.4.7.10	84,654,137.25	110,603,392.40
所有者权益合计		2,083,860,831.67	2,109,810,086.82
负债和所有者权益总计		2,325,894,543.63	3,021,294,939.24

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.042元,基金份额总额1,999,206,694.42份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:华富强化回报债券型证券投资基金

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	附注号	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		89,601,585.36	159,752,501.46
1.利息收入		46,432,827.36	70,882,782.39
其中:存款利息收入	6.4.7.11	380,915.90	1,068,879.73
债券利息收入		43,347,915.98	69,787,032.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,703,995.48	26,870.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		51,663,046.87	33,378,463.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	1,472,055.14	703,222.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	48,521,458.44	32,252,219.23
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,669,533.29	423,022.20
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-8,494,288.87	55,491,255.29
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二、费用		13,591,299.97	24,214,770.91
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	6,176,704.12	5,962,036.76
2.托管费	6.4.10.2.2	2,058,901.33	1,987,345.64
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	43,943.62	101,335.26
5.利息支出		4,731,824.38	15,867,939.19
其中:卖出回购金融资产支出		4,731,824.38	15,867,939.19
6.其他费用	6.4.7.20	579,926.52	296,114.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		76,010,285.39	135,537,730.55
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		76,010,285.39	135,537,730.55

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富强化回报债券型证券投资基金

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)	1,999,206,694.42	110,603,392.40	2,109,810,086.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	76,010,285.39	76,010,285.39
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)	-	-	-
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(净值减少以"-"号填列)	-	-101,959,540.54	-101,959,540.54
五、期末所有者权益(基金净值)	1,999,206,694.42	84,654,137.25	2,083,860,831.67
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)	1,999,206,694.42	-55,875,609.52	1,943,331,084.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	135,537,730.55	135,537,730.55
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)	-	-	-
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(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,999,206,694.42	79,662,121.03	2,078,868,815.45

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:

章宏韬 姚怀然 陈大毅

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 基金基本情况

华富强化回报债券型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》发起,经中国证监会2010年7月23日证监许可[2010]989文核准募集设立。本基金于2010年9月1日起向全社会公开募集,并于当日顺利结束基金募集。经天健正信会计师事务所验资并出具天健正信验(2010)综020119号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本次募集资金总额1,998,972,737.11元;募集资金的银行存款利息233,957.31元,折成基金份额,归投资人所有;设立募集期共募集1,999,206,694.42份基金单位。本基金为创新型封闭式,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)。基金管理人为华富基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司;有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2010年9月8日生效,该日的基金份额为1,999,206,694.42份基金单位。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013半年度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2013年6月30日的财务状况以及2013半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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相一致的说明

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

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问题的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国税总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项如下:

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。

基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征收营业税。

对基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征收企业所得税;对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20.00%的个人所得税。

根据财政部、国税总局、证监会发布之《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,从2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

基金买卖股票,经国务院批准,从2008年4月24日起证券(股票)交易印花税税率由现行的3‰调整为1‰。经国务院批准,从2008年9月19日起,对证券交易印花税政策进行调整,由现行双边征收改为向卖方单边征收,税率保持1‰。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司("华安证券")	基金管理人的股东、代销机构

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

本基金截止至本报告期末及上年度可比期间未租用关联方交易单元。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	6,176,704.12	5,962,036.76
其中:支付销售机构的客户维护费	230,716.89	285,985.62

注:基金管理费按前一日基金资产净值0.6%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年管理费率÷当年天数(H为每日应计提的基金管理费,E为前一日基金资产净值)。

6.4.8.2.2 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	2,058,901.33	1,987,345.64

注:基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年托管费率÷当年天数(H为每日应计提的基金托管费,E为前一日基金资产净值)。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	50,080,563.70	40,284,738.63	-	-	88,400,000.00	14,531.50
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-	130,000,000.00	10,969.86

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

本基金本报告期内和上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华安证券股份有限公司	35,655,937.67	1.78%	48,455,937.67	2.42%

注:关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定,符合公允性要求

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

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
中国建设银行股份有限公司	606,340.29	84,154.38	2,251,990.11	223,987.16

注:本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123465	13证金14	2013年6月26日	2013年7月17日	新债未上市	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,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为人民币238,000,000元,于2013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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	40,436,900.00	1.74
	其中:股票	40,436,900.00	1.74
2	固定收益投资	1,761,889,226.49	75.75
	其中:债券	1,761,889,226.49	75.75
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	477,218,595.82	20.52
	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	9,509,798.25	0.41
6	其他各项资产	36,840,023.07	1.58
7	合计	2,325,894,543.63	100.00

注:本表列示的其他各项资产详见7.9.3 期末其他各项资产构成。

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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,817,100.00	0.42
C	制造业	13,752,300.00	0.66
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	16,632,000.00	0.80
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	1,235,500.00	0.06
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	40,436,900.00	1.94

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

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	601006	大秦铁路	2,800,000	16,632,000.00	0.80
2	600143	金发科技	2,560,000	12,364,800.00	0.59
3	002683	宏大爆破	370,000	8,817,100.00	0.42
4	601965	中国汽研	150,000	1,387,500.00	0.07
5	601336	新华保险	50,000	1,235,500.00	0.06

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

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	600521	华海药业	441,000.00	0.02

注:本表列示"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

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	002683	宏大爆破	4,720,989.19	0.22
2	601118	海南橡胶	2,297,045.83	0.11
3	601965	中国汽研	2,260,978.20	0.11
4	601336	新华保险	700,480.00	0.03
5	600521	华海药业	603,489.97	0.03

注:本表列示"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

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	441,000.00
卖出股票收入(成交)总额	10,582,983.19

注:本表列示"买入股票成本(成交)总额"及"卖出股票收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

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	19,970,000.00	0.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,598,000.00	2.86
	其中:政策性金融债	39,598,000.00	1.90
4	企业债券	851,039,533.00	40.84
5	企业短期融资券	571,783,000.00	27.44
6	中期票据	70,148,000.00	3.37
7	可转债	189,350,693.49	9.09
8	其他	-	-
9	合计	1,761,889,226.49	84.55

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	113003	重工转债	730,000	79,803,600.00	3.83
2	1280219	12铁道03	780,000	78,249,600.00	3.76
3	122845	11横店债	691,000	70,482,000.00	3.38
4	041256022	12武钢CP003	700,000	70,420,000.00	3.38
5	041260094