华商产业升级股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:华商基金管理有限公司
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

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6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华商产业升级股票
基金主代码	630006
交易代码	630006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月18日
基金管理人	华商基金管理有限公司
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	389,444,058.83份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在把握经济结构调整和产业发展趋势的基础上,通过重点投资于受益于产业结构调整和产业升级的优势企业,在控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期持续增值。
投资策略	本基金在构建和管理投资组合的过程中,以产业升级作为行业配置与个股精选的投资主线,沿着先产业分析再行业分析再上市公司分析的投资逻辑,深入挖掘受益于国内产业结构调整、产业升级的上市公司的价值,进行长期价值投资。
业绩比较基准	中信标普300指数收益率×75%+中信国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于其它类型的基金产品,属于高风险、高收益的基金产品。

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		华商基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周亚红	田青
	联系电话	010-58573600	010-67595096
	电子邮箱	zhouyh@hsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4007008880	010-67595096
传真		010-58573520	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.hsfund.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	48,202,950.39
本期利润	14,972,571.76
加权平均基金份额本期利润	0.0360
本期加权平均净值利润率	5.05%
本期基金份额净值增长率	4.76%
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	–121,062,152.84
期末可供分配基金份额利润	–0.3109
期末基金资产净值	274,302,649.72
期末基金份额净值	0.704
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	–29.60%

注:1.上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。

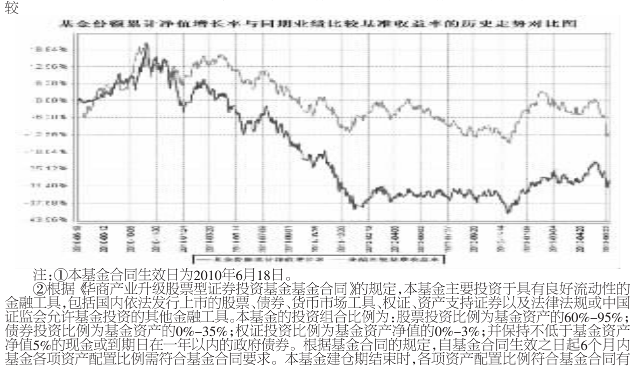
3.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

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	–8.81%	1.75%	–11.49%	1.40%	2.68%	0.35%
过去三个月	–1.40%	1.26%	–8.29%	1.07%	6.89%	0.19%
过去六个月	4.76%	1.22%	–8.33%	1.10%	13.09%	0.12%
过去一年	7.48%	1.17%	–6.18%	1.00%	13.66%	0.17%
过去三年	–29.32%	1.25%	–7.27%	1.01%	–22.05%	0.24%
自基金合同生效起至今	–29.60%	1.24%	–11.81%	1.02%	–17.79%	0.22%

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:①本基金合同生效日为2010年6月18日。

②根据《华商产业升级股票型证券投资基金基金合同》的规定,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的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的60%–95%;债券投资比例为基金资产的0%–35%;权证投资比例为基金资产净值的0%–3%;并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 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

华商基金管理有限公司由华龙证券有限责任公司、中国华电集团财务有限公司和济钢集团有限公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字[2005]160号文批准设立,于2005年12月20日成立,注册资本金为1亿元人民币。

华商基金管理有限公司自2010年6月18日华商产业升级股票型证券投资基金正式成立之日起,成为该基金的管理人。目前本公司旗下管理十四只基金产品,分别为华商领先企业混合型证券投资基金(基金代码:630001)、华商盛世成长股票型证券投资基金(基金代码:630002)、华商收益增强债券型证券投资基金(基金代码:A类630003,B类630103)、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:630005)、华商产业升级股票型证券投资基金(基金代码:630006)、华商稳健双利债券型证券投资基金(基金代码:A类630007,B类630107)、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:630008)、华商稳定增利债券型证券投资基金(基金代码:A类630009,C类630109)、华商价值精选股票型证券投资基金(基金代码:630010)、华商主题精选股票型证券投资基金(基金代码:630011)、华商中证500指数分级证券投资基金(基金代码:母基金166301,A类150110,B类150111)、华商现金增利货币市场基金(基金代码:A类630012,B类630112)、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:630015)和华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金(基金代码:630016)。

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		
刘宏	基金经理,投资管理部副总经理,投资决策委员会委员	2012年4月24日	–	7	男,管理学硕士,特许金融分析师(CFA),中国籍,具有基金从业资格;2002年7月至2007年2月就职于中国移动通信集团公司,任项目经理;2007年2月至2008年3月就职于云南国际信托有限公司,任高级分析师。2008年4月加入华商基金管理有限公司,2009年11月24日至2011年5月31日担任华商动态阿尔法灵活配置混合型基金基金经理助理,2011年5月31日起至今担任华商价值精选股票型证券投资基金基金经理,2013年2月1日起至今华商盛世成长股票型证券投资基金基金经理。

注:①"任职日期"和"离职日期"分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

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

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等,建立健全投资授权制度,确保各投资组合公平获得研究资源,享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配,报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内,场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,公司制定了《异常交易管理办法》,对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度,公司旗下所有投资组合不存在同日反向交易,未发现本基金存在异常交易行为。

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,在宏观经济趋弱的背景下,资本市场中主要股指走势不佳,但是,以创业板为代表的结构性行情却得到了充分演绎。虽然,年初在经济见底的预期引导下,周期类行业带领大盘走出了一波反弹行情。但是,由于经济下行趋势并未终结,因此,这不仅导致传统行业的盈利情况持续恶化,也压制了其估值的表现。与此同时,在转型的大背景下,符合经济转型方向的新兴行业由于其特点,却受到了更多的关注和追捧,在上半年的行情中表现优异。虽然,这种结构化行情导致了新兴、传统板块之间的估值差屡破历史新高,同时,市场在二季度末时曾尝试过两次风格转换,但终究由于经济大势趋弱,无增量资金配合,加上季末钱荒的刺激,导致转换半途而废,结构性差异并未得到有效收敛,反而愈演愈烈。

本基金投资组合在报告初期,保持了高仓位,后期保持中性仓位运作。同时,侧重Alpha策略,配置上重点集中在符合医药、传媒、环保、军工等主题风格,且有估值优势、成长空间的标的上。通过对有潜力标的的重点配置,本基金在报告期内跑赢基准。

结合今年上半年的宏观经济形势、资本市场的趋势特点,本基金将继续坚定配置并持有符合中国经济转型、具备核心竞争优势的品种。

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0.704元,份额累计净值为0.704 元,本报告期内本基金份额净值增长率为4.76%,同期业绩比较基准收益率为–8.33%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率13.09个百分点;自基金合同成立至本报告期末,本基金份额净值增长率为–29.60%,同期业绩比较基准收益率为–11.81%,本基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率17.79个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,宏观经济方面,海外角度,美国经济的复苏将延续,但是节奏将趋缓。美联储对于量宽退出的规划和部署将更为明确,而这将进一步刺激美元趋强。国内方面,经济将继续维持弱势,若无政策对冲,短期难有惊喜。

在此背景下,考虑到领导层对于经济转型的决心,传统产业难有持续性机会,再加上,成长股的上升空间受到高估值和风险偏好下行的限制,以及流动性偏紧和IPO发行在即,预期市场在下半年难有大的趋势性机会。对于组合投资而言,最重要的工作,还是在结构性的机会中,挖掘出穿越周期的优秀成长标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列6.4 报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性,公司成立估值委员会和风险内控小组。公司总经理任估值委员会负责人,委员包括投资总监、运营保障部经理、基金会计主管、研究发展部经理(若负责人认为必要,可适当增减委员会委员),主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算,并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人,成员包括监察稽核部和基金事务相关人员(若负责人认为必要,可适当增减小组成员),主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

在严格遵循公平、合理原则下,公司制订了健全、有效的估值政策流程:

1.运营保障部基金会计应实时监控股票停牌情况,对于连续5个交易日不存在活跃市场的股票及时提示研究发展部并发出预警;

2.由研究发展部估值小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值,若确定用估值方法计算公允价值,则在参考证券业协会的意见或第三方意见后确定估值方法,并确定估值所用的行业指数和指数日收益率;

3.由估值委员会计算该投资品种的公允价值,并将计算结果提交风险内控小组;

4.风险内控小组审核该投资品种估值方法的适用性和公允性,出具审核意见并提交公司管理层;

5.公司管理层审批后,该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种估值时估值政策和程序的一贯性,风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行审核,并建立风险防范标准。在考虑投资策略的情况下,公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形,已确定的估值政策和程序应当持续适用。

风险内控小组和估值委员会应互相协助定期对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应及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议,风险内控小组审核并提交公司管理层,待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时,应由风险内控小组对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时,风险内控小组应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性,通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配的情况。

§ 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,本基金未实施利润分配。

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:华商产业升级股票型证券投资基金
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	40,588,247.30	74,726,551.06
结算备付金	2,560,674.57	130,176.68
存出保证金	295,056.09	371,760.06
交易性金融资产	230,768,374.46	212,137,469.07
其中:股票投资	230,768,374.46	212,137,469.07
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	3,551,096.64	5,762,127.95
应收利息	8,231.78	14,075.34
应收股利	–	–
应收申购款	38,791.32	85,388.31
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	277,810,472.16	293,227,548.47
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	–	–
应付证券清算款	1,604,205.37	–
应付赎回款	92,948.54	156,107.37
应付管理人报酬	351,561.88	347,388.97
应付托管费	58,593.65	57,898.19
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	1,226,824.97	201,805.70
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	173,688.03	550,351.81
负债合计	3,507,822.44	1,313,552.04
所有者权益:		
实收基金	389,444,058.83	434,288,626.10
未分配利润	–115,141,409.11	–142,374,629.67
所有者权益合计	274,302,649.72	291,913,996.43
负债和所有者权益总计	277,810,472.16	293,227,548.47

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.704元,基金份额总额274,302,649.72份。

6.2 利润表

会计主体:华商产业升级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	21,669,233.46	1,540,902.98
1.利息收入	246,383.91	264,910.09
其中:存款利息收入	203,533.15	264,910.09
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	42,850.76	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	54,636,184.07	–57,435,733.17
其中:股票投资收益	52,624,307.12	–58,980,031.71
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	2,011,876.95	1,544,298.54
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	–33,230,378.63	58,678,787.70
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	17,044.11	32,938.36
减:二、费用	6,696,661.70	5,553,314.93
1.管理人报酬	2,205,330.18	2,316,114.63
2.托管费	367,555.03	386,019.09
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	3,932,772.95	2,656,749.40
5.利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	191,003.54	194,431.81
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	14,972,571.76	–4,012,411.95
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	14,972,571.76	–4,012,411.95

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华商产业升级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		
	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)	434,288,626.10	–142,374,629.67	291,913,996.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	14,972,571.76	14,972,571.76
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)	–44,844,567.27	12,260,648.80	–32,583,918.47
其中:1.基金申购款	22,902,767.17	–6,422,095.78	16,480,671.39
2.基金赎回款	–67,747,334.44	18,682,744.58	–49,064,589.86
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)	389,444,058.83	–115,141,409.11	274,302,649.72
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)	510,942,504.17	–173,039,893.15	337,902,611.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	–4,012,411.95	–4,012,411.95
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)	–47,202,774.22	16,981,953.57	–30,220,820.65
其中:1.基金申购款	20,806,673.59	–7,310,781.97	13,495,891.62
2.基金赎回款	–68,009,447.81	24,292,735.54	–43,716,712.27
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)	463,739,729.95	–160,070,351.53	303,669,378.42

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:

王锋	程蕾	程蕾
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

华商产业升级股票型证券投资基金(以下简称"本基金")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]第417号《关于核准华商产业升级股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商产业升级股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集999,077,026.27元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第150号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商产业升级股票型证券投资基金基金合同》于2010年6月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为999,184,191.71份基金份额,其中认购资金利息折合107,165.44份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商产业升级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%–95%;债券投资比例为基金资产的0%–35%;权证投资比例为基金资产净值的0%–3%;并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中信标普300指数收益率×75%+中信国债指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则–基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商产业升级股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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年1月1日至2013年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金本报告期没有会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有重大会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期没有差错更正的说明。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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企业所得税。

(3)对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。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对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。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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
华商基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
华龙证券有限责任公司("华龙证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间内均未发生支付给关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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	2,205,330.18	2,316,114.63
其中:支付销售机构的客户维护费	899,393.76	917,053.27

注:支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

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	367,555.03	386,019.09

注:支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内未发生基金管理人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之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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	40,588,247.30	187,972.74	50,001,931.01	251,929.00

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券的买卖。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票

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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600552	方兴科技	2013年4月8日	2014年4月2日	非公开发行流通受限	15.67	15.77	600,000	9,400,000.00	9,462,000.00	–

注:1.基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

2.本基金于2013年4月8日参与认购安徽方兴科技股份有限公司(简称"方兴科技")公开发行股票网下申购,以每股23.50元的价格中签400,000股。方兴科技于2013年5月22日实施2012年度权益分派方案,向全体股东每10股派1.00元人民币(含税),同时用资本公积转增5股。本基金新增200,000股。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 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,因此没有作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额,因此没有作为抵押的债券。

§ 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	230,768,374.46	83.07
	其中:股票	230,768,374.46	83.07
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	43,148,921.87	15.53
6	其他各项资产	3,893,175.83	1.40
7	合计	277,810,472.16	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	16,430,400.00	5.99
B	采矿业	–	–
C	制造业	127,820,663.03	46.60
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	2,905,461.26	1.06
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	32,936,813.95	12.01
J	金融业	–	–
K	房地产业	32,944,132.31	12.01
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	5,169,813.88	1.88
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	8,673,090.03	3.16
S	综合	3,888,000.00	1.42
	合计	230,768,374.46	84.13

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	600572	康恩贝	1,943,497	21,553,381.73	7.86
2	600108	亚盛集团	2,520,000	16,430,400.00	5.99
3	600315	上海家化	303,754	13,665,892.46	4.98
4	600570	恒生电子	873,675	10,920,937.50	3.98
5	600067	冠城大通	1,314,100	10,499,659.00	3.83
6	600976	武汉健民	438,356	9,468,489.60	3.45
7	600552	方兴科技	600,000	9,462,000.00	3.45
8	000002	万 科A	910,000	8,963,500.00	3.27
9	601928	凤凰传媒	1,031,283	8,673,090.03	3.16
10	300059	东方财富	617,891	8,372,423.05	3.05

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	000001	平安银行	48,020,528.82	16.45
2	000002	万 科A	32,957,444.34	11.29
3	600383	金地集团	30,530,718.75	10.46
4	601318	中国平安	29,182,079.25	10.00
5	300198	纳川股份	28,113,107.10	9.63
6	600048	保利地产	28,078,138.87	9.62
7	601607	上海医药	27,622,596.29	9.46
8	601928	凤凰传媒	26,391,044.98	9.04
9	600572	康恩贝	24,668,108.15	8.45
10	300288	朗玛信息	24,582,777.53	8.42
11	300059	东方财富	24,575,439.47	8.42
12	002638	勤上光电	22,857,335.93	7.83
13	601166	兴业银行	22,424,163.71	7.68
14	000608	阳光股份	22,352,504.42	7.66
15	600056	中国医药	21,406,741.74	7.33
16	600108	亚盛集团	20,261,127.92	6.94
17	002025	航天电器	20,244,720.24	6.94
18	601788	光大证券	19,046,466.41	6.52
19	601989	中国重工	18,776,365.54	6.43
20	002358	森源电气	18,682,951.69	6.40
21	600067	冠城大通	18,279,934.30	6.26
22	600256	广汇能源	16,032,566.02	5.49
23	601601	中国太保	15,673,623.44	5.37
24	600240	华业地产	15,387,458.09	5.27
25	600976	武汉健民	15,031,856.34	5.15
26	000997	新 大 陆	14,597,230.76	5.00
27	000915	山大华特	13,721,523.64	4.70
28	600570	恒生电子	13,557,990.38	4.64
29	601991	大唐发电	13,507,353.00	4.63
30	600089	特变电工	13,427,308.12	4.60
31	600729	重庆百货	13,071,153.02	4.48
32	002230	科大讯飞	12,560,038.12	4.30
33	002474	榕基软件	12,400,672.48	4.25
34	600011	华能国际	12,192,606.21	4.18
35	600406	国电南瑞	12,073,255.89	4.14
36	002405	四维图新	12,033,810.06	4.12
37	600690	青岛海尔	11,323,492.67	3.88
38	600086	东方金钰	11,253,567.45	3.86
39	600728	佳都新太	11,202,433.61	3.84
40	002024	苏宁云商	10,626,633.89	3.64
41	601186	中国铁建	10,569,727.74	3.62
42	000718	苏宁环球	10,130,191.65	3.47
43	600372	中航电子	10,071,466.90	3.45
44	601222	林洋电子	9,958,520.55	3.41
45	002292	奥飞动漫	9,687,190.67	3.32
46	601169	北京银行	9,423,764.98	3.23
47	600552	方兴科技	9,400,000.00	3.22
48	002138	顺络电子	9,366,249.07	3.21
49	601988	中国银行	8,940,000.00	3.06
50	600101	明星电力	8,847,598.64	3.03
51	600000	浦发银行	8,617,800.00	2.95
52	601688	华泰证券	8,589,296.64	2.94
53	600765	中航重机	8,495,270.95	2.91
54	002528	英飞拓	8,128,321.33	2.78
55	600305	恒顺醋业	7,927,570.63	2.72
56	000661	长春高新	7,696,752.39	2.64
57	600085	同仁堂	7,563,545.22	2.59
58	300020	银江股份	7,441,276.20	2.55
59	600716	凤凰股份	7,423,013.80	2.54
60	002480	新筑股份	7,302,829.86	2.50
61	601628	中国人寿	7,280,534.28	2.49
62	600030	中信证券	7,235,305.91	2.48
63	002241	歌尔声学	7,068,315.14	2.42
64	000917	电广传媒	7,013,399.48	2.40
65	600418	XD江淮汽	6,841,025.45	2.34
66	000540	中天城投	6,702,466.16	2.30
67	600184	光电股份	6,659,200.16	2.28
68	002305	南国置业	6,611,654.03	2.26
69	600519	贵州茅台	6,539,719.50	2.24
70	601058	赛轮股份	6,535,515.14	2.24
71	300039	上海凯宝	6,504,926.00	2.23
72	601117	中国化学	6,298,725.00	2.16
73	600312	平高电气	6,242,593.75	2.14
74	600770	综艺股份	6,012,633.16	2.06
75	600340	华夏幸福	5,909,878.80	2.02

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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	000001	平安银行	45,767,895.62	15.68
2	601607	上海医药	32,111,414.00	11.00
3	600383	金地集团	29,468,301.09	10.09
4	300198	纳川股份	29,447,891.89	10.09
5	601318	中国平安	28,600,988.09	9.80
6	002230	科大讯飞	27,763,690.61	9.51
7	300288	朗玛信息	27,326,074.72	9.36
8	601928	凤凰传媒	25,863,719.72	8.86
9	600728	佳都新太	25,679,597.54	8.80
10	600048	保利地产	23,950,140.85	8.20
11	601166	兴业银行	22,659,246.27	7.76
12	002241	歌尔声学	22,197,262.01	7.60
13	000608	阳光股份	22,007,564.38	7.54
14	600315	上海家化	21,823,033.91	7.48
15	000002	万 科A	21,627,099.97	7.41
16	002638	勤上光电	20,947,546.30	7.18
17	002025	航天电器	20,494,057.75	7.02
18	600056	中国医药	20,192,470.51	6.92
19	601989	中国重工	19,021,693.62	6.52
20	601788	光大证券	18,524,659.03	6.35
21	300202	聚龙股份	18,112,672.62	6.20
22	002371	七星电子	17,757,409.72	6.08
23	300059	东方财富	17,548,892.09	6.01
24	000997	新 大 陆	17,229,945.98	5.90
25	000538	云南白药	16,327,572.07	5.59
26	002358	森源电气	16,264,315.84	5.57
27	600240	华业地产	15,721,465.66	5.39
28	601601	中国太保	15,715,768.82	5.38
29	002292	奥飞动漫	15,112,004.14	5.18
30	601169	北京银行	13,913,782.39	4.77
31	601991	大唐发电	13,556,840.34	4.64
32	000915	山大华特	12,923,498.18	4.43
33	600256	广汇能源	12,834,461.66	4.40
34	600340	华夏幸福	12,796,693.44	4.38
35	002474	榕基软件	12,260,428.86	4.20
36	002405	四维图新	12,158,975.03	4.17
37	000536	华映科技	12,021,236.10	4.12
38	600089	特变电工	11,497,941.61	3.94
39	600011	华能国际	11,277,538.41	3.86
40	600086	东方金钰	10,950,032.01	3.75
41	600765	中航重机	10,880,525.96	3.73
42	601186	中国铁建	10,709,187.43	3.67
43	002024	苏宁云商	10,479,679.92	3.59
44	600690	青岛海尔	9,965,097.00	3.41
45	600067	冠城大通	9,894,735.03	3.39
46	300324	旋极信息	9,796,779.22	3.36
47	002450	康得新	9,615,646.84	3.29
48	601222	林洋电子	9,153,465.71	3.14
49	600000	浦发银行	9,121,000.00	3.12
50	600712	南宁百货	9,025,668.44	3.09
51	601988	中国银行	8,910,000.00	3.05
52	600406	国电南瑞	8,905,428.24	3.05
53	000718	苏宁环球	8,896,746.56	3.05
54	600101	明星电力	8,756,635.02	3.00
55	600976	武汉健民	8,685,082.87	2.98
56	600729	重庆百货	8,633,877.36	2.96
57	600572	康恩贝	8,608,197.35	2.95
58	002528	英飞拓	8,122,356.32	2.78
59	300058	蓝色光标	8,098,499.25	2.77
60	000917	电广传媒	7,775,383.00	2.66
61	300020	银江股份	7,660,069.75	2.62
62	601688	华泰证券	7,648,728.80	2.62
63	600418	XD江淮汽	7,572,553.85	2.59
64	600030	中信证券	7,309,310.00	2.50
65	002305	南国置业	7,188,357.57	2.46
66	601628	中国人寿	6,932,645.00	2.37
67	601058	赛轮股份	6,672,054.20	2.29
68	300039	上海凯宝	6,595,643.82	2.26
69	000540	中天城投	6,465,240.67	2.21
70	601117	中国化学	6,389,069.38	2.19
71	600312	平高电气	6,188,214.28	2.12
72	600770	综艺股份	6,083,770.56	2.08
73	600184	光电股份	6,061,964.82	2.08

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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	1,293,802,303.04
卖出股票收入(成交)总额	1,294,565,326.14

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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、处罚的情形。

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	295,056.09
2	应收证券清算款	3,551,096.64
3	应收股利	–
4	应收利息	8,231.78
5	应收申购款	38,791.32
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,893,175.83

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。

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600552	方兴科技	9,462,000.00	3.45	非公开发行流通受限

投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
16,704	23,314.42	29,999,000.00	7.70%	359,445,058.83	92.30%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,857.57	0.0015%

注:截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金基金份额;本基金基金经理未持有本基金基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年6月18日)基金份额总额	999,184,191.71
本报告期期初基金份额总额	434,288,626.10
本报告期基金总申购份额	22,902,767.17
减:本报告期基金总赎回份额	67,747,334.44
本报告期期末基金份额总额	389,444,058.83

注:总申购份额包含红利再投、转换入份额;总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期未发生基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

10.4基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所有限公司自2010年6月18日期至今为本基金提供审计服务,本报告期内未发生变动。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生收监管部门稽查或处罚的情况。

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		应支付该券商的佣金		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	
中金公司	1	807,576,316.47	31.31%	723,624.96	31.00%	–
国联证券	1	570,759,014.52	22.13%	519,619.75	22.26%	–
华泰证券	1	508,586,637.62	19.72%	463,017.48	19.84%	–
浙商证券	1	324,804,820.64	12.59%	295,701.43	12.67%	–
招商证券	1	189,195,897.06	7.34%	170,269.80	7.29%	–
方正证券	1	178,044,942.87	6.90%	162,092.71	6.94%	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	–	–	–	–	–
华龙证券	2	–	–	–	–	–

注:选择专用席位的标准和程序:

(1)选择标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力:能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务;有很强的行业分析能力,能根据基金管理人所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力。

券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率:与其他券商经纪人相比,该券商经纪人能够提供最优惠、最合理的佣金率。

(2)选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定,选定的经纪人名单需经风险管理委员会审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时,要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等,经签章有效。委托代理协议一式三份,协议双方及证券主管机关各留存一份,基金管理人留存监察稽核部备案,并报中国证监会备案并公告。

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	–	–	–	–	–	–
国联证券	–	–	65,000,000.00	55.56%	–	–
华泰证券	–	–	52,000,000.00	44.44%	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
华龙证券	–	–	–	–	–	–

华商基金管理有限公司
2013年8月26日