

# 建信优势动力股票型证券投资基金（LOF） （原建信优势动力股票型证券投资基金转型） 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 26 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。

基金托管人交通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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况（转型前）.....	5
2.1 基金基本情况（转型后）.....	5
2.2 基金产品说明（转型前）.....	5
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现（转型前）.....	8
3.2 基金净值表现（转型后）.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>20</b>
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>39</b>
6.1 资产负债表.....	39
6.2 利润表.....	40
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	41
6.4 报表附注.....	42
<b>§7 投资组合报告（转型前）</b> .....	<b>60</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	60
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
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.....	61
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
7.10 投资组合报告附注 .....	65
<b>§7 投资组合报告(转型后) .....</b>	<b>65</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	65
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	66
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(转型后) .....	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	70
7.10 投资组合报告附注 .....	70
<b>§8 基金份额持有人信息(转型前) .....</b>	<b>70</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
<b>§8 基金份额持有人信息(转型后) .....</b>	<b>71</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	72
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
10.4 基金投资策略的改变 .....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后) .....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前) .....	75
10.8 其他重大事件 (转型后) .....	76
10.8 其他重大事件 (转型前) .....	77
<b>§11 备查文件目录 .....</b>	<b>78</b>
11.1 备查文件目录 .....	78
11.2 存放地点 .....	78
11.3 查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	建信优势动力股票型证券投资基金
基金简称	建信优势动力封闭（场内简称：建信优势）
基金主代码	150003
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2008 年 3 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,642,655,005.00 份
基金合同存续期（若有）	5 年
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所
上市日期（若有）	2008-09-19

注：本基金于 2013 年 3 月 18 日在深圳证券交易所终止上市。

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）
基金简称	建信优势动力股票（LOF）（场内简称：建信优势）
基金主代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013 年 3 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,537,095,869.20 份
基金合同存续期（若有）	不定期
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所
上市日期（若有）	2013-04-03

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人从经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策。
业绩比较基准（若有）	90%×沪深 300 指数收益率+10%×中国债券总指数收益率。

风险收益特征（若有）	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。
------------	---

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、但是价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人从经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策。
业绩比较基准（若有）	75%×沪深 300 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征（若有）	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。

## 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		建信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	裴学敏
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		100033	200120
法定代表人		江先周	牛锡明

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 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	中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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)	
	转型前	转型后
本期已实现收益	292,649,751.12	78,143,006.38
本期利润	101,911,013.70	-83,654,821.05
加权平均基金份额本期利润	0.0220	-0.0206
本期加权平均净值利润率	2.31%	-2.17%
本期基金份额净值增长率	2.41%	-3.10%
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	-558,460,655.30	-352,576,176.48
期末可供分配基金份额利润	-0.1203	-0.0997
期末基金资产净值	4,336,702,117.48	3,202,323,521.88
期末基金份额净值	0.934	0.905
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2013 年 6 月 30 日 )	
基金份额累计净值增长率	-6.60%	-3.10%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

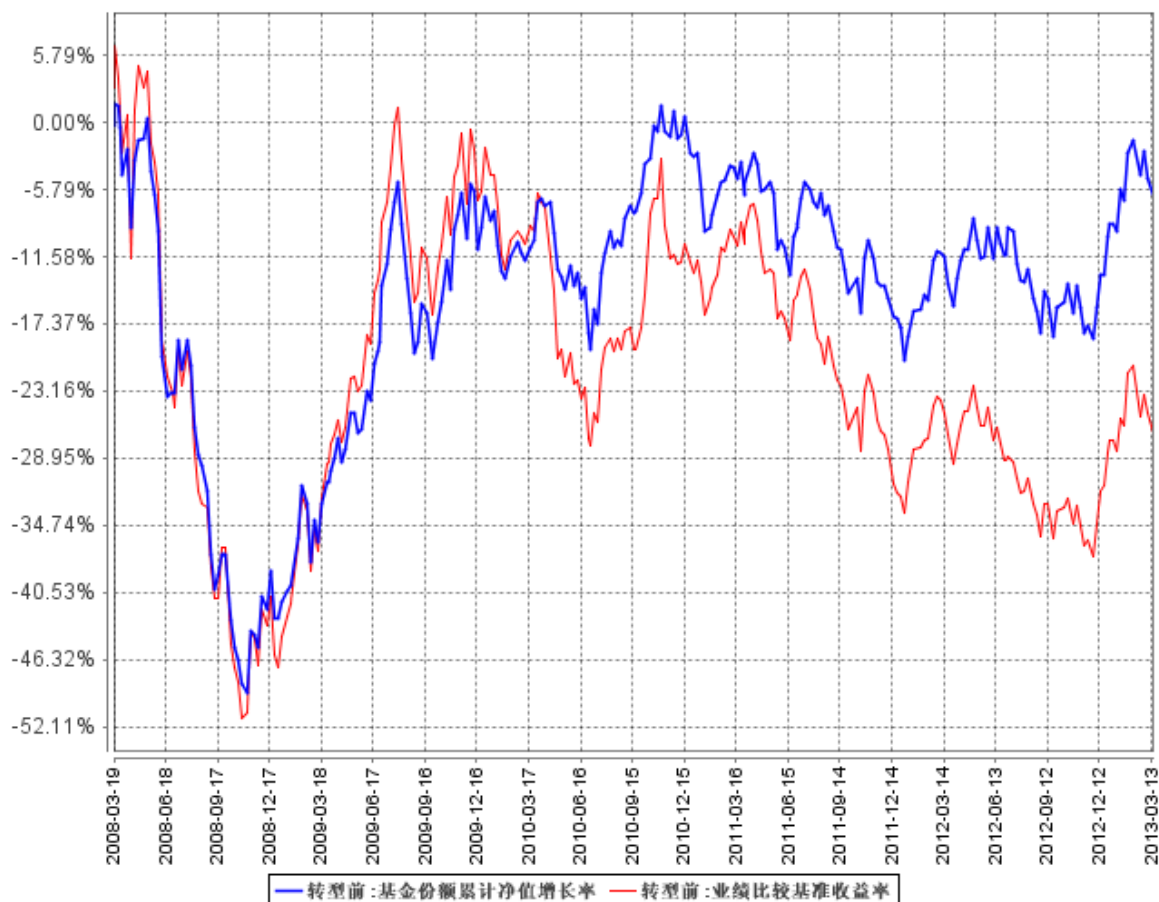
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型前						
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
2013年1月4日至2013年3月18日	2.41%	1.09%	-0.58%	1.39%	2.99%	-0.30%
自基金合同生效起至2013年3月18日	-6.60%	1.41%	-27.80%	1.72%	21.20%	-0.31%

注：本基金于2013年3月18日终止上市。

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于2013年3月18日终止上市，并于2013年3月19日转型为建信优势动力股票型投资基金（LOF）。



## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 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

转型后						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.68%	1.48%	-11.93%	1.42%	3.25%	0.06%
过去三个月	-3.21%	1.06%	-8.68%	1.09%	5.47%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-3.10%	1.01%	-8.81%	1.11%	5.71%	-0.10%

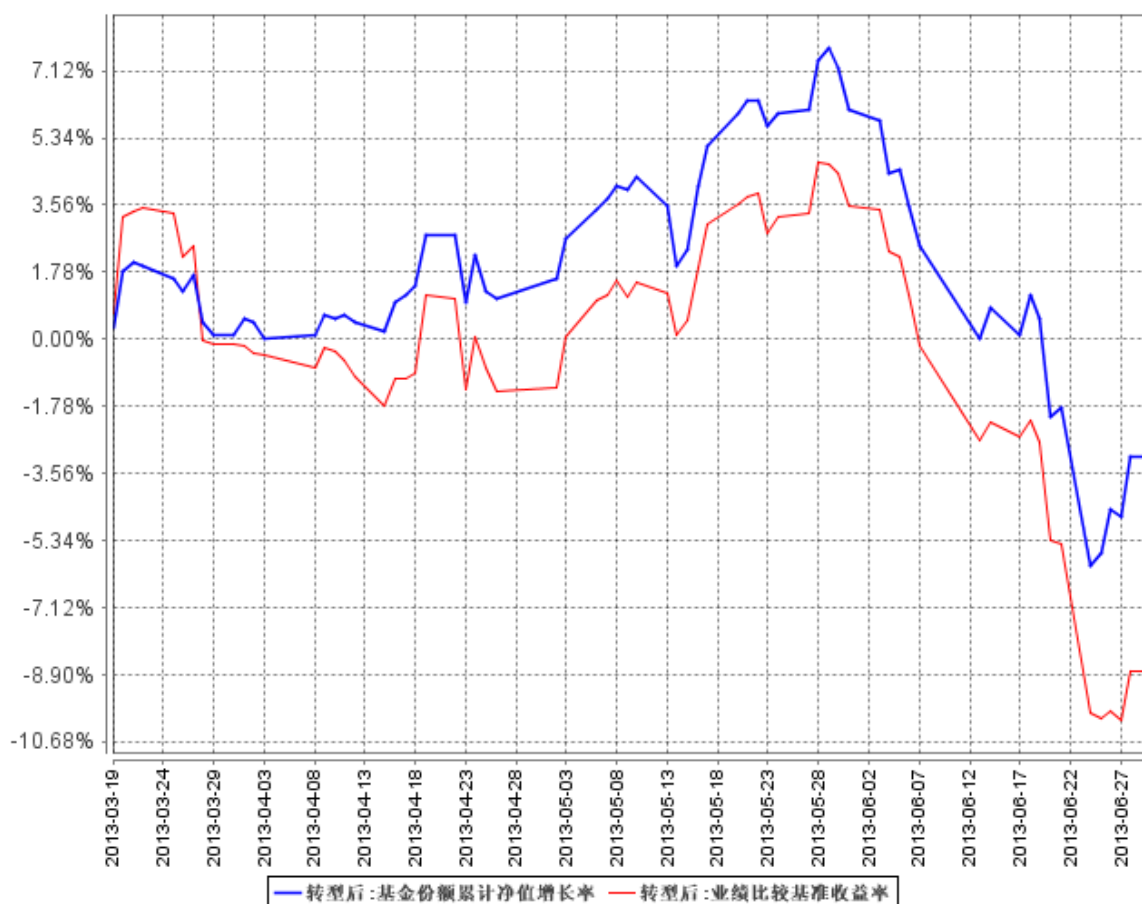
注：1、本基金基金合同于 2013 年 3 月 19 日生效。

2、本基金投资业绩比较基准为： $75\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+25\% \times$  中国债券总指数收益率。其中：沪深 300 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况。中债系列指数由一个总指数（即中国债券总指数），若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。

### 3.2.2 自基金转型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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2013 年 3 月 19 日进行转型，转型前为“建信优势动力股票型证券投资基金”。

2、截止报告日，仍处于建仓期。

## § 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

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险

管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至 2013 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金 31 只开放式基金和建信信用增强债券型证券投资基金 1 只封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 483.16 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
万志勇	投资管理部 副 总 监、本基金的基金经理	2011 年 7 月 11 日	2013 年 3 月 18 日	12	硕士。曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华

					<p>鑫基金管理有限公司（原巨田基金管理有限公司）、银华基金管理有限公司。2008年10月23日至2009年11月11日任银华领先策略基金经理，2009年6月1日至2010年6月19日任银华和谐主题基金经理。2010年7月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部执行总监、研究部执行总监兼投资管理部副总监、投资管理部副总监。2010年11月17日起任建信内生动力股票型证券投资基金经</p>
--	--	--	--	--	---

					理；2011年5月6日至2012年5月18日任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理；2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理，该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金（LOF），万志勇继续担任该基金基金经理。
姜锋	本基金的基金经理	2011年7月11日	2013年3月18日	6	硕士。2007年7月加入本公司，从事行业研究，任研究员。2011年7月11日至2013年3

					月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理，该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
万志勇	投资管理部 副 总 监、本基金的基金经理	2013 年 3 月 19 日	-	12	硕士。曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（原巨田基金管理有限公

				<p>司)、银华基金管理有限公司。2008年10月23日至2009年11月11日任银华领先策略基金基金经理，2009年6月1日至2010年6月19日任银华和谐主题基金基金经理。2010年7月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部执行总监、研究部执行总监兼投资管理部副总监、投资管理部副总监。2010年11月17日起任建信内生动力股票型证券投资基金基金经理；2011年5月6日至2012年5月18日任建信</p>
--	--	--	--	--

					<p>双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理；2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理，该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金（LOF），万志勇继续担任该基金基金经理。</p>
姜锋	本基金的基金经理	2013年3月19日	-	6	<p>硕士。2007年7月加入本公司，从事行业研究，任研究员。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券</p>



					投资基金基金经理，该基金于 2013 年 3 月 19 日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

## 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守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

## 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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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

超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年国内经济持续回落，企业盈利出现分化，周期性行业盈利大幅下滑，部分新兴产业业绩出现增长，金融和地产行业盈利依然保持稳健，盈利变化的差异引致股市结构分化。

一季度市场先涨后跌。行业表现上，市场呈现板块轮动态势，蓝筹先行，成长收尾；风格上，蓝筹股和周期股先涨后跌，以医药和 TMT 为代表的成长股持续上涨。

二季度市场先涨后跌。行业表现上，以科技和医药为代表的成长股上涨，以金融地产为代表的蓝筹股出现大幅调整；风格上，成长股的表现显著超越价值股。

本基金 3 月份通过召开持有人大会的方式成功转型为上市交易开放式股票型基金；基于对政策、经济基本面和企业盈利的判断，结合市场的估值水平，本基金以低估值地产、金融和汽车为主要配置对象，适度配置了成长股。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期转型后基金净值增长率-3.10%，波动率 1.01%，业绩比较基准收益率-8.81%，波动率 1.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，美国就业和地产市场的回暖有望带领美国经济继续复苏；国内经济在需求总体疲弱的状态下预计仍将缓慢下滑。

本基金在 2013 年三季度将继续采取相对均衡的配置策略，积极寻找业绩可预见性强的消费股、成长性与估值匹配的成长股和基本面持续改善的周期股，尽力为基金持有人创造回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关

领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定，本报告期内本基金未到达进行利润分配的条件，未进行利润分配。

## § 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

2013 年上半年度，托管人在建信优势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》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，建信基金管理有限公司在建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）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，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本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，由建信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）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 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信优势动力股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 3 月 18 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 3 月 18 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	-	-
结算备付金		1,780,297,510.33	1,215,243,361.41
存出保证金		333,447.11	1,250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,734,249,223.44	3,010,692,202.05
其中：股票投资		1,725,593,337.27	3,010,692,202.05
基金投资		-	-
债券投资		8,655,886.17	-
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	-	-
应收证券清算款		938,169,729.73	17,064,387.48
应收利息	6.4.7.5	5,748,829.95	602,595.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,458,798,740.56	4,244,852,546.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 3 月 18 日</b>	<b>上年度末 2012 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		113,668,674.20	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,726,603.83	4,210,521.67

应付托管费		545,320.76	842,104.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,765,872.52	2,313,106.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,390,151.77	2,695,710.08
负债合计		122,096,623.08	10,061,442.56
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,642,655,005.00	4,642,655,005.00
未分配利润	6.4.7.10	-305,952,887.52	-407,863,901.22
所有者权益合计		4,336,702,117.48	4,234,791,103.78
负债和所有者权益总计		4,458,798,740.56	4,244,852,546.34

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日（基金合同失效日）。

## 6.2 利润表

会计主体：建信优势动力股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 31 日
<b>一、收入</b>		119,961,395.55	103,658,443.34
1. 利息收入		5,146,120.72	3,467,775.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,145,779.22	3,188,280.81
债券利息收入		341.50	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	279,494.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		305,554,012.25	-55,822,950.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	305,554,012.25	-55,852,005.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	-	29,055.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-190,738,737.42	156,011,619.05
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	-	1,999.10

<b>减：二、费用</b>		18,050,381.85	17,309,738.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,630,401.93	12,251,161.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,326,080.38	2,450,232.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,921,391.79	2,485,619.17
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	172,507.75	122,725.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		101,911,013.70	86,348,704.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		101,911,013.70	86,348,704.80

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日 (基金合同失效日)。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信优势动力股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 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）	4,642,655,005.00	-407,863,901.22	4,234,791,103.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101,911,013.70	101,911,013.70
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）	4,642,655,005.00	-305,952,887.52	4,336,702,117.48
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 31 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）	4,642,655,005.00	-820,580,355.19	3,822,074,649.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	86,348,704.80	86,348,704.80
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）	4,642,655,005.00	-734,231,650.39	3,908,423,354.61

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日（基金合同失效日）。

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：

<u>孙志晨</u>	<u>何斌</u>	<u>秦绪华</u>
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

建信优势动力股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]216号《关于核准建信优势动力股票型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式，存续期限为5年，在符合一定条件的前提下，可以转换运作方式，转成为上市开放式基金（LOF）。本基金自2008年2月18日至3月17日限额销售（上限为60亿份，下限为40亿份），于3月12日达到40亿份的下限提前结束募集。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,639,183,830.39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(2008)第017号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》于2008年3月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,642,655,005.00份基金份额，其中认购资金利息折合3,513,584.86份基金份额，场外认购资金小数点后部分利息退回折合42,410.25份基金份额。上述场外认购资金小数点后部分利息的退回是根据建信基金管理有限责任公司于2008年3月19日发布的《关于建信优势动力股票型证券投资基金已确认场外认购资金小数点后部分利息处理公告》

的相关规定，在本基金的基金管理人与本基金托管人交通银行商定后，将场外认购资金产生的小数点后部分利息共计 42,410.25 元，在基金合同生效日向相应基金持有人进行了退回处理。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2008]第 132 号文审核同意，本基金 1,756,841,970.00 份基金份额于 2008 年 9 月 19 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资比例范围为基金资产的 60%-100%，其中，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 0-40%，其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的比例最低可以为 0。本基金投资业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 X 90%+中国债券总指数收益率 X 10%。

本基金转换运作方式的条件为：基金合同生效满 1 年后，若基金折价率连续 60 个交易日超过 15%，则本基金的基金管理人将在 30 个工作日内召集基金份额持有人大会，审议有关基金转换运作方式为上市开放式基金（LOF）的事项。其中，当日基金折价率=1-当日基金份额收盘价/当日基金份额净值。转换运作方式后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易；基金在深圳证券交易所上市交易的相关事宜并不因基金转换运作方式而发生调整。若审议基金转换运作方式的基金份额持有人大会不满足基金合同和法律法规规定的召开条件，基金将保持封闭式基金运作方式。

2013 年 1 月 28 日建信优势动力股票型证券投资基金份额持有人大会以现场方式召开，大会审议建信优势动力股票型证券投资基金转型议案，内容包括建信优势动力股票型证券投资基金在存续期届满后变更运作方式（即变更为上市开放式基金）、调整基金投资比例、基金更名和修订基金合同等。依据中国证监会 2013 年 3 月 1 日证监许可[2013]204 号文核准，持有人大会决议生效。自 2013 年 3 月 19 日起《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》失效且《建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。基金转型为上市开放式基金后，存续期为不定期，同时基金更名为“建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）”。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报



告和半年度报告》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

根据《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》中的规定，本基金存续期至 2013 年 3 月 18 日终止。本期资产负债表日为 2013 年 3 月 18 日（基金合同失效日）。

#### 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 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日（基金合同失效日）止期间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 3 月 18 日（基金合同失效日）的财务状况以及 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日（基金合同失效日）止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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

本基金本报告期末未持有银行存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 3 月 18 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,473,085,569.49	1,725,593,337.27	252,507,767.78
债券	交易所市场	8,655,886.17	8,655,886.17
	银行间市场	-	-
	合计	8,655,886.17	8,655,886.17
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,481,741,455.66	1,734,249,223.44	252,507,767.78

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日（基金合同失效日）。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 3 月 18 日
应收活期存款利息	-
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	5,747,138.38
应收债券利息	455.33
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

其他	1,236.24
合计	5,748,829.95

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日 (基金合同失效日)。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 3 月 18 日
交易所市场应付交易费用	3,765,872.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,765,872.52

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日 (基金合同失效日)。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 3 月 18 日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	-
预提费用	390,151.77
合计	1,390,151.77

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日 (基金合同失效日)。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	4,642,655,005.00	4,642,655,005.00
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	4,642,655,005.00	4,642,655,005.00

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日 (基金合同失效日)。

2、于 2013 年 3 月 18 日，本基金于深交所上市的基金份额 2,348,989,482.00 份，托管在场外未

上市交易的基金份额为 2,293,665,523.00 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;未上市的基金份额登记在注册登记系统,通过跨系统转登记可实现基金份额从场外向深交所的转换。

#### 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	-851,110,406.42	443,246,505.20	-407,863,901.22
本期利润	292,649,751.12	-190,738,737.42	101,911,013.70
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中:基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-558,460,655.30	252,507,767.78	-305,952,887.52

注:本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日
活期存款利息收入	-
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	5,144,542.98
其他	1,236.24
合计	5,145,779.22

注:本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日
卖出股票成交总额	1,773,764,081.78
减:卖出股票成本总额	1,468,210,069.53
买卖股票差价收入	305,554,012.25

注:本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期间无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期间无股利收益。

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日
1. 交易性金融资产	-190,738,737.42
——股票投资	-190,738,737.42
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-190,738,737.42

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期间无其他收入。

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日
交易所市场交易费用	3,921,391.79
银行间市场交易费用	-
合计	3,921,391.79

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日
审计费用	22,994.51
信息披露费	63,289.92
上市费	12,657.26
账户维护费	4,900.00
银行汇划费用	666.06
持有人大会费用	68,000.00
合计	172,507.75

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日（基金合同失效日）。

## 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

根据 2013 年 1 月 28 日本基金份额持有人大会审议通过的《关于建信优势动力股票型证券投资基金转型有关事项的议案》、中国证监会《关于核准建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》（证监许可[2013] 204 号），经深交所深证上[2013]82 号文同意，本基金自 2013 年 3 月 19 日起转型为建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)。

## 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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.9.2 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
建信基金管理有限责任公司	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人

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

本基金本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,630,401.93	12,251,161.42
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	135,637.26	143,556.71

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

2、支付基金管理人建信基金的管理人报酬由管理费和业绩报酬两部分构成，其中管理费按前一日基金资产净值 1.25%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：

日管理费=前一日基金资产净值 X 1.25%/当年天数。

3、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 18 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,326,080.38	2,450,232.24

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

2、支付基金托管人交通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 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费用。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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 3 月 18 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	10,003,950.00	10,003,950.00
期初持有的基金份额	10,003,950.00	10,003,950.00
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	10,003,950.00	10,003,950.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.22%	0.22%

注：本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

##### 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 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 3 月 18 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 3 月 31 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	-	-	-	3,023.79

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2013 年 3 月 18 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2012 年 6 月 30 日：同）

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。



## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

## 6.4.12 期末（2013 年 3 月 18 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

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额
110023	民生转债	2013 年 3 月 15 日	2013 年 3 月 29 日	新发债券未上市	100.00	100.00	86,560	8,655,886.17	8,655,886.17

注：报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限股票。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

至本报告期末，本基金无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

## 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

### 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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，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。

本期末，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如附注 6.4.13.4.3.1 所示，与债券投资相关的信用风险不重大（上年末：同）。

### 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，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 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资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额即约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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2013年3月18日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	-	-	-	-	-
结算备付金	1,780,297,510.33	-	-	-	1,780,297,510.33
存出保证金	333,447.11	-	-	-	333,447.11
交易性金融资产	-	-	8,655,886.17	1,725,593,337.27	1,734,249,223.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	938,169,729.73	938,169,729.73
应收利息	-	-	-	5,748,829.95	5,748,829.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,780,630,957.44	-	8,655,886.17	2,669,511,896.95	4,458,798,740.56
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	113,668,674.20	113,668,674.20
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,726,603.83	2,726,603.83
应付托管费	-	-	-	545,320.76	545,320.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,765,872.52	3,765,872.52
应付税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,390,151.77	1,390,151.77
负债总计	-	-	-	122,096,623.08	122,096,623.08
利率敏感度缺口	1,780,630,957.44	-	8,655,886.17	2,547,415,273.87	4,336,702,117.48
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	-	-	-	-	-
结算备付金	1,215,243,361.41	-	-	-	1,215,243,361.41
存出保证金	-	-	-	1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产	-	-	-	3,010,692,202.05	3,010,692,202.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	17,064,387.48	17,064,387.48
应收利息	-	-	-	602,595.40	602,595.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,215,243,361.41	-	-	3,029,609,184.93	4,244,852,546.34
负债					
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,210,521.67	4,210,521.67
应付托管费	-	-	-	842,104.33	842,104.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,313,106.48	2,313,106.48
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,695,710.08	2,695,710.08
负债总计	-	-	-	10,061,442.56	10,061,442.56
利率敏感度缺口	1,215,243,361.41	-	-	3,019,547,742.37	4,234,791,103.78

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、本期末为 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末（2013 年 3 月 18 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如附注 6.4.13.4.3.1 所示，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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，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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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投资比例范围为基金资产的 60%-100%，其中，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 0-40%，其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的比例最低可以为 0。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，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 2013 年 3 月 18 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比 例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,725,593,337.27	39.79	3,010,692,202.05	71.09
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	8,655,886.17	0.20	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,734,249,223.44	39.99	3,010,692,202.05	71.09

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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：人民币元）	
		本期末（2013年3月18日）	上年度末（2012年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	-	170,801,228.92
	业绩比较基准下降5%	-	-170,801,228.92

注：本基金2013年3月18日终止上市。

#### 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) 各层级金融工具公允价值

于2013年3月18日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为1,725,593,337.27元，属于第二层级的余额为8,655,886.17元，无属于第三层级的余额(2012年6月30日：第一层级3,046,619,283.66元，无第二、三层级)。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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)等情况，本基金不会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将相关股票的

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，确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信优势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 2013 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	22,418,760.46
结算备付金		1,192,414,265.90
存出保证金		832,185.31
交易性金融资产	6.4.7.2	2,038,113,643.58
其中：股票投资		2,038,113,643.58
基金投资		-
债券投资		-
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	349,281.04
应收股利		1,080,818.18
应收申购款		80,039.52
其他资产	6.4.7.6	25,174.98
资产总计		3,255,314,168.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		31,403,964.47
应付赎回款		12,093,882.72

应付管理人报酬		3,539,517.80
应付托管费		707,903.58
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	4,122,243.53
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
其他负债	6.4.7.8	1,123,134.99
负债合计		52,990,647.09
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	3,537,095,869.20
未分配利润	6.4.7.10	-334,772,347.32
所有者权益合计		3,202,323,521.88
负债和所有者权益总计		3,255,314,168.97

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.905 元，基金份额总额 3,537,095,869.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-64,478,479.82
1. 利息收入		8,069,784.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,265,450.64
债券利息收入		14,006.33
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		790,327.30
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		88,486,870.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	63,030,369.13
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,095,703.77
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	23,360,798.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-161,797,827.43
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	762,692.42



<b>减：二、费用</b>		19,176,341.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,713,636.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,742,727.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,569,399.40
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	150,578.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-83,654,821.05
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-83,654,821.05

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 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）	4,642,655,005.00	-305,952,887.52	4,336,702,117.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-83,654,821.05	-83,654,821.05
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）	-1,105,559,135.80	54,835,361.25	-1,050,723,774.55
其中：1. 基金申购款	1,267,099.34	-54,837.03	1,212,262.31
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,106,826,235.14	54,890,198.28	-1,051,936,036.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,537,095,869.20	-334,772,347.32	3,202,323,521.88

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

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：

<u>孙志晨</u>	<u>何斌</u>	<u>秦绪华</u>
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

建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由建信优势动力股票型证券投资基金转型而成。

建信优势动力股票型证券投资基金遵照《基金法》于 2008 年 2 月 1 日获中国证监会证监许可[2008]216 号文批准募集。建信优势动力股票型证券投资基金基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。基金管理人于 2008 年 3 月 19 日获得中国证监会书面确认，《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》生效，基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,639,183,830.39 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(2008)第 017 号验资报告予以验证。基金合同生效日的基金份额总额为 4,642,655,005.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,513,584.86 份基金份额，场外认购资金小数点后部分利息退回折合 42,410.25 份基金份额。建信优势动力股票型证券投资基金基金合同生效后，存续期为五年，该基金的基金合同终止日为 2013 年 3 月 18 日。

2013 年 1 月 28 日建信优势动力股票型证券投资基金份额持有人大会以现场方式召开，大会审议建信优势动力股票型证券投资基金转型议案，内容包括建信优势动力股票型证券投资基金在存续期届满后变更运作方式（即变更为上市开放式基金）、调整基金投资比例、基金更名和修订基金合同等。依据中国证监会 2013 年 3 月 1 日证监许可[2013]204 号文核准，持有人大会决议生效。自 2013 年 3 月 19 日起《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》失效且《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。基金转型为上市开放式基金后，存续期为不定期，同时基金更名为“建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优势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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金为股票型基金，股票投资占基金资产净值的比例为 60%-95%，权证占基金资产净值的比例不超过 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金投资业绩比较基准为： $75\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2013]第 106 号文审核同意，本基金

2,348,989,482.00 份基金份额于 2013 年 4 月 3 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同（LOF）》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 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日止期间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 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2013 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具

有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的市盈率法等估值技术进行估值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	22,418,760.46
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
-	-
其他存款	-
合计：	22,418,760.46

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	1,947,403,703.23	2,038,113,643.58	90,709,940.35
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	1,947,403,703.23	2,038,113,643.58	90,709,940.35

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	127,350.18
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	221,556.46
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	374.40
合计	349,281.04

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	25,174.98
合计	25,174.98

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。



### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,117,413.93
银行间市场应付交易费用	4,829.60
合计	4,122,243.53

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	33,604.32
预提费用	339,530.67
合计	1,123,134.99

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	4,642,655,005.00	4,642,655,005.00
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1,267,099.34	1,267,099.34
本期赎回（以“-”号填列）	-1,106,826,235.14	-1,106,826,235.14
本期末	3,537,095,869.20	3,537,095,869.20

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得基金份额为 636,846,895.00，托管在场外未上市交易得基金份额为 2,900,248,974.20。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。

3、根据《建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的相关规定，本基金的转换业务自 2013 年 5 月 24 日起开始办理。

### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	78,143,006.38	-161,797,827.43	-83,654,821.05
本期基金份额交易产生的变动数	127,741,472.44	-72,906,111.19	54,835,361.25
其中：基金申购款	-137,809.26	82,972.23	-54,837.03
基金赎回款	127,879,281.70	-72,989,083.42	54,890,198.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-352,576,176.48	17,803,829.16	-334,772,347.32

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	825,722.65
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	6,436,852.30
其他	2,875.69
合计	7,265,450.64

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	711,946,695.81
减：卖出股票成本总额	648,916,326.68
买卖股票差价收入	63,030,369.13

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月19日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	28,557,051.60
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,445,368.55
应收利息总额	15,979.28

债券投资收益	2,095,703.77
--------	--------------

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

#### 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

本基金本报告期间无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	23,360,798.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,360,798.02

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-161,797,827.43
——股票投资	-161,797,827.43
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-161,797,827.43

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	762,692.42
合计	762,692.42

注：1、本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

2、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,569,399.40
银行间市场交易费用	-
合计	2,569,399.40

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	31,057.52
信息披露费	85,478.64
上市费	22,167.76
账户维护费	4,500.00
银行汇划费用	7,374.25
合计	150,578.17

注：本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

## 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

截至报表批准报出日本基金未存在资产负债表日后发生的利润分配、基金拆分、基金转型等非调整事项。

## 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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.9.2 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
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 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
	2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	13,713,636.38
其中：支付销售机构的客户维护费	483,211.25

注：1、本基金基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

2、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.25% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.25% / 当年天数；

3、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	2,742,727.28

注：1、本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

2、支付基金托管人交通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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费用。

### 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

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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	
	2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日	
期初持有的基金份额	10,003,950.00	
期间申购/买入总份额	0.00	
期间因拆分增加的份额	0.00	
期间赎回/卖出总份额	-	
期末持有的基金份额	10,003,950.00	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.28%	

##### 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 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	
	2013 年 3 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	22,418,760.46	825,722.65

注：1、本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未满六个月。

2、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

3、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2013 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

## 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

报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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 年 6 月 20 日	非公开发行股票	13.22	2013 年 7 月 16 日	13.78	830,340	9,549,375.33	10,977,094.80	

注：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。

### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

## 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

### 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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，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。

本期末，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如附注 6.4.13.4.3.1 所示，与债券投资相关的信用风险不重大（上年末：同）。

### 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，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 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资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额即约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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 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	22,418,760.46	-	-	-	22,418,760.46
结算备付金	1,192,414,265.90	-	-	-	1,192,414,265.90
存出保证金	832,185.31	-	-	-	832,185.31
交易性金融资产	-	-	-	2,038,113,643.58	2,038,113,643.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	349,281.04	349,281.04
应收股利	-	-	-	1,080,818.18	1,080,818.18
应收申购款	-	-	-	80,039.52	80,039.52
其他资产	-	-	-	25,174.98	25,174.98
资产总计	1,215,665,211.67	-	-	2,039,648,957.30	3,255,314,168.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	31,403,964.47	31,403,964.47
应付赎回款	-	-	-	12,093,882.72	12,093,882.72
应付管理人报酬	-	-	-	3,539,517.80	3,539,517.80
应付托管费	-	-	-	707,903.58	707,903.58
应付交易费用	-	-	-	4,122,243.53	4,122,243.53
其他负债	-	-	-	1,123,134.99	1,123,134.99
负债总计	-	-	-	52,990,647.09	52,990,647.09
利率敏感度缺口	1,215,665,211.67	-	-	1,986,658,310.21	3,202,323,521.88

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，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如附注 6.4.13.4.3.1 所示，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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，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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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投资比例范围为基金资产的 60%-100%，其中，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 0-40%，其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的比例最低可以为 0。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，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 2013 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,038,113,643.58	63.64
交易性金融资产-基金投资	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,038,113,643.58	63.64

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金合同于 2013 年 3 月 19 日生效，本报告期无足够经验数据。

#### 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) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额 2,027,136,548.78 元，属于第二层级的余额为 10,977,094.80 元，无属于第三层级的余额。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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)等情况，本基金不会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将相关股票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，确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

##### (iv) 第三层级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(转型前)

### 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	1,725,593,337.27	38.70
	其中：股票	1,725,593,337.27	38.70
2	固定收益投资	8,655,886.17	0.19
	其中：债券	8,655,886.17	0.19
	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	1,780,297,510.33	39.93
6	其他资产	944,252,006.79	21.18
7	合计	4,458,798,740.56	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	824,244,222.41	19.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	59,277,536.10	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,126,337.32	1.34
J	金融业	344,853,144.34	7.95
K	房地产业	334,326,497.10	7.71
L	租赁和商务服务业	56,175,600.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	48,590,000.00	1.12
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	1,725,593,337.27	39.79

注：以上行业分类以 2013 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	9,780,600	98,295,030.00	2.27
2	000002	万科A	8,866,996	94,788,187.24	2.19
3	600837	海通证券	8,061,900	87,310,377.00	2.01
4	000581	威孚高科	2,000,000	83,200,000.00	1.92
5	000625	长安汽车	10,000,000	83,100,000.00	1.92
6	600519	贵州茅台	460,000	77,947,000.00	1.80
7	000671	阳光城	4,776,288	70,736,825.28	1.63
8	601166	兴业银行	3,600,000	66,600,000.00	1.54
9	600383	金地集团	10,000,000	60,500,000.00	1.40
10	600422	昆明制药	2,500,000	58,600,000.00	1.35
11	000651	格力电器	2,060,000	56,650,000.00	1.31
12	600048	保利地产	4,800,000	51,648,000.00	1.19
13	000063	中兴通讯	4,197,013	51,245,528.73	1.18
14	600030	中信证券	3,957,922	49,948,975.64	1.15
15	300070	碧水源	1,000,000	48,590,000.00	1.12
16	000423	东阿阿胶	912,390	46,249,049.10	1.07
17	002344	海宁皮城	1,300,000	44,460,000.00	1.03
18	000001	平安银行	1,999,942	42,698,761.70	0.98
19	600089	特变电工	5,999,894	42,059,256.94	0.97
20	600637	百视通	2,461,375	39,480,455.00	0.91
21	600585	海螺水泥	2,263,021	36,909,872.51	0.85
22	002277	友阿股份	3,600,000	33,948,000.00	0.78
23	000157	中联重科	3,330,000	27,639,000.00	0.64
24	000024	招商地产	1,150,000	26,703,000.00	0.62
25	600079	人福医药	1,017,208	25,847,255.28	0.60
26	600697	欧亚集团	1,197,614	25,329,536.10	0.58
27	600031	三一重工	2,199,947	22,967,446.68	0.53
28	300119	瑞普生物	1,000,000	22,430,000.00	0.52
29	002410	广联达	794,456	18,645,882.32	0.43
30	600887	伊利股份	600,000	18,582,000.00	0.43

31	300005	探路者	1,277,008	17,878,112.00	0.41
32	000861	海印股份	1,396,129	17,130,502.83	0.40
33	601633	长城汽车	523,580	16,283,338.00	0.38
34	600809	山西汾酒	418,868	15,318,002.76	0.35
35	002353	杰瑞股份	200,000	13,682,000.00	0.32
36	000656	金科股份	1,081,855	12,819,981.75	0.30
37	601888	中国国旅	390,000	11,715,600.00	0.27
38	600177	雅戈尔	1,499,983	11,474,869.95	0.26
39	300257	开山股份	280,000	10,920,000.00	0.25
40	002456	欧菲光	171,092	10,682,984.48	0.25
41	600426	华鲁恒升	1,340,000	10,452,000.00	0.24
42	601299	中国北车	2,300,000	9,913,000.00	0.23
43	600309	烟台万华	600,000	9,732,000.00	0.22
44	002450	康得新	300,000	9,570,000.00	0.22
45	002029	七匹狼	600,000	9,534,000.00	0.22
46	300124	汇川技术	300,000	7,602,000.00	0.18
47	601126	四方股份	459,338	6,756,861.98	0.16
48	601100	恒立油缸	663,900	6,313,689.00	0.15
49	000639	西王食品	241,900	4,704,955.00	0.11

## 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	600837	海通证券	87,055,880.92	2.06
2	600030	中信证券	52,533,317.84	1.24
3	600089	特变电工	47,548,685.73	1.12
4	000063	中兴通讯	46,580,516.30	1.10
5	000001	平安银行	44,804,401.94	1.06
6	600031	三一重工	23,817,940.64	0.56
7	300155	安居宝	22,420,814.23	0.53
8	600422	昆明制药	12,302,214.60	0.29
9	601888	中国国旅	11,769,156.25	0.28
10	600177	雅戈尔	11,652,877.54	0.28
11	601299	中国北车	10,068,302.00	0.24

12	000157	中联重科	2,803,911.00	0.07
13	002410	广联达	491,923.18	0.01

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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	600016	民生银行	214,891,513.43	5.07
2	601318	中国平安	120,381,099.01	2.84
3	600048	保利地产	105,284,785.87	2.49
4	300070	碧水源	78,257,593.18	1.85
5	000651	格力电器	70,020,347.61	1.65
6	600519	贵州茅台	68,441,430.82	1.62
7	000581	威孚高科	65,656,176.77	1.55
8	000961	中南建设	63,480,889.49	1.50
9	000625	长安汽车	62,731,736.21	1.48
10	601336	新华保险	58,782,058.00	1.39
11	000024	招商地产	50,468,863.63	1.19
12	601166	兴业银行	49,751,398.99	1.17
13	000669	领先科技	44,129,671.10	1.04
14	002029	七匹狼	42,008,181.59	0.99
15	002344	海宁皮城	39,595,413.49	0.94
16	002304	洋河股份	36,309,735.29	0.86
17	601918	国投新集	32,231,791.65	0.76
18	600011	华能国际	27,486,201.33	0.65
19	600104	上汽集团	26,106,107.89	0.62
20	600858	银座股份	26,020,949.26	0.61

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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	373,849,942.17
卖出股票收入（成交）总额	1,773,764,081.78

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

## 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,655,886.17	0.20
8	其他	-	-
9	合计	8,655,886.17	0.20

## 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	110023	民生转债	86,560	8,655,886.17	0.20

## 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

本基金本报告期末未投资股指期货。



## 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期未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。**

**7.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

### 7.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	333,447.11
2	应收证券清算款	938,169,729.73
3	应收股利	-
4	应收利息	5,748,829.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	944,252,006.79

### 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 投资组合报告(转型后)

### 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	2,038,113,643.58	62.61
	其中：股票	2,038,113,643.58	62.61
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,214,833,026.36	37.32
6	其他资产	2,367,499.03	0.07

7	合计	3,255,314,168.97	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	883,142,448.77	27.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,510,620.64	1.51
E	建筑业	26,073,910.80	0.81
F	批发和零售业	46,576,121.46	1.45
G	交通运输、仓储和邮政业	17,034,562.08	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,485,377.92	2.54
J	金融业	214,803,270.94	6.71
K	房地产业	595,209,149.69	18.59
L	租赁和商务服务业	68,679,957.60	2.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	56,598,223.68	1.77
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	2,038,113,643.58	63.64

注：以上行业分类以 2013 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 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(转型后)

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	000002	万科A	16,477,223	162,300,646.55	5.07
2	600383	金地集团	23,386,000	160,427,960.00	5.01
3	600519	贵州茅台	732,677	140,945,074.49	4.40
4	000671	阳光城	8,906,897	105,546,729.45	3.30
5	000625	长安汽车	11,321,741	105,178,973.89	3.28
6	600048	保利地产	9,250,589	91,673,336.99	2.86
7	000581	威孚高科	2,600,000	86,814,000.00	2.71
8	002410	广联达	4,297,752	81,485,377.92	2.54
9	000001	平安银行	6,751,797	67,315,416.09	2.10

10	000100	TCL 集团	29,570,125	67,124,183.75	2.10
11	600016	民生银行	7,584,689	65,000,784.73	2.03
12	600585	海螺水泥	4,779,186	63,945,508.68	2.00
13	300070	碧水源	1,502,076	56,598,223.68	1.77
14	601166	兴业银行	3,600,000	53,172,000.00	1.66
15	000725	京东方 A	22,845,847	50,717,780.34	1.58
16	002344	海宁皮城	2,600,000	49,686,000.00	1.55
17	000024	招商地产	2,004,669	48,673,363.32	1.52
18	600795	国电电力	21,276,588	48,510,620.64	1.51
19	000063	中兴通讯	3,506,404	44,706,651.00	1.40
20	000651	格力电器	1,500,000	37,590,000.00	1.17
21	000423	东阿阿胶	912,390	35,291,245.20	1.10
22	000527	美的电器	2,633,539	32,708,554.38	1.02
23	300119	瑞普生物	1,499,994	31,544,873.82	0.99
24	000800	一汽轿车	2,430,000	29,889,000.00	0.93
25	600837	海通证券	3,125,274	29,315,070.12	0.92
26	600079	人福医药	1,017,208	26,528,784.64	0.83
27	002277	友阿股份	3,300,000	24,552,000.00	0.77
28	600697	欧亚集团	1,197,614	22,024,121.46	0.69
29	601888	中国国旅	650,478	18,993,957.60	0.59
30	600887	伊利股份	600,000	18,768,000.00	0.59
31	601633	长城汽车	523,580	18,545,203.60	0.58
32	600312	平高电气	1,972,664	18,187,962.08	0.57
33	600009	上海机场	1,429,074	17,034,562.08	0.53
34	601117	中国化学	1,585,800	15,096,816.00	0.47
35	300005	探路者	1,532,407	14,619,162.78	0.46
36	600366	宁波韵升	893,350	14,105,996.50	0.44
37	000656	金科股份	1,166,855	13,523,849.45	0.42
38	600261	阳光照明	1,063,179	13,481,109.72	0.42
39	601886	江河创建	830,340	10,977,094.80	0.34
40	300257	开山股份	293,652	9,734,563.80	0.30
41	600309	万华化学	600,000	9,612,000.00	0.30
42	000861	海印股份	800,000	7,352,000.00	0.23
43	601126	四方股份	459,338	6,637,434.10	0.21
44	601100	恒立油缸	663,900	6,466,386.00	0.20
45	000540	中天城投	510,400	3,577,904.00	0.11
46	600067	冠城大通	117,200	936,428.00	0.03
47	002146	荣盛发展	64,509	910,221.99	0.03
48	600340	华夏幸福	8,811	286,709.94	0.01

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000100	TCL 集团	103,402,484.14	3.23
2	600383	金地集团	102,296,679.40	3.19
3	000002	万 科A	89,810,356.71	2.80
4	000800	一汽轿车	87,678,811.49	2.74
5	600795	国电电力	77,789,329.66	2.43
6	000725	京东方 A	73,445,178.00	2.29
7	002410	广联达	59,082,967.75	1.85
8	600048	保利地产	48,895,403.90	1.53
9	600519	贵州茅台	47,962,153.15	1.50
10	000001	平安银行	44,978,094.56	1.40
11	600585	海螺水泥	44,889,695.36	1.40
12	000527	美的电器	37,272,663.24	1.16
13	600837	海通证券	36,318,967.71	1.13
14	000024	招商地产	23,521,077.82	0.73
15	000651	格力电器	21,542,392.25	0.67
16	000581	威孚高科	21,326,585.09	0.67
17	600009	上海机场	19,294,751.03	0.60
18	600312	平高电气	19,104,458.29	0.60
19	601886	江河创建	19,098,750.66	0.60
20	600030	中信证券	19,006,104.27	0.59

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	87,527,320.98	2.73
2	600030	中信证券	65,343,659.17	2.04
3	600422	昆明制药	62,186,478.98	1.94
4	600637	百视通	57,961,500.76	1.81
5	000800	一汽轿车	55,951,980.94	1.75

6	600089	特变电工	40,439,860.64	1.26
7	000651	格力电器	36,206,889.41	1.13
8	600016	民生银行	34,299,713.96	1.07
9	000157	中联重科	24,069,847.93	0.75
10	600031	三一重工	19,958,972.96	0.62
11	000063	中兴通讯	18,808,850.01	0.59
12	000100	TCL 集团	18,778,866.19	0.59
13	000725	京东方 A	18,776,415.10	0.59
14	002456	欧菲光	18,039,903.43	0.56
15	002353	杰瑞股份	16,298,159.55	0.51
16	600795	国电电力	14,071,178.19	0.44
17	002450	康得新	12,268,443.40	0.38
18	600177	雅戈尔	11,316,157.12	0.35
19	600809	山西汾酒	11,139,232.91	0.35
20	300124	汇川技术	9,847,062.33	0.31

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,123,234,460.42
卖出股票收入（成交）总额	711,946,695.81

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 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期未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。**

**7.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

### 7.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	832,185.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,080,818.18
4	应收利息	349,281.04
5	应收申购款	80,039.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,174.98
8	其他	-
9	合计	2,367,499.03

### 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可转换债券。

### 7.10.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息(转型前)

### 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

93,746	49,523.77	1,712,778,796.00	36.89%	2,929,876,209.00	63.11%
--------	-----------	------------------	--------	------------------	--------

## 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	395,691,826.00	16.85%
2	中国人寿保险股份有限公司	387,863,186.00	16.51%
3	泰康人寿保险股份有限公司 — 分红 — 个人分红 — 019L-FH002 深	142,662,334.00	6.07%
4	中国太平洋人寿保险股份有 限公司—传统—普通保险产品	111,786,166.00	4.76%
5	幸福人寿保险股份有限公司 — 分红	76,954,860.00	3.28%
6	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC	67,261,495.00	2.86%
7	陈鸣宇	60,710,894.00	2.58%
8	中国人寿保险股份有限公司 传统账户	53,148,018.00	2.26%
9	新华人寿保险股份有限公司	52,573,067.00	2.24%
10	中国人寿财产保险股份有限公司 — 传统 — 普通保险产品	35,647,698.00	1.52%

注：持有人为场内持有人。

## 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	-	-

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 8 基金份额持有人信息(转型后)

### 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
77,293	45,762.18	1,327,888,393.00	37.54%	2,209,207,476.20	62.46%

## 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	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC	67,261,495.00	10.56%
2	新华人寿保险股份有限公司	52,573,067.00	8.26%
3	中船重工财务有限责任公司	16,275,300.00	2.56%
4	徐满花	10,005,600.00	1.57%
5	北京地缘天筑房地产开发有限 公司	10,005,000.00	1.57%
6	潘铭镜	5,502,310.00	0.86%
7	聊城恒萃房地产开发有限公司	5,012,705.00	0.79%
8	李桂妍	4,502,430.00	0.71%
9	天津市万博公司	3,059,344.00	0.48%
10	天津国际投资有限公司	3,001,680.00	0.47%

注：持有人为场内持有人。

## 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	-	-

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年3月19日）基金份额总额	4,642,655,005.00
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	1,267,099.34
报告期期间基金总赎回份额	1,106,826,235.14
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	3,537,095,869.20

注：1、本基金基金合同自2013年3月19日起生效，至2013年6月30日未满六个月。

2、上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于2013年1月28日以现场方式在北京召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了



《关于建信优势动力股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证监会证监许可（2013）204 号《关于核准建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》核准，本基金基金份额持有人大会决议生效。

## 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

我公司于 2013 年 3 月 28 日召开 2013 年度第一次临时股东会，会议决定与公司控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的马梅琴女士、俞斌先生不再担任公司董事，增选中国建设银行股份有限公司提名的曹伟先生和美国信安金融集团提名的欧阳伯权先生担任公司董事。公司已将前述董事任免情况报告备案至中国证监会基金部和北京监管局。公司目前现有 9 名董事，其中与控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的董事为 3 名，符合《证券投资基金管理公司管理办法》第四十一条第三款的监管要求。

2013 年 6 月 20 日我公司第三届董事会第十二次临时会议一致同意副总经理张延明离职，我公司于 2013 年 6 月 20 日正式上报中国证券投资基金业协会和北京证监局备案，并于 2013 年 6 月 21 日获得中国基金业协会的备案文件。我公司于 2013 年 6 月 22 日对外公告，张延明于 2013 年 6 月 20 日正式离职。

报告期内，本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

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

### 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	
齐鲁证券	3	645,147,092.58	35.15%	566,524.66	34.57%	-
东方证券	1	577,448,672.15	31.47%	525,708.11	32.08%	-
安信证券	2	244,694,507.98	13.33%	222,769.49	13.59%	-
光大证券	1	202,040,078.39	11.01%	178,591.34	10.90%	-
中投证券	2	61,893,156.23	3.37%	53,758.45	3.28%	-
国金证券	1	49,871,858.35	2.72%	45,403.51	2.77%	-
华泰证券	1	36,005,365.80	1.96%	30,060.25	1.83%	-
招商证券	1	18,080,424.75	0.99%	15,999.70	0.98%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人。能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

- 3、本基金本报告期内无新增交易单元，本报告期内无剔除交易单元。
- 4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。
- 5、本基金合同自 2013 年 3 月 19 日起生效，至 2013 年 6 月 30 日未滿六个月。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	19,575,586.00	68.55%	-	-	-	-
华泰证券	8,981,465.60	31.45%				

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

### 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	
华创证券	1	597,021,337.64	27.80%	528,305.63	27.79%	-
瑞银证券	1	446,443,240.20	20.79%	391,612.28	20.60%	-
齐鲁证券	3	384,457,978.41	17.90%	343,848.03	18.09%	-
中投证券	2	221,392,070.33	10.31%	197,221.90	10.38%	-
华泰证券	1	218,293,950.26	10.16%	192,047.86	10.10%	-
招商证券	1	172,876,077.53	8.05%	152,977.86	8.05%	-
东方证券	1	107,129,369.58	4.99%	94,798.93	4.99%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基

金字[2007]48 号) 的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

(1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

(3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人。能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内剔除华泰证券 1 个交易单元。

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

5、本财务报表的实际编制期间为 2013 年 1 月 1 至 2013 年 3 月 18 日(基金合同失效日)。

### 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

本报告期内，本基金租用的证券公司交易单元未进行其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 6 月 22 日
2	关于公司旗下部分开放式基金开办定投业务及开通直销中心和建设银行渠道跨 TA 转换业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 5 月 22 日
3	建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）上市交易及开放申购赎回提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 4 月 3 日
4	建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 29 日

	回业务公告		
5	建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）上市交易公告书	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 29 日
6	关于建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）开通跨系统转托管业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 27 日

### 10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于建信优势动力股票型证券投资基金终止上市及转型期间基金名称、代码变更等事项的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 16 日
2	建信优势动力股票型证券投资基金终止上市的第二次提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 15 日
3	建信优势动力股票型证券投资基金终止上市的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 14 日
4	建信优势动力股票型证券投资基金终止上市的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 12 日
5	建信基金管理有限责任公司关于建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 3 月 7 日
6	关于建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 1 月 29 日
7	关于建信优势动力股票型证券投资基金停牌的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 1 月 17 日
8	建信优势动力股票型证券投资	指定报刊和/或公司	2013 年 1 月 16 日

	基金召开基金份额持有人大会 第三次提示性公告	网站	
9	建信优势动力股票型证券投资 基金召开基金份额持有人大会 第二次提示性公告	指定报刊和/或公司 网站	2013 年 1 月 10 日
10	关于建信优势动力股票型证券 投资基金代销机构建设银行就 基金份额持有人大会增加征集 授权方式的公告	指定报刊和/或公司 网站	2013 年 1 月 4 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司  
2013 年 8 月 26 日