基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	交通银行股份有限公司
送出日期：	2013年08月29日

汉兴证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

截至2013年6月30日，本基金份额净值为0.9161元，份额累计净值为2.4547元。报告期内，本基金份额净值增长率为-2.24%。

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2013年下半年，预期经济将保持一个不瘟不火的态势，不会出现年初的增长复苏态势，流动性的管理上也不会出现6月份的流动性危机，因此对市场的判断会是一个窄幅震荡的局面。下半年关注的一个方向是改革，特别是三中全会，将会为未来五到十年的发展描绘一个方向，对此需高度重视。下半年的投资方向上，将继续趋于保守。对已经呈现泡沫化的成长股，将在泡沫得到一定程度消化后，进行适当配置，重点方向将是影视传媒、军工等方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

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。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

§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

2013年上半年度，基金托管人在汉兴证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2013年上半年度，富国基金管理有限公司在汉兴证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2013年上半年度，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汉兴证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务报表（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汉兴证券投资基金

报告截止日：2013年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末（2013年06月30日）	上年度末（2012年12月31日）
资 产：		
银行存款	20,218,788.31	26,087,857.41
结算备付金	51,053,156.35	55,295,510.56
存出保证金	770,609.29	1,004,380.53
交易性金融资产	2,685,931,402.44	2,717,316,175.13
其中：股票投资	2,067,156,545.44	2,151,787,774.63
基金投资	–	–
债券投资	618,774,857.00	565,528,400.50
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	–	26,354,256.22
应收利息	11,724,336.84	7,318,696.39
应收股利	1,110,156.70	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	2,770,808,449.93	2,833,376,876.24
负债和所有者权益	本期末（2013年06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	14,432,031.12	13,398,495.36
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	3,588,889.30	3,338,910.45
应付托管费	598,148.20	556,485.11
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	1,727,885.58	2,457,582.59
应交税费	1,729,986.50	1,729,986.50
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	542,518.49	634,000.00
负债合计	22,619,459.19	22,115,460.01
所有者权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	-251,811,009.26	-188,738,583.77
所有者权益合计	2,748,188,990.74	2,811,261,416.23
负债和所有者权益总计	2,770,808,449.93	2,833,376,876.24

注：报告截止日2013年06月30日，基金份额净值0.9161元，基金份额总额3,000,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体：汉兴证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06月30日）
一、收入	-30,488,388.02	170,097,276.55
1.利息收入	10,973,790.21	10,247,740.59
其中：存款利息收入	444,644.79	392,350.38
债券利息收入	10,529,145.42	9,852,905.07
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	2,485.14
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	207,897,482.75	-122,096,223.71
其中：股票投资收益	186,327,311.75	-143,431,190.48
基金投资收益	–	–
债券投资收益	945,120.00	1,735,058.33
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具投资收益	–	–
股利收益	20,625,051.00	19,599,908.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-249,359,660.98	281,936,089.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	–	9,670.56
减：二、费用	32,584,037.47	32,109,002.20
1.管理人报酬	21,952,693.87	20,748,969.11
2.托管费	3,658,782.34	3,458,161.57
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	6,782,998.77	7,711,368.64
5.利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	189,562.49	190,502.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-63,072,425.49	137,988,274.35
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-63,072,425.49	137,988,274.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汉兴证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年06月30日

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06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）	3,000,000,000.00	-188,738,583.77	2,811,261,416.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-63,072,425.49	-63,072,425.49
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）	3,000,000,000.00	-251,811,009.26	2,748,188,990.74

项目	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06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）	3,000,000,000.00	-313,646,354.73	2,686,353,645.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	137,988,274.35	137,988,274.35
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）	3,000,000,000.00	-175,658,080.38	2,824,341,919.62

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：

陈敏　　林志松　　雷青松

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

汉兴证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字［1999］38号文《关于同意设立汉兴证券投资基金的批复》的核准，由海通证券股份有限公司（原名为海通证券有限公司）、华泰证券股份有限公司（原名为江苏证券有限责任公司）及富国基金管理有限公司于1999年12月24日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为30亿份基金份额。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证上字［2000］1号文审核同意，于2000年1月10日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于绩优型上市公司和债券的同时，兼顾成长型上市公司的投资，充分注重投资组合的流动性，从而为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全，谋求基金资产的长期稳定收益。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%，其中投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。

6.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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3号《半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。

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于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净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

6.4.5会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6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，调整由出让方按证券（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）管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、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字［2012］85号文《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，自2013年1月1日起，对于证券投资基金通过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。

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。

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

本报告期内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。

6.4.7.2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
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东
申银万国证券股份有限公司（“申银万国”）	基金管理人的股东
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下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

6.4.8.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）		上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06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（%）
海通证券	511,672,384.56	11.45	662,402,331.45	13.16
申银万国	477,913,018.64	10.69	927,202,804.77	18.43

6.4.8.1.2权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生权证交易。

6.4.8.1.3债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）		上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06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（%）
申银万国	–	–	16,108,255.00	20.59

6.4.8.1.4回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生回购交易。

6.4.8.1.5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01月01日至2013年06月30日）			
	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（%）
海通证券	452,779.05	11.28	224,122.14	12.97
申银万国	434,296.92	10.82	57,455.49	3.33
关联方名称	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06月30日）			
	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（%）
海通证券	540,361.69	12.77	234,023.68	10.06
申银万国	781,035.75	18.46	487,617.13	20.95

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01月01日至2013年06月30日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	21,952,693.87	20,748,969.11
其中：支付销售机构的客户维护费	–	–

注：基金管理人的管理费每日计算，按前一日基金资产净值的1.50%（年费率计提，基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的20%，超出部分不计提管理费。计算方法为：

H=E＊1.50%/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（扣除基金持有现金比例超过20%部分的资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	3,658,782.34	3,458,161.57

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

H=E×0.25%/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。

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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生关联方银行间债券（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

份额单位：份

项目	本期（2013年01月01日至2013年06月30日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06月30日）
基金合同生效日（1999年12月30日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
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	–	–
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.33%	0.33%

注：本基金管理人作为本基金发起人之一在本基金发行期间认购1000万份额，其认购费率是公允的。

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06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（%）
海通证券	5,000,000.00	0.17	5,000,000.00	0.17

注：表中关联方持有基金份额是其作为本基金发起人在本基金发行期间认购的，其认购费率是公允的。

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01月01日至2013年06月30日）		上年度可比期间（2012年01月01日至2012年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	20,218,788.31	83,088.12	6,431,840.09	100,979.10

注：本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金余额2013年上半年末为51,053,156.35元，2012年上半年末为26,895,028.97元。

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：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.9期末（2013年06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：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600547	山东黄金	2013-04-03	筹划重大事项	32.13	2013-07-01	28.77	20,000	783,599.80	642,600.00	–

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

注：截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额；没有因正回购而作为抵押的银行间市场债券。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额；没有因交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

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	2,067,156,545.44	74.60
	其中：股票	2,067,156,545.44	74.60
2	固定收益投资	618,774,857.00	22.33
	其中：债券	618,774,857.00	22.33
	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	71,271,944.66	2.57
6	其他各项资产	13,605,102.83	0.49
7	合计	2,770,808,449.93	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	6,508,256.66	0.24
B	采矿业	642,600.00	0.02
C	制造业	982,887,683.91	35.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	175,062,887.34	6.37
E	建筑业	102,612,552.06	3.73
F	批发和零售业	76,115,629.36	2.77
G	交通运输、仓储和邮政业	4,470,000.00	0.16
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	97,588,829.76	3.55
J	金融业	384,683,951.54	14.00
K	房地产业	215,843,654.81	7.85
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	4,840,500.00	0.18
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	15,900,000.00	0.58
	合计	2,067,156,545.44	75.22

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	600887	伊利股份	2,355,380	73,676,286.40	2.68
2	601318	中国平安	2,040,158	70,915,892.08	2.58
3	300257	开山股份	2,100,000	69,615,000.00	2.53
4	601166	兴业银行	4,699,932	69,417,995.64	2.53
5	600048	保利地产	6,890,662	68,286,460.42	2.48
6	000002	万 科A	6,915,375	68,116,443.75	2.48
7	000669	金鸿能源	1,735,300	65,663,752.00	2.39
8	002422	科伦药业	1,213,290	64,680,489.90	2.35
9	000887	中鼎股份	9,836,656	61,970,932.80	2.25
10	600570	恒生电子	4,950,967	61,887,087.50	2.25

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限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	000858	五粮液	62,328,172.95	2.22
2	600036	招商银行	59,074,097.93	2.10
3	600048	保利地产	58,230,176.09	2.07
4	601166	兴业银行	53,754,823.56	1.91
5	600143	金发科技	48,055,732.84	1.71
6	000012	南玻A	46,232,972.00	1.64
7	300034	钢研高纳	36,537,573.44	1.30
8	002550	千红制药	35,170,913.45	1.25
9	600271	航天信息	32,898,446.91	1.17
10	000581	威孚高科	32,375,966.43	1.15
11	600089	特变电工	32,360,768.70	1.15
12	600000	浦发银行	32,283,918.15	1.15
13	600104	上汽集团	31,430,117.66	1.12
14	000776	广发证券	30,576,270.33	1.09
15	300207	欣旺达	28,734,373.05	1.02
16	601669	中国水电	28,624,912.58	1.02
17	601992	金隅股份	28,601,680.20	1.02
18	600016	民生银行	28,105,000.00	1.00
19	000513	丽珠集团	27,982,870.87	1.00
20	000651	格力电器	26,618,430.46	0.95

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	300146	汤臣倍健	87,644,199.78	3.12
2	600521	华海药业	69,875,911.98	2.49
3	600036	招商银行	68,808,411.72	2.45
4	000012	南玻A	43,477,073.66	1.55
5	600519	贵州茅台	41,990,504.75	1.49
6	002482	广田股份	41,642,472.68	1.48
7	600694	大商股份	36,707,620.74	1.31
8	600267	海正药业	35,711,060.80	1.27
9	300110	华仁药业	34,453,739.18	1.23
10	600271	航天信息	33,350,686.24	1.19
11	000725	京东方A	32,673,329.00	1.16
12	300182	捷成股份	32,483,233.48	1.16
13	600418	江淮汽车	31,405,548.86	1.12
14	300207	欣旺达	30,875,265.28	1.10
15	600048	保利地产	28,901,601.71	1.03
16	000671	阳光城	27,871,174.71	0.99
17	601788	光大证券	27,456,777.80	0.98
18	000937	冀中能源	25,921,869.46	0.92
19	600089	特变电工	25,392,855.80	0.90
20	000157	中联重科	25,181,535.52	0.90

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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	2,223,306,572.99
卖出股票收入（成交）总额	2,246,575,876.45

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	95,047,857.00	3.46
2	央行票据	19,978,000.00	0.73
3	金融债券	503,749,000.00	18.33
	其中：政策性金融债	503,749,000.00	18.33
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	618,774,857.00	22.52

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010308	03国债(8)	951,430	95,047,857.00	3.46
2	120318	12进出18	600,000	59,736,000.00	2.17
3	120419	12农发19	600,000	59,712,000.00	2.17
4	110258	11国开58	500,000	50,370,000.00	1.83
5	130218	13国开18	500,000	49,715,000.00	1.81

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.10投资组合报告附注

7.10.1申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

本期，本基金持有的科伦药业于2013年5月21日公告其于2013年5月20日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（稽查总队调查通字13139号），因其公司涉嫌信息披露违法违规，故中国证监会对其立案调查。

本期，本基金持有的中国平安于2013年5月21日公告其集团控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于近日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》，中国证监会对平安证券给予警告及行政处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

7.10.2申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.10.3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	770,609.29
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	1,110,156.70
4	应收利息	11,724,336.84
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	13,605,102.83

7.10.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§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（%）
45365	66,130.28	2,153,688,211.00	71.79	846,311,789.00	28.21

8.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国人寿保险（集团）公司	283,658,776	9.46
2	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002沪	191,200,336	6.37
3	中国太平洋财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品-013C-CT001沪	186,040,829	6.20
4	中国人寿保险股份有限公司	162,389,226	5.41
5	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	146,258,784	4.88
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	83,447,144	2.78
7	渤海证券股份有限公司	73,456,000	2.45
8	中国人寿保险股份有限公司	69,355,431	2.31
9	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	54,843,872	1.83
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	54,636,885	1.82

8.5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	0.00	0.0000

注：1、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。

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§9 重大事件揭示

9.1基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

9.2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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于