

# 中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）

## 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 26 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。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| 1 重要提示及目录.....                               | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| 2 基金简介.....                                  | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| 3 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| 4 管理人报告.....                                 | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 9  |
| 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.....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11 |
| 5 托管人报告.....                                 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12 |
| 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.....     | 12 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                       | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 16 |
| 7 投资组合报告.....                                | 30 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 30 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 31 |
| 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.....       | 32 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 38 |
| 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.....      | 38 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....   | 39 |
| 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.....      | 39 |
| 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                | 39 |

|                                       |    |
|---------------------------------------|----|
| 7.10 投资组合报告附注.....                    | 39 |
| 8 基金份额持有人信息.....                      | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....            | 40 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                 | 40 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....         | 41 |
| 9 开放式基金份额变动.....                      | 41 |
| 10 重大事件揭示.....                        | 41 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                 | 41 |
| 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..... | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....      | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                   | 42 |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....              | 42 |
| 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.....    | 42 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....           | 42 |
| 10.8 其他重大事件.....                      | 43 |
| 11 备查文件目录.....                        | 44 |
| 11.1 备查文件目录.....                      | 44 |
| 11.2 存放地点.....                        | 44 |
| 11.3 查阅方式.....                        | 45 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）     |
| 基金简称         | 中欧新动力股票（LOF）（场内简称：中欧动力） |
| 基金主代码        | 166009                  |
| 交易代码         | 166009                  |
| 基金运作方式       | 契约型上市开放式（LOF）           |
| 基金合同生效日      | 2011年2月10日              |
| 基金管理人        | 中欧基金管理有限公司              |
| 基金托管人        | 中国光大银行股份有限公司            |
| 报告期末基金份额总额   | 1,109,279,738.83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         | 2011年4月29日              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过投资于促进中国经济发展方式加快转变的新动力行业和上市公司，以求充分分享中国经济未来持续发展的成果并力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的回报。          |
| 投资策略   | 本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。在资产配置方面，自上而下地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在投资品种选择方面，自下而上地选择具有投资价值的证券品种。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%  |
| 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、较高收益的投资品种，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。                        |

### 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      | 中欧基金管理有限公司                       |                     | 中国光大银行股份有限公司                     |
| 信息披露负责人 | 姓名                               | 黎忆海                 | 张建春                              |
|         | 联系电话                             | 021-68609600        | 010-63639180                     |
|         | 电子邮箱                             | liyihai@lcfunds.com | zhangjianchun@cebbank.com        |
| 客户服务电话  | 021-68609700、<br>400-700-9700    |                     | 95595                            |
| 传真      | 021-33830351                     |                     | 010-63639132                     |
| 注册地址    | 上海市浦东新区花园石桥路<br>66 号东亚银行金融大厦 8 层 |                     | 北京市西城区太平桥大街 25<br>号、甲 25 号中国光大中心 |
| 办公地址    | 上海市浦东新区花园石桥路<br>66 号东亚银行金融大厦 8 层 |                     | 北京市西城区太平桥大街 25<br>号、甲 25 号中国光大中心 |
| 邮政编码    | 200120                           |                     | 100033                           |
| 法定代表人   | 唐步                               |                     | 唐双宁                              |

## 2.4 信息披露方式

|                          |                        |
|--------------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人<br>互联网网址 | www.lcfunds.com        |
| 基金半年度报告备置地点              | 基金管理人、基金托管人的办公场所       |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址               |
|--------|----------------|--------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 中国北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## 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 日至 2013 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 54,453,040.53                        |
| 本期利润          | 17,680,490.82                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0193                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.89%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.56%                                |
| 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      | -3,510,653.40                        |

|                     |                         |
|---------------------|-------------------------|
| 期末可供分配基金份额利润        | -0.0032                 |
| 期末基金资产净值            | 1,105,769,085.43        |
| 期末基金份额净值            | 0.9968                  |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | <b>报告期末(2013年6月30日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率         | -0.32%                  |

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、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（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。

### 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      | -9.63%   | 1.65%       | -11.94%    | 1.41%         | 2.31%  | 0.24% |
| 过去三个月      | 0.28%    | 1.30%       | -8.66%     | 1.09%         | 8.94%  | 0.21% |
| 过去六个月      | 3.56%    | 1.23%       | -8.98%     | 1.13%         | 12.54% | 0.10% |
| 过去一年       | 4.02%    | 1.16%       | -7.02%     | 1.03%         | 11.04% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.32%   | 1.18%       | -18.31%    | 0.99%         | 17.99% | 0.19% |

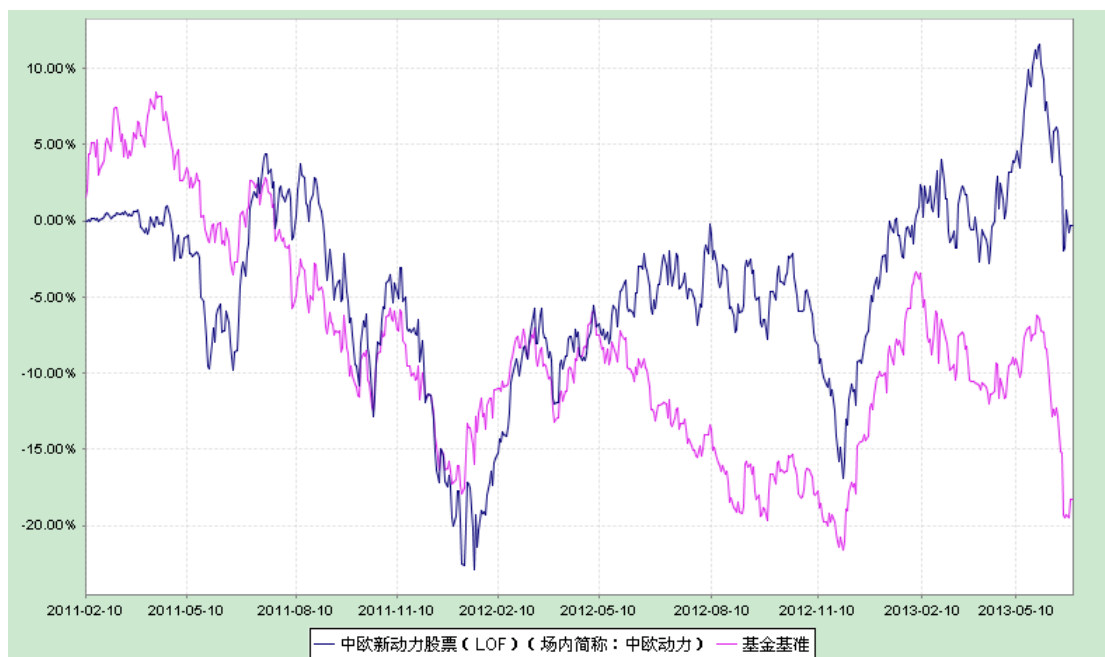
注：本基金大类资产的投资比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%-95%，其中权证资产比例不超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不少于基金资产净值的 5%。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围，我们选择将本基金主要投资的两个大类资产即股票资产和债券资产的市场表现组合成比较基准表现作为基金业绩的参照。在代表大类资产表现的标的指数选择上，我们选择了具有较强代表性的沪深 300 指数和中证全债指数作为两大类资产的标的指数。比较基准中股票和债券类资产的权重分配以基金该类资产可投资比例范围的中值作为基本参考，最终具体比例为股票部分 75%，债券部分 25%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

#### 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

中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2011年2月10日至2013年6月30日）



注：本基金合同生效日为 2011 年 2 月 10 日，建仓期为 2011 年 2 月 10 日至 2011 年 8 月 9 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

#### 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

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券有限责任公司、北京百骏投资有限公司、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为 1.88 亿元人民币。截至 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 14 只开放式基金，即中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧价值发现股票型证券投资基金、中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）、中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金（LOF）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金、中欧货币市场基金、中欧纯债分级债券型证券投资基金和中欧价值智选回报混合型证券投资基金。

##### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 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 |     |  |
|-----|---|------------|------|-----|--|
| 苟开红 | 本基金基金经理，中欧价值发现股票型证券投资基金基金经理，中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金经理，权益投资部总监 | 2011-02-10 | -    | 7 年 | 博士，特许金融分析师（CFA），中国注册会计师协会非执业会员，持有中国非执业律师资格。历任深圳华为技术有限公司市场财经部高级业务经理，上海荣正投资咨询有限公司总经理助理，上海亚商企业咨询有限公司投资银行部业务经理，华泰资产管理公司高级投资经理、研究部副总经理。2009 年 7 月加入中欧基金管理有限公司，任中欧价值发现股票型证券投资基金基金经理、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金经理，权益投资部总监。 |

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非

公平交易的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合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% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 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

“艰难时刻”，可能用这四个字形容我们的上半年最为贴切。今年以来，市场风格出现了相对极端的分化，在创业板指数上涨 41.72% 的情况下沪深 300 指数下跌 12.78%，两者差达到了 54.5%，个股之间的差距更是天壤之别，很多主题和概念股出现非常大的涨幅，部分周期和价值股却持续在下跌，而且更严重的是越来越多的投资人加入追逐概念和主题的行列，导致这种分化在上半年是随着时间推移不断在加剧，个股泡沫不断严重。一直以来坚持的安全边际、合理估值、谨慎投资原则使得我们在上半年不买入或者不断减持了大多数的概念股，并买入部分价值股，这也导致了基金业绩虽然大幅跑赢基准却输于同行，我们对未能为持有人赚取更多收益深表歉意，但是我们更不能以持有人的资金冒险买入已经明显高估的资产。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为 3.56%，同期业绩比较基准增长率为-8.98%，基金投资收益高于同期业绩比较基准。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济正处于转型期，宏观长周期向下正不断得以数据验证并深入人心，经过多年调整后目前整个市场处于整体低估而局部泡沫的情况，整体市场已经在一定的程度上反映了经济下行后的增速，因此我们相对乐观。但是今年以来市场对于转型憧憬的炒作正逐步进入泡沫化的阶段，“预期市场空间”和“不能短期证伪”成为部分个股不断走高的理由，当然也许会有公司真的能成长到与当前的市值相匹配，但那一定是极其少数。只是我们无法预期这样的情况还会持续多久，又会以什么样的方式结束。冷静理性、安全边际、基本面研究、合理估值这些陪伴我们多年的投资原则让我们处于基金成立以来最艰难的时刻，但我们相信这

些坚持最终会引领我们走出迷雾。

#### 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，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、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，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。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。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无需实施利润分配。

### 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

中国光大银行在中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）的投资运作进行了全面的会计核算和应有

的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——中欧基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际情况进行处理。

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

中国光大银行依法对基金管理人——中欧基金管理有限公司编制的“中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）2013 年半年报”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

# 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：中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）

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<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：     |         |                        |                          |
| 银行存款    | 6.4.7.1 | 15,173,203.89          | 12,027,707.25            |
| 结算备付金   |         | 5,350,973.55           | 2,153,450.67             |
| 存出保证金   |         | 490,832.58             | 750,000.00               |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,042,551,959.85       | 460,446,438.56           |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资         |            | 977,160,459.85            | 430,443,438.56              |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 65,391,500.00             | 30,003,000.00               |
| 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    | 50,000,000.00             | 215,000,000.00              |
| 应收证券清算款         |            | 443,146.49                | 11,917,029.15               |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 859,103.15                | 663,567.85                  |
| 应收股利            |            | 380,948.67                | -                           |
| 应收申购款           |            | 80,560.18                 | 1,055,933.14                |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 1,115,330,728.36          | 704,014,126.62              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2013年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2012年12月31日</b> |
| 负 债：            |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          |            | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 6,066,874.63              | -                           |
| 应付赎回款           |            | 452,183.47                | 119,194.27                  |
| 应付管理人报酬         |            | 1,325,056.13              | 732,547.29                  |
| 应付托管费           |            | 220,842.69                | 122,091.19                  |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 777,834.22                | 403,131.57                  |
| 应交税费            |            | -                         | -                           |
| 应付利息            |            | -                         | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 718,851.79                | 850,340.77                  |
| 负债合计            |            | 9,561,642.93              | 2,227,305.09                |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 1,109,279,738.83          | 729,146,948.63              |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | -3,510,653.40             | -27,360,127.10              |
| 所有者权益合计         |            | 1,105,769,085.43          | 701,786,821.53              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,115,330,728.36          | 704,014,126.62              |

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9968 元，基金份额总额 1,109,279,738.83 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）

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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至 2012<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>28,507,030.24</b>                     | <b>39,607,459.15</b>                          |
| 1.利息收入                     |          | 2,367,585.43                             | 417,179.23                                    |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 466,503.73                               | 123,644.87                                    |
| 债券利息收入                     |          | 578,882.18                               | 178,027.79                                    |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 1,322,199.52                             | 115,506.57                                    |
| 其他利息收入                     |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 62,828,765.22                            | -17,929,485.25                                |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 55,363,335.04                            | -19,119,187.72                                |
| 基金投资收益                     |          | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | -57,910.00                               | 19,530.00                                     |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 7,523,340.18                             | 1,170,172.47                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -36,772,549.71                           | 57,075,962.03                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 83,229.30                                | 43,803.14                                     |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>10,826,539.42</b>                     | <b>2,745,327.31</b>                           |
| 1. 管理人报酬                   |          | 6,914,447.89                             | 1,800,151.39                                  |
| 2. 托管费                     |          | 1,152,408.02                             | 300,025.23                                    |
| 3. 销售服务费                   |          | -  | -   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 2,533,325.54                             | 422,076.99                                    |
| 5. 利息支出                    |          | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -  | -   |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 226,357.97                               | 223,073.70                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>17,680,490.82</b>                     | <b>36,862,131.84</b>                          |
| 减：所得税费用                    |          | -  | -   |

|                   |  |               |               |
|-------------------|--|---------------|---------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 17,680,490.82 | 36,862,131.84 |
|-------------------|--|---------------|---------------|

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）

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<br>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）                        | 729,146,948.63                             | -27,360,127.10 | 701,786,821.53   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 17,680,490.82  | 17,680,490.82    |
| 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）      | 380,132,790.20                             | 6,168,982.88   | 386,301,773.08   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 505,306,260.73                             | 11,759,095.81  | 517,065,356.54   |
| 2. 基金赎回款                               | -125,173,470.53                            | -5,590,112.93  | -130,763,583.46  |
| 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）                        | 1,109,279,738.83                           | -3,510,653.40  | 1,105,769,085.43 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 271,137,342.04                             | -47,992,038.87 | 223,145,303.17   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 36,862,131.84  | 36,862,131.84    |
| 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）      | -9,228,228.94                              | 208,203.10     | -9,020,025.84    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 36,164,144.58                              | -3,943,455.06  | 32,220,689.52    |
| 2. 基金赎回款                               | -45,392,373.52                             | 4,151,658.16   | -41,240,715.36   |
| 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）             | 261,909,113.10 | -10,921,703.93 | 250,987,409.17 |

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：

基金管理人负责人：刘建平，主管会计工作负责人：黄峰，会计机构负责人：丁驿雯

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）（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 1646 号《关于核准中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》核准，由中欧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《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 401,695,362.31 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(2011)第 059 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2011 年 2 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 401,864,609.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 169,246.94 份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2011]第 128 号文审核同意，本基金 37,660,933 份基金份额于 2011 年 4 月 29 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)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、权证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。基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于新动力主题的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%，权证资产比例不超过基金资产净值



的 3%；债券等固定收益类资产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占基金资产的 5%–40%，其中现金或者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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于 2013 年 8 月 28 日批准报出。

#### 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧新动力股票型证券投资基金 (LOF) 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

本基金 2013 年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 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日半年度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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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[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

于优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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) 对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) 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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

(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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 15,173,203.89          |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 15,173,203.89          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2013年6月30日 |                  |                |
|--------|-------|-------------------|------------------|----------------|
|        |       | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票     |       | 992,737,098.25    | 977,160,459.85   | -15,576,638.40 |
| 债券     | 交易所市场 | 15,079,879.45     | 15,592,500.00    | 512,620.55     |
|        | 银行间市场 | 49,889,200.00     | 49,799,000.00    | -90,200.00     |
|        | 合计    | 64,969,079.45     | 65,391,500.00    | 422,420.55     |
| 资产支持证券 |       | -                 | -                | -              |
| 基金     |       | -                 | -                | -              |
| 其他     |       | -                 | -                | -              |
| 合计     |       | 1,057,706,177.70  | 1,042,551,959.85 | -15,154,217.85 |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 50,000,000.00          | -         |
| 银行间市场 | -                      | -         |
| 合计    | 50,000,000.00          | -         |

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 4,899.25               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 2,167.20               |
| 应收债券利息     | 834,301.37             |
| 应收买入返售证券利息 | 17,536.10              |
| 应收申购款利息    | 0.42                   |
| 其他         | 198.81                 |
| 合计         | 859,103.15             |

**6.4.7.6 其他资产**

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 777,484.22             |
| 银行间市场应付交易费用 | 350.00                 |
| 合计          | 777,834.22             |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 500,000.00             |
| 应付赎回费       | 1,493.82               |
| 应付信息披露费     | 152,893.01             |

|       |            |
|-------|------------|
| 应付审计费 | 34,712.18  |
| 预提上市费 | 29,752.78  |
| 合计    | 718,851.79 |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 729,146,948.63                        | 729,146,948.63   |
| 本期申购          | 505,306,260.73                        | 505,306,260.73   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -125,173,470.53                       | -125,173,470.53  |
| 本期末           | 1,109,279,738.83                      | 1,109,279,738.83 |

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2013 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 5,095,521.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 1,104,184,217.83 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | -45,693,362.46 | 18,333,235.36  | -27,360,127.10 |
| 本期利润           | 54,453,040.53  | -36,772,549.71 | 17,680,490.82  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,185,146.42  | 15,354,129.30  | 6,168,982.88   |
| 其中：基金申购款       | -11,740,572.74 | 23,499,668.55  | 11,759,095.81  |
| 基金赎回款          | 2,555,426.32   | -8,145,539.25  | -5,590,112.93  |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | -425,468.35    | -3,085,185.05  | -3,510,653.40  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |            |
|-----------|---------------------------------------|------------|
|           | 活期存款利息收入                              | 424,834.27 |
| 定期存款利息收入  | -                                     |            |
| 其他存款利息收入  | -                                     |            |
| 结算备付金利息收入 | 25,096.00                             |            |
| 其他        | 16,573.46                             |            |
| 合计        | 466,503.73                            |            |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2013年1月1日至2013年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 657,142,990.22       |
| 减：卖出股票成本总额 | 601,779,655.18       |
| 买卖股票差价收入   | 55,363,335.04        |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2013年1月1日至2013年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 10,417,000.00        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,057,910.00        |
| 减：应收利息总额               | 417,000.00           |
| 债券投资收益                 | -57,910.00           |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                   |
|-------------|----------------------|
|             | 2013年1月1日至2013年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 7,523,340.18         |
| 基金投资产生的股利收益 | -                    |
| 合计          | 7,523,340.18         |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2013年1月1日至2013年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -36,772,549.71       |
| ——股票投资     | -37,261,080.26       |
| ——债券投资     | 488,530.55           |
| ——资产支持证券投资 | -                    |
| ——基金投资     | -                    |
| 2. 衍生工具    | -                    |
| ——权证投资     | -                    |
| 3. 其他      | -                    |
| 合计         | -36,772,549.71       |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 40,486.24                  |
| 转换费收入   | 42,743.06                  |
| 合计      | 83,229.30                  |

注：1. 本基金的场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,532,800.54               |
| 银行间市场交易费用 | 525.00                     |
| 合计        | 2,533,325.54               |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用   | 34,712.18                  |
| 信息披露费  | 152,893.01                 |
| 上市费    | 29,752.78                  |
| 账户维护费用 | 9,000.00                   |
| 合计     | 226,357.97                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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，经中国证监会证监许可[2013]240 号文核准，中欧基金管理有限公司新增北京百骏投资有限公司为本基金管理人股东，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方均未发生变化。

##### 6.4.9.2 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         |
|------------------------|-----------------|
| 中欧基金管理有限公司             | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”） | 基金托管人、基金代销机构    |
| 国都证券有限责任公司（“国都证券”）     | 基金管理人的股东、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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>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  | 6,914,447.89               | 1,800,151.39                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 363,819.60                 | 375,399.38                      |

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 1,152,408.02               | 300,025.23                      |

注：支付基金托管人中国光大银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 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                   | 上年度可比期间              |
|-------------------|----------------------|----------------------|
|                   | 2013年1月1日至2013年6月30日 | 2012年1月1日至2012年6月30日 |
| 期初持有的基金份额         | -                    | -                    |
| 期间申购/买入总份额        | 2,932,001.69         | -                    |
| 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         | 2,932,001.69         | -                    |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.26%                | -                    |

注：本基金管理人本报告期内申购本基金的交易委托国都证券办理，所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

**6.4.10.4.2 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<br>2013年6月30日 |                              | 上年度末<br>2012年12月31日 |                          |
|-------|-------------------|------------------------------|---------------------|--------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 |
| 国都证券  | -                 | -                            | 4,968,197.18        | 0.68%                    |

注：国都证券投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

**6.4.10.5 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                   |            | 上年度可比期间              |            |
|--------|----------------------|------------|----------------------|------------|
|        | 2013年1月1日至2013年6月30日 |            | 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     |
| 中国光大银行 | 15,173,203.89        | 424,834.27 | 7,899,654.04         | 123,644.87 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。



6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 601886 | 江河创建 | 2013-06-20 | 公告重大事项 | 13.22  | 2013-07-16 | 13.78  | 529,000 | 5,887,098.24 | 6,993,380.00 | -  |
| 002322 | 理工监测 | 2013-06-06 | 公告重大事项 | 14.62  | 2013-08-08 | 13.80  | 360,000 | 5,208,163.11 | 5,263,200.00 | -  |
| 300020 | 银江股份 | 2013-06-03 | 公告重大事项 | 22.67  | -          | -      | 245,500 | 4,154,059.74 | 5,565,485.00 | -  |

注：1、本基金截至 2013 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

2、截至本报告披露日，银江股份(300020)尚未复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的投资品种，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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、权证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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过投资于促进中国经济发展方式加快转变的新动力行业和上市公司，以求充分分享中国经济未来持续增长的成果并力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部

门开展监察稽核工作,根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查,出具监察稽核报告,进而从合规层面对基金投资进行风险控制。公司设立金融工程部,负责进行风险的实时监控和定期计算,并定期出具基金投资业绩和风险分析报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行股份有限公司,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

于2013年6月30日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为1.41%(2012年12月31日:无)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2013年6月30日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上          | 不计息            | 合计               |
|-------------------|----------------|------|---------------|----------------|------------------|
| 资产                |                |      |               |                |                  |
| 银行存款              | 15,173,203.89  | -    | -             | -              | 15,173,203.89    |
| 结算备付金             | 5,350,973.55   | -    | -             | -              | 5,350,973.55     |
| 存出保证金             | 490,832.58     | -    | -             | -              | 490,832.58       |
| 交易性金融资产           | 49,799,000.00  | -    | 15,592,500.00 | 977,160,459.85 | 1,042,551,959.85 |
| 买入返售金融资产          | 50,000,000.00  | -    | -             | -              | 50,000,000.00    |
| 应收证券清算款           | -              | -    | -             | 443,146.49     | 443,146.49       |
| 应收利息              | 0.42           | -    | -             | 859,103.07     | 859,103.49       |
| 应收申购款             | -              | -    | -             | 80,560.18      | 80,560.18        |
| 资产总计              | 120,814,010.44 | -    | 15,592,500.00 | 978,543,269.59 | 1,114,949,780.03 |
| 负债                |                |      |               |                |                  |
| 应付证券清算款           | -              | -    | -             | 6,066,874.63   | 6,066,874.63     |
| 应付赎回款             | -              | -    | -             | 452,183.47     | 452,183.47       |
| 应付管理人报酬           | -              | -    | -             | 1,325,056.13   | 1,325,056.13     |
| 应付托管费             | -              | -    | -             | 220,842.69     | 220,842.69       |
| 应付交易费用            | -              | -    | -             | 777,834.22     | 777,834.22       |
| 其他负债              | -              | -    | -             | 718,851.79     | 718,851.79       |
| 负债总计              | -              | -    | -             | 9,561,642.93   | 9,561,642.93     |
| 利率敏感度缺口           | 120,814,010.44 | -    | 15,592,500.00 | 968,981,626.66 | 1,105,388,137.10 |
| 上年度末              | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上          | 不计息            | 合计               |

|             |                |   |   |                |                |
|-------------|----------------|---|---|----------------|----------------|
| 2012年12月31日 |                |   |   |                |                |
| 资产          |                |   |   |                |                |
| 银行存款        | 12,027,707.25  | - | - | -              | 12,027,707.25  |
| 结算备付金       | 2,153,450.67   | - | - | -              | 2,153,450.67   |
| 存出保证金       | -              | - | - | 750,000.00     | 750,000.00     |
| 交易性金融资产     | 30,003,000.00  | - | - | 430,443,438.56 | 460,446,438.56 |
| 买入返售金融资产    | 215,000,000.00 | - | - | -              | 215,000,000.00 |
| 应收证券清算款     | -              | - | - | 11,917,029.15  | 11,917,029.15  |
| 应收利息        | -              | - | - | 663,567.85     | 663,567.85     |
| 应收申购款       | 2,485.09       | - | - | 1,053,448.05   | 1,055,933.14   |
| 资产总计        | 259,186,643.01 | - | - | 444,827,483.61 | 704,014,126.62 |
| 负债          |                |   |   |                |                |
| 应付赎回款       | -              | - | - | 119,194.27     | 119,194.27     |
| 应付管理人报酬     | -              | - | - | 732,547.29     | 732,547.29     |
| 应付托管费       | -              | - | - | 122,091.19     | 122,091.19     |
| 应付交易费用      | -              | - | - | 403,131.57     | 403,131.57     |
| 其他负债        | -              | - | - | 850,340.77     | 850,340.77     |
| 负债总计        | -              | - | - | 2,227,305.09   | 2,227,305.09   |
| 利率敏感度缺口     | 259,186,643.01 | - | - | 442,600,178.52 | 701,786,821.53 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.91% (2012 年 12 月 31 日：4.28%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2012 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情

况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。在资产配置方面，自上而下地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在投资品种选择方面，自下而上地选择具有投资价值的证券品种。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，债券等固定收益类资产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占基金资产的 5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |                      |
|--------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|              | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 977,160,459.85         | 88.37                | 430,443,438.56           | 61.34                |
| 衍生金融资产-权证投资  | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 其他           | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 合计           | 977,160,459.85         | 88.37                | 430,443,438.56           | 61.34                |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变 |                            |                          |
|----|-------------------------------|----------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                     | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币) |                          |
|    |                               | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日     | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|    | 1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升5%       | 增加约4,335.86万元              | 增加约3,839.76万元            |
|    | 2. 业绩比较基准(附注                  | 减少约4,335.86万元              | 减少约3,839.76万元            |

6.4.1) 下降5%

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## (1) 公允价值

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

## (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 974,930,894.85 元,属于第二层级的余额为 67,621,065.00 元,无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日: 第一层级 430,443,438.56 元,第二层级 30,003,000.00 元,无第三层级)。

## (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

## (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,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              | 977,160,459.85   | 87.61         |
|    | 其中：股票             | 977,160,459.85   | 87.61         |
| 2  | 固定收益投资            | 65,391,500.00    | 5.86          |
|    | 其中：债券             | 65,391,500.00    | 5.86          |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 3  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 4  | 买入返售金融资产          | 50,000,000.00    | 4.48          |
|    | 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      | 20,524,177.44    | 1.84          |
| 6  | 其他各项资产            | 2,254,591.07     | 0.20          |
| 7  | 合计                | 1,115,330,728.36 | 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           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 3,678,217.34   | 0.33          |
| B  | 采矿业              | 3,357,000.00   | 0.30          |
| C  | 制造业              | 671,228,788.93 | 60.70         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,464,246.00  | 1.04          |
| E  | 建筑业              | 81,132,389.12  | 7.34          |
| F  | 批发和零售业           | 19,364,481.31  | 1.75          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,828,282.68   | 0.62          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 74,491,432.67  | 6.74          |
| J  | 金融业              | 33,408,030.00  | 3.02          |
| K  | 房地产业             | 24,093,057.00  | 2.18          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,073,050.00   | 0.19          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 25,710,357.12  | 2.33          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 20,331,127.68  | 1.84          |
| 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 | 977,160,459.85 | 88.37 |
|--|----|----------------|-------|

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

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<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 600312 | 平高电气  | 1,679,859 | 15,488,299.98 | 1.40                 |
| 2  | 000858 | 五 粮 液 | 706,000   | 14,148,240.00 | 1.28                 |
| 3  | 600518 | 康美药业  | 719,337   | 13,832,850.51 | 1.25                 |
| 4  | 002304 | 洋河股份  | 246,794   | 13,400,914.20 | 1.21                 |
| 5  | 002358 | 森源电气  | 1,010,179 | 13,344,464.59 | 1.21                 |
| 6  | 002628 | 成都路桥  | 1,557,044 | 13,079,169.60 | 1.18                 |
| 7  | 000069 | 华侨城 A | 2,489,964 | 12,873,113.88 | 1.16                 |
| 8  | 002375 | 亚厦股份  | 414,000   | 12,751,200.00 | 1.15                 |
| 9  | 002271 | 东方雨虹  | 650,000   | 12,025,000.00 | 1.09                 |
| 10 | 300017 | 网宿科技  | 307,367   | 11,978,091.99 | 1.08                 |
| 11 | 002116 | 中国海诚  | 1,026,197 | 11,452,358.52 | 1.04                 |
| 12 | 002065 | 东华软件  | 563,452   | 11,156,349.60 | 1.01                 |
| 13 | 002482 | 广田股份  | 529,993   | 11,129,853.00 | 1.01                 |
| 14 | 002081 | 金 螳 螂 | 389,760   | 11,096,467.20 | 1.00                 |
| 15 | 002501 | 利源铝业  | 925,780   | 10,979,750.80 | 0.99                 |
| 16 | 002450 | 康得新   | 390,000   | 10,912,200.00 | 0.99                 |
| 17 | 002028 | 思源电气  | 692,923   | 10,899,678.79 | 0.99                 |
| 18 | 000639 | 西王食品  | 769,000   | 10,789,070.00 | 0.98                 |
| 19 | 300083 | 劲胜股份  | 635,138   | 10,771,940.48 | 0.97                 |
| 20 | 002284 | 亚太股份  | 1,429,941 | 10,710,258.09 | 0.97                 |
| 21 | 002241 | 歌尔声学  | 281,880   | 10,229,425.20 | 0.93                 |
| 22 | 600978 | 宜华木业  | 2,329,000 | 10,224,310.00 | 0.92                 |
| 23 | 000786 | 北新建材  | 570,250   | 10,047,805.00 | 0.91                 |
| 24 | 000568 | 泸州老窖  | 416,979   | 9,915,760.62  | 0.90                 |
| 25 | 300057 | 万顺股份  | 679,925   | 9,756,923.75  | 0.88                 |
| 26 | 600519 | 贵州茅台  | 49,945    | 9,607,919.65  | 0.87                 |
| 27 | 002311 | 海大集团  | 831,635   | 9,530,537.10  | 0.86                 |
| 28 | 002496 | 辉丰股份  | 749,986   | 9,449,823.60  | 0.85                 |
| 29 | 002571 | 德力股份  | 674,000   | 9,409,040.00  | 0.85                 |
| 30 | 002663 | 普邦园林  | 610,000   | 9,192,700.00  | 0.83                 |
| 31 | 002398 | 建研集团  | 655,246   | 9,042,394.80  | 0.82                 |
| 32 | 600809 | 山西汾酒  | 360,000   | 8,820,000.00  | 0.80                 |
| 33 | 601633 | 长城汽车  | 249,000   | 8,819,580.00  | 0.80                 |



|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 34 | 002588 | 史丹利  | 318,000   | 8,789,520.00 | 0.79 |
| 35 | 002324 | 普利特  | 540,000   | 8,434,800.00 | 0.76 |
| 36 | 002310 | 东方园林 | 219,708   | 8,412,619.32 | 0.76 |
| 37 | 002061 | 江山化工 | 1,566,418 | 8,302,015.40 | 0.75 |
| 38 | 300039 | 上海凯宝 | 642,599   | 8,128,877.35 | 0.74 |
| 39 | 600172 | 黄河旋风 | 1,300,000 | 8,099,000.00 | 0.73 |
| 40 | 002052 | 同洲电子 | 1,080,920 | 7,642,104.40 | 0.69 |
| 41 | 002656 | 卡奴迪路 | 510,200   | 7,494,838.00 | 0.68 |
| 42 | 600690 | 青岛海尔 | 680,000   | 7,418,800.00 | 0.67 |
| 43 | 002567 | 唐人神  | 968,925   | 7,315,383.75 | 0.66 |
| 44 | 002701 | 奥瑞金  | 258,836   | 7,299,175.20 | 0.66 |
| 45 | 300216 | 千山药机 | 749,229   | 7,230,059.85 | 0.65 |
| 46 | 601126 | 四方股份 | 500,000   | 7,225,000.00 | 0.65 |
| 47 | 600309 | 万华化学 | 450,000   | 7,209,000.00 | 0.65 |
| 48 | 000625 | 长安汽车 | 770,000   | 7,153,300.00 | 0.65 |
| 49 | 600050 | 中国联通 | 2,280,000 | 7,113,600.00 | 0.64 |
| 50 | 600739 | 辽宁成大 | 542,000   | 7,111,040.00 | 0.64 |
| 51 | 601886 | 江河创建 | 529,000   | 6,993,380.00 | 0.63 |
| 52 | 000400 | 许继电气 | 250,175   | 6,774,739.00 | 0.61 |
| 53 | 002508 | 老板电器 | 204,000   | 6,654,480.00 | 0.60 |
| 54 | 002521 | 齐峰股份 | 899,600   | 6,495,112.00 | 0.59 |
| 55 | 000888 | 峨眉山A | 417,000   | 6,492,690.00 | 0.59 |
| 56 | 600527 | 江南高纤 | 1,149,906 | 6,427,974.54 | 0.58 |
| 57 | 600612 | 老凤祥  | 392,300   | 6,421,951.00 | 0.58 |
| 58 | 002664 | 信质电机 | 253,814   | 6,215,904.86 | 0.56 |
| 59 | 002503 | 搜于特  | 532,276   | 6,051,978.12 | 0.55 |
| 60 | 600426 | 华鲁恒升 | 1,100,000 | 6,017,000.00 | 0.54 |
| 61 | 002532 | 新界泵业 | 356,346   | 5,972,358.96 | 0.54 |
| 62 | 002219 | 独一味  | 310,000   | 5,936,500.00 | 0.54 |
| 63 | 600999 | 招商证券 | 565,700   | 5,883,280.00 | 0.53 |
| 64 | 300026 | 红日药业 | 172,500   | 5,854,650.00 | 0.53 |
| 65 | 601933 | 永辉超市 | 500,000   | 5,835,000.00 | 0.53 |
| 66 | 002410 | 广联达  | 303,000   | 5,744,880.00 | 0.52 |
| 67 | 300271 | 华宇软件 | 317,550   | 5,674,618.50 | 0.51 |
| 68 | 002303 | 美盈森  | 226,713   | 5,613,413.88 | 0.51 |
| 69 | 601166 | 兴业银行 | 380,000   | 5,612,600.00 | 0.51 |
| 70 | 300020 | 银江股份 | 245,500   | 5,565,485.00 | 0.50 |
| 71 | 002462 | 嘉事堂  | 511,057   | 5,534,747.31 | 0.50 |
| 72 | 600587 | 新华医疗 | 133,000   | 5,511,520.00 | 0.50 |
| 73 | 002415 | 海康威视 | 154,971   | 5,476,675.14 | 0.50 |
| 74 | 002305 | 南国置业 | 650,000   | 5,362,500.00 | 0.48 |

|     |        |      |           |              |      |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 75  | 601117 | 中国化学 | 560,000   | 5,331,200.00 | 0.48 |
| 76  | 600699 | 均胜电子 | 422,000   | 5,325,640.00 | 0.48 |
| 77  | 300079 | 数码视讯 | 253,375   | 5,310,740.00 | 0.48 |
| 78  | 002322 | 理工监测 | 360,000   | 5,263,200.00 | 0.48 |
| 79  | 600104 | 上汽集团 | 392,500   | 5,184,925.00 | 0.47 |
| 80  | 002443 | 金洲管道 | 650,000   | 5,180,500.00 | 0.47 |
| 81  | 600016 | 民生银行 | 600,000   | 5,142,000.00 | 0.47 |
| 82  | 300228 | 富瑞特装 | 64,000    | 5,120,000.00 | 0.46 |
| 83  | 300005 | 探路者  | 529,901   | 5,055,255.54 | 0.46 |
| 84  | 600418 | 江淮汽车 | 699,950   | 4,920,648.50 | 0.44 |
| 85  | 300198 | 纳川股份 | 389,475   | 4,907,385.00 | 0.44 |
| 86  | 300019 | 硅宝科技 | 607,200   | 4,809,024.00 | 0.43 |
| 87  | 002491 | 通鼎光电 | 399,909   | 4,806,906.18 | 0.43 |
| 88  | 002511 | 中顺洁柔 | 419,953   | 4,732,870.31 | 0.43 |
| 89  | 600967 | 北方创业 | 459,972   | 4,700,913.84 | 0.43 |
| 90  | 600406 | 国电南瑞 | 310,000   | 4,628,300.00 | 0.42 |
| 91  | 300273 | 和佳股份 | 215,600   | 4,618,152.00 | 0.42 |
| 92  | 002146 | 荣盛发展 | 325,700   | 4,595,627.00 | 0.42 |
| 93  | 601318 | 中国平安 | 130,000   | 4,518,800.00 | 0.41 |
| 94  | 002367 | 康力电梯 | 400,000   | 4,476,000.00 | 0.40 |
| 95  | 600048 | 保利地产 | 425,000   | 4,211,750.00 | 0.38 |
| 96  | 600837 | 海通证券 | 440,000   | 4,127,200.00 | 0.37 |
| 97  | 600086 | 东方金钰 | 202,900   | 4,112,783.00 | 0.37 |
| 98  | 600446 | 金证股份 | 350,000   | 4,077,500.00 | 0.37 |
| 99  | 002469 | 三维工程 | 260,000   | 4,056,000.00 | 0.37 |
| 100 | 002035 | 华帝股份 | 413,200   | 4,045,228.00 | 0.37 |
| 101 | 300182 | 捷成股份 | 150,643   | 3,998,065.22 | 0.36 |
| 102 | 300088 | 长信科技 | 187,440   | 3,953,109.60 | 0.36 |
| 103 | 000002 | 万科A  | 400,000   | 3,940,000.00 | 0.36 |
| 104 | 600030 | 中信证券 | 387,000   | 3,920,310.00 | 0.35 |
| 105 | 000739 | 普洛药业 | 700,000   | 3,885,000.00 | 0.35 |
| 106 | 002236 | 大华股份 | 100,936   | 3,858,783.28 | 0.35 |
| 107 | 002294 | 信立泰  | 127,960   | 3,703,162.40 | 0.33 |
| 108 | 002353 | 杰瑞股份 | 53,404    | 3,684,876.00 | 0.33 |
| 109 | 002477 | 雏鹰农牧 | 232,946   | 3,678,217.34 | 0.33 |
| 110 | 600507 | 方大特钢 | 1,000,000 | 3,670,000.00 | 0.33 |
| 111 | 002244 | 滨江集团 | 420,000   | 3,528,000.00 | 0.32 |
| 112 | 002570 | 贝因美  | 126,000   | 3,521,700.00 | 0.32 |
| 113 | 300241 | 瑞丰光电 | 280,000   | 3,514,000.00 | 0.32 |
| 114 | 002440 | 闰土股份 | 170,000   | 3,513,900.00 | 0.32 |
| 115 | 002203 | 海亮股份 | 499,981   | 3,499,867.00 | 0.32 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 116 | 600894 | 广日股份 | 429,934 | 3,448,070.68 | 0.31 |
| 117 | 002649 | 博彦科技 | 137,000 | 3,390,750.00 | 0.31 |
| 118 | 300293 | 蓝英装备 | 250,000 | 3,375,000.00 | 0.31 |
| 119 | 600597 | 光明乳业 | 250,000 | 3,372,500.00 | 0.30 |
| 120 | 300207 | 欣旺达  | 190,000 | 3,363,000.00 | 0.30 |
| 121 | 002554 | 惠博普  | 300,000 | 3,357,000.00 | 0.30 |
| 122 | 600572 | 康恩贝  | 300,000 | 3,327,000.00 | 0.30 |
| 123 | 000966 | 长源电力 | 660,000 | 3,286,800.00 | 0.30 |
| 124 | 000716 | 南方食品 | 263,020 | 3,235,146.00 | 0.29 |
| 125 | 600886 | 国投电力 | 940,000 | 3,177,200.00 | 0.29 |
| 126 | 600026 | 中海发展 | 900,000 | 3,132,000.00 | 0.28 |
| 127 | 600073 | 上海梅林 | 500,000 | 3,115,000.00 | 0.28 |
| 128 | 002318 | 久立特材 | 180,000 | 3,083,400.00 | 0.28 |
| 129 | 300339 | 润和软件 | 175,900 | 3,057,142.00 | 0.28 |
| 130 | 601058 | 赛轮股份 | 300,000 | 3,000,000.00 | 0.27 |
| 131 | 601601 | 中国太保 | 188,000 | 2,994,840.00 | 0.27 |
| 132 | 600167 | 联美控股 | 260,000 | 2,927,600.00 | 0.26 |
| 133 | 002493 | 荣盛石化 | 375,000 | 2,831,250.00 | 0.26 |
| 134 | 002385 | 大北农  | 272,848 | 2,815,791.36 | 0.25 |
| 135 | 300141 | 和顺电气 | 315,000 | 2,683,800.00 | 0.24 |
| 136 | 002228 | 合兴包装 | 483,711 | 2,655,573.39 | 0.24 |
| 137 | 002429 | 兆驰股份 | 347,281 | 2,601,134.69 | 0.24 |
| 138 | 002063 | 远光软件 | 180,000 | 2,601,000.00 | 0.24 |
| 139 | 300119 | 瑞普生物 | 120,531 | 2,534,766.93 | 0.23 |
| 140 | 002421 | 达实智能 | 150,000 | 2,496,000.00 | 0.23 |
| 141 | 601877 | 正泰电器 | 125,000 | 2,480,000.00 | 0.22 |
| 142 | 002285 | 世联地产 | 247,000 | 2,455,180.00 | 0.22 |
| 143 | 300270 | 中威电子 | 120,000 | 2,433,600.00 | 0.22 |
| 144 | 601000 | 唐山港  | 920,944 | 2,412,873.28 | 0.22 |
| 145 | 601231 | 环旭电子 | 150,000 | 2,344,500.00 | 0.21 |
| 146 | 000895 | 双汇发展 | 60,556  | 2,327,772.64 | 0.21 |
| 147 | 000157 | 中联重科 | 427,915 | 2,323,578.45 | 0.21 |
| 148 | 002049 | 同方国芯 | 85,000  | 2,306,900.00 | 0.21 |
| 149 | 002550 | 千红制药 | 68,300  | 2,303,759.00 | 0.21 |
| 150 | 002308 | 威创股份 | 250,000 | 2,300,000.00 | 0.21 |
| 151 | 600262 | 北方股份 | 165,000 | 2,268,750.00 | 0.21 |
| 152 | 002292 | 奥飞动漫 | 100,000 | 2,239,000.00 | 0.20 |
| 153 | 000513 | 丽珠集团 | 60,000  | 2,238,000.00 | 0.20 |
| 154 | 300146 | 汤臣倍健 | 50,500  | 2,221,495.00 | 0.20 |
| 155 | 002157 | 正邦科技 | 378,913 | 2,193,906.27 | 0.20 |
| 156 | 600521 | 华海药业 | 139,785 | 2,131,721.25 | 0.19 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 157 | 600674 | 川投能源 | 203,800 | 2,072,646.00 | 0.19 |
| 158 | 601222 | 林洋电子 | 138,620 | 2,070,982.80 | 0.19 |
| 159 | 000961 | 中南建设 | 210,000 | 2,053,800.00 | 0.19 |
| 160 | 300349 | 金卡股份 | 50,000  | 2,040,500.00 | 0.18 |
| 161 | 002507 | 涪陵榨菜 | 93,005  | 2,018,208.50 | 0.18 |
| 162 | 300201 | 海伦哲  | 450,000 | 1,903,500.00 | 0.17 |
| 163 | 300196 | 长海股份 | 80,000  | 1,736,800.00 | 0.16 |
| 164 | 000921 | 海信科龙 | 205,200 | 1,489,752.00 | 0.13 |
| 165 | 600428 | 中远航运 | 424,970 | 1,283,409.40 | 0.12 |
| 166 | 600031 | 三一重工 | 170,000 | 1,276,700.00 | 0.12 |
| 167 | 601688 | 华泰证券 | 150,000 | 1,209,000.00 | 0.11 |
| 168 | 300215 | 电科院  | 75,940  | 1,159,603.80 | 0.10 |
| 169 | 002339 | 积成电子 | 139,948 | 1,136,377.76 | 0.10 |
| 170 | 300181 | 佐力药业 | 90,000  | 1,130,400.00 | 0.10 |
| 171 | 300202 | 聚龙股份 | 55,000  | 1,116,500.00 | 0.10 |
| 172 | 300233 | 金城医药 | 70,000  | 1,108,800.00 | 0.10 |
| 173 | 002586 | 围海股份 | 100,000 | 1,092,000.00 | 0.10 |
| 174 | 002138 | 顺络电子 | 60,000  | 1,080,000.00 | 0.10 |
| 175 | 002331 | 皖通科技 | 109,952 | 1,064,335.36 | 0.10 |
| 176 | 300342 | 天银机电 | 59,909  | 1,063,384.75 | 0.10 |
| 177 | 002042 | 华孚色纺 | 200,000 | 1,056,000.00 | 0.10 |
| 178 | 002572 | 索菲亚  | 76,000  | 1,054,120.00 | 0.10 |
| 179 | 002344 | 海宁皮城 | 55,000  | 1,051,050.00 | 0.10 |
| 180 | 601888 | 中国国旅 | 35,000  | 1,022,000.00 | 0.09 |
| 181 | 601313 | 江南嘉捷 | 150,000 | 1,017,000.00 | 0.09 |
| 182 | 000951 | 中国重汽 | 120,000 | 1,011,600.00 | 0.09 |
| 183 | 300352 | 北信源  | 45,000  | 1,001,250.00 | 0.09 |
| 184 | 600351 | 亚宝药业 | 160,000 | 982,400.00   | 0.09 |
| 185 | 600706 | 曲江文旅 | 99,930  | 965,323.80   | 0.09 |
| 186 | 002045 | 国光电器 | 200,000 | 956,000.00   | 0.09 |
| 187 | 603000 | 人民网  | 21,500  | 944,065.00   | 0.09 |
| 188 | 002273 | 水晶光电 | 50,000  | 919,500.00   | 0.08 |
| 189 | 002251 | 步步高  | 39,950  | 883,694.00   | 0.08 |
| 190 | 300239 | 东宝生物 | 100,000 | 842,000.00   | 0.08 |
| 191 | 600085 | 同仁堂  | 33,000  | 722,040.00   | 0.07 |
| 192 | 002022 | 科华生物 | 19,400  | 287,314.00   | 0.03 |

#### 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  | 000069 | 华侨城 A | 15,981,060.10 | 2.28            |
| 2  | 002628 | 成都路桥  | 15,928,941.16 | 2.27            |
| 3  | 600312 | 平高电气  | 15,894,185.73 | 2.26            |
| 4  | 002116 | 中国海诚  | 15,286,924.51 | 2.18            |
| 5  | 002310 | 东方园林  | 12,493,838.30 | 1.78            |
| 6  | 000982 | 中银绒业  | 12,391,637.60 | 1.77            |
| 7  | 002061 | 江山化工  | 12,028,328.97 | 1.71            |
| 8  | 002284 | 亚太股份  | 11,747,526.91 | 1.67            |
| 9  | 002501 | 利源铝业  | 11,717,272.00 | 1.67            |
| 10 | 002358 | 森源电气  | 11,692,483.79 | 1.67            |
| 11 | 300083 | 劲胜股份  | 11,454,884.12 | 1.63            |
| 12 | 002241 | 歌尔声学  | 11,298,320.70 | 1.61            |
| 13 | 300057 | 万顺股份  | 11,262,407.07 | 1.60            |
| 14 | 600978 | 宜华木业  | 11,065,949.96 | 1.58            |
| 15 | 002482 | 广田股份  | 10,975,451.63 | 1.56            |
| 16 | 002663 | 普邦园林  | 10,214,761.00 | 1.46            |
| 17 | 002028 | 思源电气  | 9,993,944.80  | 1.42            |
| 18 | 600809 | 山西汾酒  | 9,581,693.17  | 1.37            |
| 19 | 600426 | 华鲁恒升  | 9,441,995.00  | 1.35            |
| 20 | 600172 | 黄河旋风  | 9,427,076.85  | 1.34            |

注：买入金额均按买卖成交金额（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  | 300072 | 三聚环保 | 11,361,618.20 | 1.62            |
| 2  | 000982 | 中银绒业 | 11,080,963.73 | 1.58            |
| 3  | 002429 | 兆驰股份 | 10,266,605.74 | 1.46            |
| 4  | 000669 | 金鸿能源 | 10,075,081.29 | 1.44            |
| 5  | 601222 | 林洋电子 | 9,127,378.86  | 1.30            |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 8,889,811.00  | 1.27            |
| 7  | 000661 | 长春高新 | 8,600,645.95  | 1.23            |
| 8  | 002277 | 友阿股份 | 8,296,206.94  | 1.18            |
| 9  | 002116 | 中国海诚 | 8,294,357.88  | 1.18            |
| 10 | 002396 | 星网锐捷 | 8,248,389.41  | 1.18            |
| 11 | 600583 | 海油工程 | 8,232,438.18  | 1.17            |
| 12 | 002535 | 林州重机 | 8,032,312.93  | 1.14            |
| 13 | 002589 | 瑞康医药 | 7,523,319.60  | 1.07            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 14 | 000563 | 陕国投 A | 7,521,449.38 | 1.07 |
| 15 | 600039 | 四川路桥  | 7,305,857.07 | 1.04 |
| 16 | 002241 | 歌尔声学  | 7,202,339.37 | 1.03 |
| 17 | 600066 | 宇通客车  | 7,063,146.89 | 1.01 |
| 18 | 300202 | 聚龙股份  | 6,879,163.53 | 0.98 |
| 19 | 000826 | 桑德环境  | 6,537,267.69 | 0.93 |
| 20 | 600795 | 国电电力  | 6,107,547.41 | 0.87 |

注：卖出金额均按买卖成交金额（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

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 1,185,070,215.48 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 657,142,990.22   |

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

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      | 49,799,000.00 | 4.50          |
|    | 其中：政策性金融债 | 49,799,000.00 | 4.50          |
| 4  | 企业债券      | -             | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -             |
| 6  | 中期票据      | -             | -             |
| 7  | 可转债       | 15,592,500.00 | 1.41          |
| 8  | 其他        | -             | -             |
| 9  | 合计        | 65,391,500.00 | 5.91          |

#### 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  | 0402020 | 04 国开 02 | 200,000 | 19,934,000.00 | 1.80          |
| 2  | 110023  | 民生转债     | 150,000 | 15,592,500.00 | 1.41          |
| 3  | 080307  | 08 进出 07 | 100,000 | 9,980,000.00  | 0.90          |
| 4  | 060225  | 06 国开 25 | 100,000 | 9,949,000.00  | 0.90          |

|   |        |          |         |              |      |
|---|--------|----------|---------|--------------|------|
| 5 | 130308 | 13 进出 08 | 100,000 | 9,936,000.00 | 0.90 |
|---|--------|----------|---------|--------------|------|

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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。

本基金投资的上市公司宜宾五粮液股份有限公司（五粮液，代码：000858）于 2013 年 2 月 23 日发布公告称：“2013 年 2 月 22 日，本公司之控股子公司“宜宾五粮液酒类销售有限责任公司”（以下简称“酒类销售公司”）收到四川省发展和改革委员会《行政处罚决定书》川发改价检处[2013]1 号，现将有关情况公告如下：根据《中华人民共和国反垄断法》，本机关依法对你公司限定交易相对人向第三人转售白酒最低价格的行为进行了调查。……2012 年 12 月，你公司依据《五粮液营销督查处理通报（督字 001 号）》，对 14 家经销商“低价、跨区、跨渠道违规销售五粮液”的行为给予扣除违约金、扣除市场支持费用等处罚。本机关认为，你公司通过合同约定、价格管控、考核奖惩等方式，对经销商向第三人销售五粮液白酒的最低价格进行限定，对市场竞争秩序产生了不利影响，对消费者的合法权益造成了损害。本机关认定，你公司的上述行为违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定，……。鉴于你公司能够积极配合调查，主动提供相关证据材料，并已正式发布公告停止并纠正，进行深入整改等情节，……。据此，本机关决定对你公司处以 2012 年度销售额百分之一的罚款二亿零二百万元。”

本基金有关该股票的投资决策程序，符合法律法规和公司规章制度的规定。本基金投研团队认为，五粮液作为白酒行业的龙头企业之一，长期以来业绩成长性良好、生产稳健、产品畅销。此次罚款事件，主要针对该公司的市场垄断行为，罚款金额占其 2012 年年度销售收入的比例很小，对该公司的经营不存在重大影响，对当年业绩影响甚小。此外，该公司能够积极配合调查，主动提供相关证据材料，并已正式发布公告停止并纠正，进行深入整改，表明公司已经深刻认识并积极纠正，将以此事件为戒，未来将加强合规经营意识，运作更加规范，从而提升其投资价值。

其余九名证券的发行主体本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、处罚的情形。

7.10.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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   | 490,832.58   |
| 2  | 应收证券清算款 | 443,146.49   |
| 3  | 应收股利    | 380,948.67   |
| 4  | 应收利息    | 859,103.15   |
| 5  | 应收申购款   | 80,560.18    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,254,591.07 |

### 7.10.4 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。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产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 |
| 4,950    | 224,096.92 | 999,244,355.02 | 90.08% | 110,035,383.81 | 9.92%  |

### 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  | 北京天宇恒业物业管理有限公司 | 1,600,191.00 | 31.40% |
| 2  | 上海亚东盛进出口有限公司   | 300,081.00   | 5.89%  |
| 3  | 冯彦蕊            | 200,025.00   | 3.93%  |
| 4  | 翁樑             | 150,021.00   | 2.94%  |
| 5  | 楼咏             | 139,199.00   | 2.73%  |
| 6  | 王金莲            | 100,010.00   | 1.96%  |
| 7  | 何凤珍            | 100,010.00   | 1.96%  |
| 8  | 殷红梅            | 90,534.00    | 1.78%  |
| 9  | 徐金荣            | 90,106.00    | 1.77%  |
| 10 | 任德清            | 80,010.00    | 1.57%  |

注：以上均为场内持有人。

### 8.3 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 | 660,321.74 | 0.0595%  |

注：1、基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份(含)。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                  |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2011 年 2 月 10 日）基金份额总额 | 401,864,609.25   |
| 本报告期初基金份额总额                    | 729,146,948.63   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 505,306,260.73   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 125,173,470.53   |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                |
| 本报告期末基金份额总额                    | 1,109,279,738.83 |

## 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

## 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 |    |
| 国海证券 | 1      | 1,068,867,913.53 | 58.02%       | 960,605.01 | 57.89%     | -  |
| 安信证券 | 1      | 290,181,904.02   | 15.75%       | 258,916.37 | 15.60%     | -  |
| 广发证券 | 1      | 258,769,269.09   | 14.05%       | 235,583.65 | 14.20%     | -  |
| 中信建投 | 1      | 117,836,886.66   | 6.40%        | 107,278.12 | 6.46%      | -  |
| 东方证券 | 1      | 106,557,232.40   | 5.78%        | 97,009.96  | 5.85%      | -  |
| 英大证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 中邮证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2、本报告期内，无新增或减少证券公司交易单元的情况。

### 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          |              | 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 |
| 国海证券 | -             | -            | -                | -            | -    | -            |
| 安信证券 | -             | -            | -                | -            | -    | -            |
| 广发证券 | -             | -            | 1,807,000,000.00 | 67.63%       | -    | -            |
| 中信建投 | -             | -            | 371,800,000.00   | 13.92%       | -    | -            |
| 东方证券 | 15,100,000.00 | 100.00%      | 493,000,000.00   | 18.45%       | -    | -            |
| 英大证券 | -             | -            | -                | -            | -    | -            |
| 中邮证券 | -             | -            | -                | -            | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|---|-----------------------------|------------|
| 1  | 中欧基金管理有限公司旗下基金2012年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告 | 公司网站                        | 2013-01-01 |
| 2  | 中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)2012年第4季度报告                    | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-01-22 |
| 3  | 中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告                       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-02-22 |
| 4  | 中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2013年第1号）              | 公司网站                        | 2013-03-26 |
| 5  | 中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2013年第1号）            | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-03-26 |
| 6  | 中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)2012年年度报告（正文）                  | 公司网站                        | 2013-03-30 |
| 7  | 中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)2012年年度报告（摘要）                  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-03-30 |
| 8  | 中欧基金管理有限公司关于开通上海银联                                | 《中国证券报》、《上                  | 2013-04-01 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 相关银行卡基金网上直销定期定额投资业务并实施费率优惠的公告                    | 海证券报》、《证券时报》、公司网站           |            |
| 9  | 中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告          | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-04-19 |
| 10 | 中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)2013年第1季度报告                   | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-04-20 |
| 11 | 中欧基金管理有限公司关于公司股东变更及增加注册资本的公告                     | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-04-20 |
| 12 | 中欧基金管理有限公司关于新增西南证券为旗下部分基金代销机构的公告                 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-05-02 |
| 13 | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行股份有限公司开通基金转换业务的公告         | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-05-15 |
| 14 | 中欧基金管理有限公司关于运用自有资金申购旗下部分基金的公告                    | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-05-29 |
| 15 | 中欧基金管理有限公司关于新增东吴证券为旗下部分基金代销机构并同时开通定期定额投资业务的公告    | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2013-06-18 |
| 16 | 中欧基金管理有限公司旗下基金2013年6月28日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告 | 公司网站                        | 2013-06-29 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）相关批准文件
- 2、《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com))查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司  
二〇一三年八月二十八日