基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月26日

汇添富上证综合指数证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,842,125,018.27份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

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		汇添富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

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	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼21层汇添富基金管理有限公司

§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	-113,315,594.05
本期利润	-463,992,374.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0845
本期基金份额净值增长率	-11.84%
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	-0.3304
期末基金资产净值	3,911,597,174.39
期末基金份额净值	0.670

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.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。

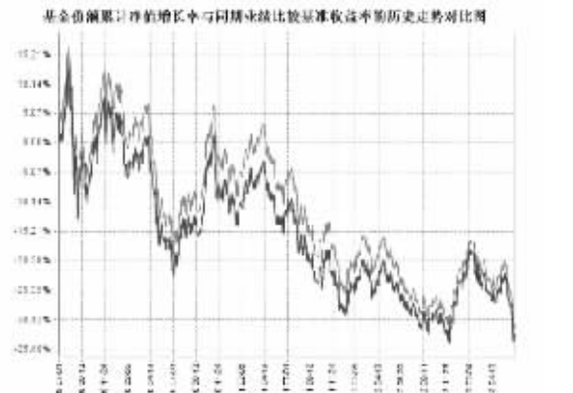
3.2 基金净值表现

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	-12.65%	1.53%	-13.27%	1.46%	0.62%	0.07%
过去三个月	-10.19%	1.17%	-10.93%	1.14%	0.74%	0.03%
过去六个月	-11.84%	1.22%	-12.13%	1.18%	0.29%	0.04%
过去一年	-8.97%	1.11%	-10.49%	1.09%	1.52%	0.02%
过去三年	-14.32%	1.14%	-16.54%	1.13%	2.22%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-33.00%	1.29%	-31.38%	1.28%	-1.62%	0.01%

注:本基金的《基金合同》生效日为2009年7月1日,至本报告期末未满五年。

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:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2009年7月1日)起3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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

汇添富基金管理有限公司由originally东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字[2005]5号文批准,于2005年2月3日正式成立,注册资本金为1亿元人民币。截止到2013年6月30日,公司管理证券投资基金规模逾650亿元,基金份额持有人户数近200万,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理33只开放式证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征、较为完善、有效的产品线,包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金(A级、B级)、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富亚洲微盘股股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富保本混合型证券投资基金、汇添富保本混合型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财30天债券型证券投资基金、汇添富理财60天债券型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财28天债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽30股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理,深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,金融工程部总监助理。	2010年2月5日	-	7年	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理有限公司任产品开发高级经理、数量投资高级分析师,现任金融工程部总监助理。2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理,2011年9月16日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2011年9月28日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
赖中立	汇添富上证综合指数、深证300ETF、汇添富深证300ETF联接基金的基金经理助理,汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的基金经理。	2012年2月15日	-	5年	国籍:中国,学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部分析师。2012年2月15日至今任汇添富上证综合指数基金、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理,2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人高度重视投资者利益保护,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》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场等各投资市场、债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保同日反向交易的监控和跟踪反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的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交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为2次,分别是由于基金流动性需要、专户组合到期清算卖出证券所致。

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

回顾上半年,年初宏观数据偏积极,虽然整体复苏动能仍较弱,在乐观情绪和估值修复的预期下,春节前市场延续了上涨行情。之后偏弱的PMI等宏观经济数据印证了实体经济复苏乏力,同时部分行业出现产能过剩,市场对经济复苏程度的担忧增加,对经济增长的预期下调。中央政府的一系列表态显示了对投资拉动增长的反思和经济结构转型的决心,降息打、降准未、海内落后产能在短期内增加了市场预期的不确定性。6月份,货币市场流动性紧缺暴露了部分金融机构信贷扩张导致的问题,同时美联储明确QE退出计划增加了市场对资金从新兴市场流出的担忧,在此内外影响下,A股市场在短期内大幅下跌,大量释放了恶劣情绪。

本基金遵循了指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性。本基金股票投资仓位在报告期内基本保持在92%-95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金对抽样复制组合继续采取缓冲式调整,以降低了冗余的交易量,我们将继续观察抽样复制方法在后续投资过程中的适用性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内上证综合指数下跌12.78%,本基金在报告期内累计收益率为-11.84%,同期业绩比较基准收益率为-12.13%,收益率领先业绩比较基准0.29%。收益率的差异因素主要来源于成份股分红、托管行股票替代、申购赎回、小股票替代组合与实际组合差异等因素的综合作用。本基金日均跟踪误差为0.0799%,这一跟踪误差水平远低于0.35%,在报告期达到了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间安徽经济将继续目前的弱复苏格局,通胀在低位运行,货币政策仍将保持中性。上报《防通胀”下报《稳增长、保就业”的政策基调松动潮,经济结构转型的决心明确,短期内从房地产投出发,流动性有所好转但仍将偏紧,信贷增速可能放缓,在降杠杆的背景下报刚出现刺激经济增长的大规模投资;中长期看有利的因素正在酝酿,下半年有打的三中全会将进一步明确改革思路,有望在财政、金融、城镇化等领域有所突破。随着市场预期的稳定,A股有可能有所表现。外围市场,短期在美日等国央行的量宽政策下,新兴经济体货币升值将削弱其出口竞争力,同时,随着美国QE的逐步退出,资金流入新兴市场的趋势将发生改变,这些因素将对新兴市场的权益类资产价格形成压制。整体看,短期全球经济复苏的基础依旧薄弱,但随着各国逐步通过经济改革和技术进步重塑其竞争实力,未来一段时间全球经济可能将继续维持弱复苏状态。

目前A股市场整体估值水平与历史和外围市场相比都处于低位,未来随着改革政策的进一步明确和实体经济的改善,估值水平有望回升,可能存在较好的投资机会。

作为被动投资的指数型基金,汇添富上证综合指数基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

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,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

4.6.3 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于2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年的经营成果和净值变动情况。

4.6.4 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一致。

4.6.5 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。

4.6.6 税项

1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券《股票》交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整出出让方按证券《股票》交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收。税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金、曾理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]83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》的规定,对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,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。”

4.6.7 关联方关系

4.6.7.1 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

本报告期内未发生与本基金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。

4.6.7.2 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
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金戎控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司

4.6.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

4.6.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

4.6.8.1.1 股票交易

金额单位: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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券股份有限公司	707,090,302.21	65.67%	177,083,892.84	100.00%

4.6.8.1.2 债券交易

金额单位: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	
	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
东方证券股份有限公司	390,660.00	3.95%	10,855,007.00	100.00%

4.6.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	643,733.34	65.67%	208,663.39	70.28%

关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	153,211.63	100.00%	129,977.45	100.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	15,462,914.10	17,558,788.91
其中:支付销售机构的客户维护费	3,288,738.42	3,349,124.57

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.75%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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	3,092,582.82	3,511,757.81

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.15%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

注:本基金与关联方本期和上年度可比期间未通过银行间同业市场进行债券(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

份额单位:份

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
基金合同生效日(2009年7月1日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	0.00	43,496,625.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	43,496,625.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注:本公司分别于2012年4月05日,2012年4月09日分别赎回本基金21,748,313.00份和21,748,312.00份,总计赎回43,496,625.00份。赎回费为0,符合招募说明书规定的赎回费率。

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

注:本报告期末除基金管理人之外的其它关联方未有投资本基金的情况。

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
中国工商银行股份有限公司	216,970,753.69	878,974.93	274,727,841.71	1,083,792.82

注:由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

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

注:本基金在本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601989	中国重工	2013年5月17日	重大事项停牌	4.52	-	-	3,547,449	18,149,128.48	16,034,469.48	-
600547	山东黄金	2013年4月3日	重组停牌	32.13	2013年7月1日	28.77	344,086	12,358,897.89	11,055,483.18	-
600688	S上石化	2013年6月28日	重大事项停牌	8.19	2013年8月20日	4.90	1,176,016	9,640,138.05	9,631,571.04	-
600871	S仪化	2013年6月28日	重大事项停牌	8.47	2013年8月20日	5.60	627,823	4,632,262.34	5,317,660.81	-
600087	*ST长油	2013年4月22日	重大事项停牌	1.63	-	-	2,635,273	8,786,731.89	4,295,494.99	-
600598	北大荒	2013年5月27日	重组停牌	8.35	2013年7月19日	8.35	429,858	5,616,183.05	3,589,314.30	-
601918	国投新集	2013年5月16日	重大事项停牌	7.55	-	-	447,473	7,119,798.04	3,378,421.15	-
601886	江河创建	2013年6月20日	重大事项停牌	13.22	2013年7月16日	13.78	143,750	1,885,077.34	1,900,375.00	-
600284	浦东建设	2013年6月24日	重组停牌	9.50	-	-	166,957	1,209,389.59	1,586,091.50	-
600807	天业股份	2013年1月7日	重组停牌	7.03	2013年7月17日	7.73	137,172	962,650.98	964,319.16	-
600175	美都控股	2013年5月29日	重大事项停牌	2.78	2013年7月12日	3.06	295,880	848,530.73	822,546.40	-

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

本基金本期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	3,490,721,815.77	88.59
	其中:股票	3,490,721,815.77	88.59
2	固定收益投资	1,738,434.00	0.04
	其中:债券	1,738,434.00	0.04
	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	216,970,753.69	5.51
6	其他各项资产	231,046,606.58	5.86
7	合计	3,940,477,610.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	19,800,371.75	0.51
B	采矿业	617,257,095.44	15.78
C	制造业	919,052,772.77	23.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,391,119.27	3.56
E	建筑业	112,482,682.62	2.88
F	批发和零售业	99,902,128.44	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	147,547,220.66	3.77
H	住宿和餐饮业	4,443,268.74	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,796,977.20	1.58
J	金融业	1,182,844,743.01	30.24
K	房地产业	116,581,531.70	2.98
L	租赁和商务服务业	12,032,429.68	0.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,623,721.86	0.19
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	26,189,228.43	0.67
S	综合	23,776,524.20	0.61
	合计	3,490,721,815.77	89.24

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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

代码	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	601857	中国石油	41,381,160	314,910,627.60	8.05
2	601288	XD农业银	79,968,443	196,722,369.78	5.03
3	601988	中国银行	58,318,197	158,042,313.87	4.04
4	600036	招商银行	8,946,821	103,783,123.60	2.65
5	600028	中国石化	23,556,706	98,467,031.08	2.52
6	600016	民生银行	10,425,008	89,342,318.56	2.28
7	601328	交通银行	21,637,059	88,062,830.13	2.25
8	601628	中国人寿	5,147,060	70,463,251.40	1.80
9	601166	兴业银行	4,727,120	69,819,562.40	1.78
10	601088	中国神华	4,076,103	69,049,184.82	1.77

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www.99fund.com网站的年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

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	601857	中国石油	55,537,680.26	1.22
2	601988	中国银行	42,591,159.90	0.94
3	601288	农业银行	36,109,838.96	0.79
4	600028	中国石化	27,715,413.73	0.61
5	600036	招商银行	26,020,313.20	0.57
6	600016	民生银行	25,299,311.78	0.56
7	601939	建设银行	13,041,153.26	0.29
8	601328	交通银行	10,139,671.00	0.22
9	601166	兴业银行	6,493,735.49	0.14
10	600000	浦发银行	6,220,624.36	0.14
11	600332	广州药业	4,756,556.20	0.10
12	600691	阳煤化工	4,182,193.30	0.09
13	603993	洛阳钼业	4,147,045.99	0.09
14	601628	中国人寿	3,860,605.09	0.08
15	601088	中国神华	3,769,984.10	0.08
16	600340	华夏幸福	2,938,318.60	0.06
17	601608	中信重工	2,674,831.00	0.06
18	601318	中国平安	2,215,843.50	0.05
19	600519	贵州茅台	2,173,195.37	0.05
20	601886	江河创建	1,885,077.34	0.04

注:买入金额按买卖成交金额填列,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	601857	中国石油	82,414,201.13	1.81
2	601988	中国银行	60,656,534.72	1.33
3	601288	农业银行	37,892,837.94	0.83
4	600036	招商银行	36,479,843.61	0.80
5	600028	中国石化	36,463,454.70	0.80
6	600016	民生银行	22,942,860.50	0.50
7	601939	建设银行	21,532,490.77	0.47
8	601328	交通银行	19,163,811.66	0.42
9	600000	浦发银行	15,895,367.38	0.35
10	601628	中国人寿	14,602,497.77	0.32
11	601088	中国神华	14,090,054.92	0.31
12	600315	上海家化	12,240,199.01	0.27
13	601166	兴业银行	8,376,528.79	0.18
14	601318	中国平安	8,082,747.96	0.18
15	600519	贵州茅台	6,616,284.37	0.15
16	600104	上汽集团	6,549,893.37	0.14
17	601998	中信银行	5,404,062.96	0.12
18	600030