

益民创新优势混合型证券投资基金 2012 年 半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：益民基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 17 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。

本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 2012 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	10
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	11
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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	32
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	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	37
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	37
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	37
7.9 投资组合报告附注	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
§9 开放式基金份额变动	38

§10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件	42
§11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	益民创新优势混合型证券投资基金
基金简称	益民创新优势混合
基金主代码	560003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 7 月 11 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,472,427,749.21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的优势企业和潜在优势企业，为基金份额持有人实现较高风险水平下的较高收益。
投资策略	本基金着眼于全球视野，遵循从全球到国内的分析思路，从对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点，再结合国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析，从而判别国内各行业产业链传导的内在机制，并从中找出能够分享全球经济增长的创新行业或主题。本基金对于企业创新特性的定义将主要包括四大方面：技术创新，产品及服务创新、制度创新和商业模式创新。本基金将以寻求创新溢价为目标，来综合构建基金组合。
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	本基金产品定位于偏股型的混合型基金。风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		益民基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘伟	李芳菲
	联系电话	010-63105556	010-66060069
	电子邮箱	jcb@ymfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-650-8808	95599
传真		010-63100588	010-63201816
注册地址		重庆市渝中区上清寺路 110 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区宣外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100052	100031
法定代表人	翁振杰	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ymfund.com
基金半年度报告备置地点	北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	益民基金管理有限公司	北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

§ 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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-164,190,467.66
本期利润	-65,114,422.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0144
本期加权平均净值利润率	-1.90%
本期基金份额净值增长率	-1.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,155,460,927.69
期末可供分配基金份额利润	-0.2584
期末基金资产净值	3,316,966,821.52
期末基金份额净值	0.7416
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-24.70%

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

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。

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)。

3.2 基金净值表现

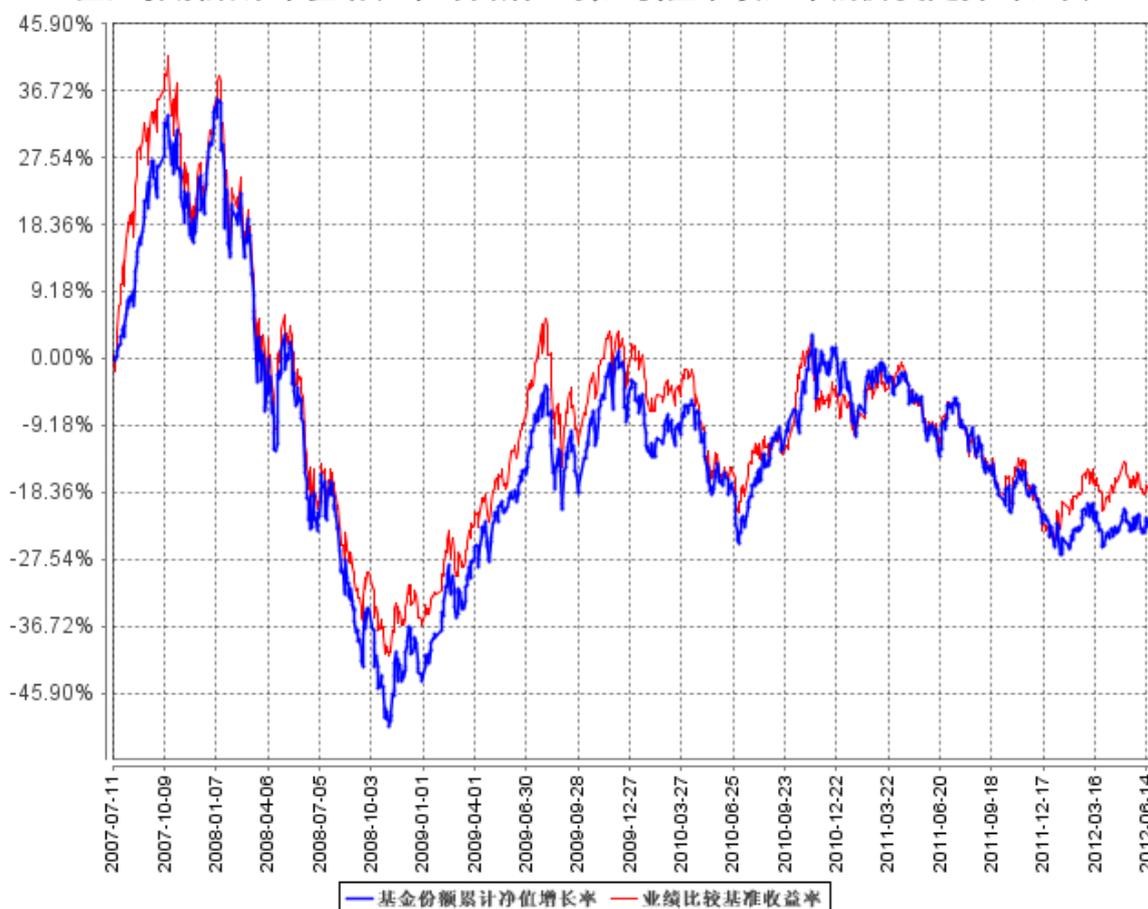
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.95%	0.95%	-4.79%	0.82%	0.84%	0.13%
过去三个月	1.20%	0.92%	0.53%	0.84%	0.67%	0.08%
过去六个月	-1.94%	1.06%	4.38%	1.00%	-6.32%	0.06%
过去一年	-17.58%	1.01%	-13.51%	1.01%	-4.07%	0.00%
过去三年	-10.45%	1.28%	-13.30%	1.18%	2.85%	0.10%
自基金合同生效起至今	-24.70%	1.61%	-20.17%	1.46%	-4.53%	0.15%

注：自 2009 年 5 月 1 日起益民创新优势混合型证券投资基金的业绩比较基准，由原来的“沪深 300 指数收益率×75%+新华巴克莱指数收益率×25%”变更为“沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%”。

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：按照本基金的基金合同约定，本基金自 2007 年 7 月 11 日合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 12 月 12 日正式成立。公司股东由重庆国际信托有限公司（出资比例 49%）、中国新纪元有限公司（出资比例 31%）、中山证券有限责任公司（出资比例 20%）组成，注册资本为 1 亿元人民币，注册地：重庆，主要办公地点：北京。截止 2012 年年 6 月末，公司管理的基金共有四只，均为开放式基金。其中，益民货币市场基金于 2006 年 7 月 17 日成立；益民红利成长混合型证券投资基金于 2006 年 11 月 21 日成立；益民创新优势混合型证券投资基金于 2007 年 7 月 11 日成立；益民多利债券型投资基金于 2008 年 5 月 21 日成立。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李勇钢	益民货币市场基金基金经理、益民创新优势混合型证券投资基金基金经理、益民多利债券型证券投资基金基金经理	2011年9月26日	-	4	清华大学硕士。曾任中再资产管理股份有限公司研究员、投资经理。自2011年8月31日起任益民货币市场基金基金经理、益民多利债券型证券投资基金基金经理；自2011年9月26日起任益民创新优势混合型证券投资基金基金经理。
韩宁	益民创新优势混合型证券投资基金基金经理	2012年3月21日	-	11	中国有色金属材料总公司业务经理、闽发证券有限责任公司高级研究员、新时代证券有限责任公司高级研究员。自2005年加入益民基金管理有限公司，曾先后担任行业研究员、研究部副总经理。自2012年3月21日起任益民创新优势混合型证券投资基金基金经理。

注：此处的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起规范的公平交易机制，对于场内交易，公司规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

本报告期内，公司严格遵守公平交易管理制度的相关规定，投资决策和交易执行环节的内部控制有效，在投资管理活动中公平对待不同投资组合。对于交易所公开竞价交易，公司均执行交易系统中的公平交易程序，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令；因特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，需履行事先审批流程；对不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和交易数量，公司在获配额度确定后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；公司根据市场公认的第三方信息，对投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，相关投资组合经理应对交易价格异常情况进行合理性解释。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为，不同投资组合之间不存在交易所公开竞价同日反向交易，不存在报告期内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% 的情形。

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

股票市场的走势或多或少会受到经济形势的影响，年初至今的经济形势略超本基金的预期，市场对于未来经济的恐慌预期更是到了一个极致。年初以来，我们对全年经济形势的判断一直都是“L”型走势，即上半年下行，下半年企稳，这种观点在年初的时点来看，已经是属于悲观派，因为当时很多投资者认为经济将在一季度，最晚也在二季度见底并回升。在目前的时点，我们还是维持全年经济“L”型走势的观点，但环顾市场，此种观点现在似乎已经转变为乐观派，越来越多的投资者认为中国经济要在四季度或者明年见底，更有甚者抛出经济崩溃论，本基金认为这大可不必，因为尽管对于中国经济增长方式诟病很多，但所谓经济的崩溃与泡沫的破碎都不是一朝一夕的事情，没有理由用一个长期的逻辑去论证短期的市场波动，而且每次在临近市场底部的区域时，总会有各种各样的悲观言论出现，

这是不足为奇的。

由于本基金对经济的判断是“L”型，因此年初至今投资操作一直是偏向于防御。现在看来，尽管我们对市场指数的走势判断基本正确，但今年上半年的行情呈现出结构性牛市，很多个股的涨跌都演绎到了极致：高估值的不断上涨、而更多的股票呈现出估值的系统性下行。由于本基金持仓品种与市场风格热点不匹配，因此造成上半年表现不佳，没有起到应有的防御效果，这里向广大的投资者致歉。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期末，本基金份额净值为 0.7416 元，本报告期份额净值增长率为-1.94%，同期业绩比较基准收益率为 4.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场的下跌，已经蕴含了对国内经济非常悲观的硬着陆预期。至于下半年市场的走势，“猜”底部在哪里是没有任何意义的。如果下半年经济有所反弹或者企稳，我们认为下半年股市走出一波像样的行情的可能性还是很大的。六月份信贷数据的超预期、七月汇丰 PMI 初值的回升，已经给我们以经济回暖的一些迹象，后续数据还有待继续观察，但如果耐心一点，给政策一些发挥效力的时间，下半年经济企稳是大概率事件，股票市场也是有机会的，当然，这个机会什么时候到来还尚未可知，需要观察和等待。

从技术面来看，目前的走势也出现了市场寻底的一些特征，与 2008 年底和 2011 年底的走势有相似之处，譬如在目前的时点，指数下跌缓慢或者说下跌空间有限，但个股杀跌的风险极大。因此，我们所需要的就是更加耐心一点，密切关注市场转暖的信号和迹象。

下半年的操作思路，在经济和市场没有出现明确右侧信号之前，我们将保持一个谨慎的仓位，并将继续择机兑现一些还没有下跌，处于高位的股票，因为无论市场后续反弹与否，这种股票的收益风险比大概率是不佳的。而一旦市场出现具备经济基本面配合的反转，本基金将优先考虑增持超跌的传统周期股，如水泥、工程机械、煤炭等，另外就是会逢低吸纳一些有一定跌幅、今年业绩高增长的优质成长股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

根据相关规定，本基金管理人成立估值委员会，估值委员会是基金估值的最高决策机构，负责公司估值相关决策及执行。成员由公司总经理、投资总监、运作保障部、金融工程部、监察稽核部、基金会计等相关人员组成。相关参与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验，熟悉相关法规和估值方法。

研究部行业研究员：研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究，参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定，并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责；相关参与人员应当具有多年的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法规和估值方法。

监察稽核部：监察稽核部参与估值流程的人员，应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改；参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验，应当具备熟知与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法的专业能力，并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

金融工程部金融工程人员：金融工程人员负责估值相关数值的处理和计算，并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验，具备基金绩效评估专业能力，并熟悉相关法规和估值方法。

运作保障部基金会计：基金会计在估值流程中的相关工作职责是按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行日常估值。参与基金组合停牌股票估值方法的确定，复核由估值委员会提供的估值价格，并与相关托管行进行核对确认。如有不符合的情况出现，立即向估值委员会反映情况，并提出合理的调整建议。基金会计人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通，获悉的与基金估值相关的重大信息及时向公司及估值委员会反馈。基金会计应当具备多年基金从业经验，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，具备熟悉及了解基金估值法规、政策和专业的专业能力。

2、基金经理参与或决定估值的程度：

基金管理公司估值委员会成员中不包括基金经理。基金经理不参与估值工作决策和执行的过程。

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；

4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

5、在符合有关基金分红条件的情况下，本基金收益分配每季度不超过三次，每年不超过十二次。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

§ 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

在托管益民创新优势混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》、《益民创新优势混合型证券投资基金托管协议》的约定，对益民创新优势混合型证券投资基金管理人—益民基金管理有限公司 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，益民基金管理有限公司在益民创新优势混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，益民基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的益民创新优势混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

2012 年 8 月 17 日

§ 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：益民创新优势混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	115,635,315.91	95,470,030.93
结算备付金		25,288,538.97	18,460,491.81
存出保证金		5,238,175.81	2,750,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	3,054,662,505.54	3,088,692,387.13
其中：股票投资		2,771,374,677.54	2,594,408,443.93
基金投资		-	-
债券投资		283,287,828.00	494,283,943.20
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	173,151,299.73	274,141,171.21
应收证券清算款		19,563,028.44	-
应收利息	6.4.7.5	5,224,937.27	4,822,095.61
应收股利		795,654.72	-
应收申购款		9,288.31	13,793.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	100,547.92	-
资产总计		3,399,669,292.62	3,484,349,969.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负 债：			
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		66,137,174.39	10,997,366.81
应付赎回款		476,105.66	530,071.17
应付管理人报酬		4,163,784.39	4,537,883.93
应付托管费		693,964.05	756,313.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,379,962.71	3,314,220.00
应交税费		1,311,693.60	1,162,137.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,539,786.30	2,810,002.18
负债合计		82,702,471.10	24,107,995.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,472,427,749.21	4,575,288,483.10
未分配利润	6.4.7.10	-1,155,460,927.69	-1,115,046,508.97
所有者权益合计		3,316,966,821.52	3,460,241,974.13
负债和所有者权益总计		3,399,669,292.62	3,484,349,969.80

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7416 元，基金份额总额 4,472,427,749.21 份。

6.2 利润表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		-10,339,624.49	-276,467,321.32
1.利息收入		9,609,084.80	7,596,245.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,240,373.67	1,610,054.64
债券利息收入		6,323,039.77	3,963,192.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,045,671.36	2,022,998.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-119,048,073.08	259,601,962.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-140,174,689.93	235,137,695.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,109,330.73	51,152.73
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	18,017,286.12	24,413,113.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	99,076,045.53	-543,675,382.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,318.26	9,852.98
减：二、费用		54,774,797.64	47,264,124.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,552,136.57	33,817,903.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,258,689.40	5,636,317.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	24,797,330.00	7,671,023.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	166,641.67	138,879.92

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-65,114,422.13	-323,731,445.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-65,114,422.13	-323,731,445.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	4,575,288,483.10	-1,115,046,508.97	3,460,241,974.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-65,114,422.13	-65,114,422.13
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）	-102,860,733.89	24,700,003.41	-78,160,730.48
其中：1.基金申购款	4,163,262.46	-996,509.41	3,166,753.05
2.基金赎回款	-107,023,996.35	25,696,512.82	-81,327,483.53
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）	4,472,427,749.21	-1,155,460,927.69	3,316,966,821.52
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	5,053,264,940.60	-165,224,287.97	4,888,040,652.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-323,731,445.85	-323,731,445.85
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）	-336,337,753.12	16,359,958.73	-319,977,794.39
其中：1.基金申购款	10,757,207.81	-874,735.96	9,882,471.85
2.基金赎回款	-347,094,960.93	17,234,694.69	-329,860,266.24
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)	4,716,927,187.48	-472,595,775.09	4,244,331,412.39

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>雷学军</u>	<u>吴晓明</u>	<u>吴晓明</u>
基金管理公司负责人	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

益民创新优势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）为经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]157号《关于同意益民创新优势混合型证券投资基金募集的批复》及基金部函[2007]155号《关于益民创新优势混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》核准后进行募集，由益民基金管理有限公司负责基金发起并担任基金管理人，中国农业银行股份有限公司担任基金托管人。

本基金自2007年6月18日至2007年7月8日止向境内个人投资者和机构投资者及合格境外机构投资者公开募集，募集期结束后经信永中和会计师事务所有限责任公司以XYZH/2006A10059-1号验资报告验证，并报中国证监会备案，中国证监会于2007年7月11日以基金部函[2007]184号《关于益民创新优势混合型证券投资基金备案确认的函》书面确认。经验资及备案后，本基金合同于2007年7月11日生效。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金设立时募集的实收基金本金为人民币7,231,963,653.33元，募集期间产生的利息6,159,321.48元，实收基金本息共计7,238,122,974.81元，上述募集的实收基金根据每份基金份额的面值人民币1.00元折合为7,238,122,974.81份基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券监督管理委员会[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〉》的公告和中国证券业协会2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定，并基于中国证监会允许的以下所述重要会计政策、会计估计进行编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合《企业会计准则》的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金享有的税收优惠及主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4、基金买卖股票出让方按照 0.10% 缴纳，受让方不缴纳印花税。

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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	115,635,315.91
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计	115,635,315.91
----	----------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,864,696,827.48	2,771,374,677.54	-93,322,149.94
债券	交易所市场	27,966,365.46	31,001,828.00
	银行间市场	250,498,383.77	252,286,000.00
	合计	278,464,749.23	283,287,828.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,143,161,576.71	3,054,662,505.54	-88,499,071.17

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/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

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	173,151,299.73	-
合计	173,151,299.73	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	46,922.72
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	11,379.80
应收债券利息	4,994,957.03
应收买入返售证券利息	171,677.72
应收申购款利息	-
其他	-
合计	5,224,937.27

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	100,547.92
合计	100,547.92

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	6,370,764.29
银行间市场应付交易费用	9,198.42
合计	6,379,962.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	3,500,000.00
应付赎回费	4.74
预提费用	39,781.56
合计	3,539,786.30

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	4,575,288,483.10	4,575,288,483.10
本期申购	4,163,262.46	4,163,262.46
本期赎回(以“-”号填列)	-107,023,996.35	-107,023,996.35
本期末	4,472,427,749.21	4,472,427,749.21

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	-913,228,981.83	-201,817,527.14	-1,115,046,508.97
本期利润	-164,190,467.66	99,076,045.53	-65,114,422.13
本期基金份额交易产生的变动数	24,085,726.26	614,277.15	24,700,003.41
其中：基金申购款	-947,396.04	-49,113.37	-996,509.41
基金赎回款	25,033,122.30	663,390.52	25,696,512.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,053,333,723.23	-102,127,204.46	-1,155,460,927.69

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	1,096,225.49
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	144,147.43
其他	0.75
合计	1,240,373.67

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 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	8,048,572,925.63
减：卖出股票成本总额	8,188,747,615.56
买卖股票差价收入	-140,174,689.93

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	305,231,876.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	297,695,160.55
减：应收利息总额	4,427,384.94
债券投资收益	3,109,330.73

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,017,286.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,017,286.12

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	99,076,045.53
——股票投资	97,716,146.36
——债券投资	1,359,899.17
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	99,076,045.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,497.85
转换费收入	0.63
印花手续费返还	21,819.78
合计	23,318.26

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	24,793,671.25
银行间市场交易费用	3,658.75
合计	24,797,330.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	39,781.56
信息披露费	99,452.08
银行费用	16,508.03
债券账户维护费	10,500.00
其他	400.00
合计	166,641.67

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

本基金本报告期不存在应披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期不存在应披露的重大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

本报告期内无控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

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
益民基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中山证券有限责任公司	基金管理人的股东、本基金的代销机构、本基金交易单元出租人
西南证券股份有限公司	基金管理人控股股东持股的公司、与本管理人的董事长为同一人、本基金的代销机构、本基金交易单元出租人

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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
西南证券股份有限公司	531,192,684.22	3.26%	350,109,846.25	7.26%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
西南证券股份有限公司	83,169,149.20	54.91%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
西南证券股份有限公司	869,200,000.00	12.11%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西南证券股份有限公司	451,512.55	3.30%	195,975.47	3.08%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西南证券股份有限公司	297,593.31	7.37%	97,054.42	5.11%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买/卖经手费、证券结算风险基金和证券交易所买/卖证管费等)。

关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准，与其签订的交易单元租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2012年1月1日至2012年 6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,552,136.57	33,817,903.75
其中：支付销售机构的客户维护费	4,612,194.34	2,945,324.83

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年 6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 6月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	4,258,689.40	5,636,317.30
----------------	--------------	--------------

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

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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均未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
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2007 年 7 月 11 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,426,308.25	8,426,308.25
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	8,426,308.25	8,426,308.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.19%	0.18%

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

截至本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

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	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 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
中国农业银行股份有限公司	115,635,315.91	1,096,225.49	441,724,958.62	1,567,430.88

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

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
600499	科达机电	2012 年 6 月 20 日	未刊登重要事项	10.28	2012 年 7 月 2 日	10.11	199,999	2,064,588.70	2,055,989.72	-

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余额。

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余额。

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投资风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并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监控上述各类风险。

投研部根据投资决策委员会有关资产流动性的原则性规定，制定具体的评估指标、评估方法，每月对基金投资组合的流动性进行评估，撰写评估报告，对基金组合的流动性指标提出维持及修正建议，分送基金经理、投资总监和投资决策委员会，然后各部门和相关人员做出反馈，以利于进一步完善流

动性风险管理。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
A-1	72,557,000.00	55,111,900.00
A-1 以下	-	-
未评级	140,621,000.00	169,147,000.00
合计	213,178,000.00	224,258,900.00

注：未评级债券投资为本基金投资于国家债券、央行票据及国家政策性金融债券等的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
AAA	36,419,828.00	120,480,925.20
AAA 以下	28,453,000.00	27,064,700.00
未评级	5,237,000.00	122,479,418.00
合计	70,109,828.00	270,025,043.20

注：未评级债券投资为本基金投资于国家债券、央行票据及国家政策性金融债券等的债券投资。

本基金的银行存款存放于本基金的托管行-中国农业银行。本基金认为与中国农业银行相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金

的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除披露的流通受限不能自由转入的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

本基金管理人通过对投资品种的流动性指标监控来评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。本基金管理人通过基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产及负债主要是银行存款、债券投资与买入返售金融资产和卖出回购金融资产款。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产的比重较小，因此本基金并不存在重大的利率风险。本基金管理人通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	115,635,315.91	-	-	-	-	-	115,635,315.91
结算备付金	25,288,538.97	-	-	-	-	-	25,288,538.97
存出保证金	-	-	-	-	-	5,238,175.81	5,238,175.81
交易性金融资产	-	-	213,178,000.00	43,644,828.00	26,465,000.00	2,771,374,677.54	3,054,662,505.54
买入返售金融资产	173,151,299.73	-	-	-	-	-	173,151,299.73
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,563,028.44	19,563,028.44
应收利息	-	-	-	-	-	5,224,937.27	5,224,937.27
应收股利	-	-	-	-	-	795,654.72	795,654.72
应收申购款	-	-	-	-	-	9,288.31	9,288.31
其他资产	-	-	-	-	-	100,547.92	100,547.92
资产总计	314,075,154.61	-	213,178,000.00	43,644,828.00	26,465,000.00	2,802,306,310.01	3,399,669,292.62
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	66,137,174.39	66,137,174.39

应付赎回款	-	-	-	-	-	476,105.66	476,105.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,163,784.39	4,163,784.39
应付托管费	-	-	-	-	-	693,964.05	693,964.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,379,962.71	6,379,962.71
应交税费	-	-	-	-	-	1,311,693.60	1,311,693.60
其他负债	-	-	-	-	-	3,539,786.30	3,539,786.30
负债总计	-	-	-	-	-	82,702,471.10	82,702,471.10
利率敏感度缺口	314,075,154.61	-213,178,000.00	43,644,828.00	26,465,000.00	2,719,603,838.91	3,316,966,821.52	
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	95,470,030.93	-	-	-	-	-	95,470,030.93
结算备付金	18,460,491.81	-	-	-	-	-	18,460,491.81
存出保证金	-	-	-	-	-	2,750,000.00	2,750,000.00
交易性金融资产	-7,030,100.00	217,228,800.00	127,483,225.20	142,541,818.00	2,594,408,443.93	3,088,692,387.13	
买入返售金融资产	274,141,171.21	-	-	-	-	-	274,141,171.21
应收利息	-	-	-	-	-	4,822,095.61	4,822,095.61
应收申购款	-	-	-	-	-	13,793.11	13,793.11
资产总计	388,071,693.95	7,030,100.00	217,228,800.00	127,483,225.20	142,541,818.00	2,601,994,332.65	3,484,349,969.80
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,997,366.81	10,997,366.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	530,071.17	530,071.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,537,883.93	4,537,883.93
应付托管费	-	-	-	-	-	756,313.98	756,313.98
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,314,220.00	3,314,220.00
应交税费	-	-	-	-	-	1,162,137.60	1,162,137.60
其他负债	-	-	-	-	-	2,810,002.18	2,810,002.18
负债总计	-	-	-	-	-	24,107,995.67	24,107,995.67
利率敏感度缺口	388,071,693.95	7,030,100.00	217,228,800.00	127,483,225.20	142,541,818.00	2,577,886,336.98	3,460,241,974.13

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

假设	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：人民币元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-988,032.78	-4,033,660.61
	市场利率下降 25 个基点	999,089.69	4,103,649.16

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金其他价格风险主要是市场价格风险，是指金融工具的公允价值受市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资相关，也有可能与投资组合整体相关。对本基金而言，其他价格风险源自于以交易性金融资产的公允价值受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。本基金通过优化投资组合、设置相关监控参数、跟踪与业绩基准的差异，及时调整资产配置比例、行业配置比例等方法来降低其他价格风险。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011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	2,771,374,677.54	83.55	2,594,408,443.93	74.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	283,287,828.00	8.54	494,283,943.20	14.28
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,054,662,505.54	92.09	3,088,692,387.13	89.26

6.4.4.1.1.1 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的业绩比较基准中股票指数变动 5%。		
	根据期末时点股票资产相对于基准中股票指数的 Beta 系数计算的资产变动幅度。		
	Beta 系数是以市场过去 100 天的数据回归计算出来的，对于新股或者股票交易少于 100 天的股票，默认其波动与市场同步。		
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(2012年6月30日)	上年度末(2011年12月31日)
	比较基准的股票基准上升 5%	150,984,492.43	97,900,002.63
	比较基准的股票基准下降 5%	-150,984,492.43	-97,900,002.63

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,771,374,677.54	81.52
	其中：股票	2,771,374,677.54	81.52
2	固定收益投资	283,287,828.00	8.33
	其中：债券	283,287,828.00	8.33
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	173,151,299.73	5.09
	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	140,923,854.88	4.15
6	其他各项资产	30,931,632.47	0.91
7	合计	3,399,669,292.62	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	-	-
B	采掘业	111,703,444.97	3.37
C	制造业	996,546,641.99	30.04
C0	食品、饮料	157,217,177.12	4.74
C1	纺织、服装、皮毛	85,492,376.44	2.58
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	92,255,197.56	2.78
C5	电子	91,319,758.62	2.75
C6	金属、非金属	101,058,970.90	3.05
C7	机械、设备、仪表	346,551,815.01	10.45
C8	医药、生物制品	122,651,346.34	3.70
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	91,640,040.60	2.76
E	建筑业	45,468,832.41	1.37
F	交通运输、仓储业	235,867,854.65	7.11
G	信息技术业	183,301,344.73	5.53
H	批发和零售贸易	157,918,087.58	4.76
I	金融、保险业	362,861,339.99	10.94
J	房地产业	475,474,117.62	14.33
K	社会服务业	76,649,988.25	2.31
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	33,942,984.75	1.02
	合计	2,771,374,677.54	83.55

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	002065	东华软件	5,137,100	114,043,620.00	3.44
2	600048	保利地产	10,011,178	113,526,758.52	3.42
3	600383	金地集团	16,141,305	104,595,656.40	3.15
4	000024	招商地产	4,261,215	104,527,603.95	3.15
5	600030	中信证券	8,187,712	103,410,802.56	3.12
6	600549	厦门钨业	2,256,480	99,082,036.80	2.99
7	601688	华泰证券	8,980,778	94,298,169.00	2.84
8	000402	金融街	14,151,094	92,406,643.82	2.79
9	000728	国元证券	8,302,775	90,583,275.25	2.73
10	600815	厦工股份	7,372,807	68,198,464.75	2.06
11	002024	苏宁电器	7,999,932	67,119,429.48	2.02
12	601111	中国国航	10,745,461	66,084,585.15	1.99
13	600056	中国医药	2,999,888	65,847,541.60	1.99
14	000858	五粮液	2,000,000	65,520,000.00	1.98
15	600029	南方航空	14,099,862	65,000,363.82	1.96
16	600115	东方航空	15,290,924	63,916,062.32	1.93
17	002293	罗莱家纺	855,398	63,812,690.80	1.92
18	600011	华能国际	8,999,948	58,049,664.60	1.75
19	000338	潍柴动力	1,909,868	56,703,980.92	1.71
20	600104	上汽集团	3,800,000	54,302,000.00	1.64
21	600810	神马股份	6,099,975	50,812,791.75	1.53
22	002655	共达电声	2,718,957	50,246,325.36	1.51
23	600572	康恩贝	4,669,534	49,637,146.42	1.50
24	600779	水井坊	1,993,456	48,381,177.12	1.46
25	600999	招商证券	4,006,260	46,512,678.60	1.40
26	002375	亚厦股份	1,841,589	45,468,832.41	1.37
27	000895	双汇发展	700,000	43,316,000.00	1.31
28	600763	通策医疗	1,882,035	41,254,207.20	1.24
29	600787	中储股份	4,602,122	40,866,843.36	1.23
30	000157	中联重科	3,999,914	40,119,137.42	1.21
31	600397	安源股份	2,878,089	38,623,954.38	1.16
32	002073	软控股份	4,516,029	37,844,323.02	1.14
33	600895	张江高科	3,960,675	33,942,984.75	1.02
34	600795	国电电力	12,440,880	33,590,376.00	1.01
35	600547	山东黄金	1,000,198	32,846,502.32	0.99
36	300026	红日药业	1,351,225	32,456,424.50	0.98
37	600587	新华医疗	1,280,583	31,988,963.34	0.96
38	600759	正和股份	5,699,776	31,576,759.04	0.95
39	000686	东北证券	1,636,897	28,056,414.58	0.85

40	600406	国电南瑞	1,338,487	25,016,322.03	0.75
41	601010	文峰股份	1,677,950	24,951,116.50	0.75
42	000919	金陵药业	2,921,351	24,597,775.42	0.74
43	600375	华菱星马	2,279,322	22,496,908.14	0.68
44	600439	瑞贝卡	3,999,942	21,679,685.64	0.65
45	600546	山煤国际	1,020,017	21,338,755.64	0.64
46	000100	TCL 集团	10,000,000	20,300,000.00	0.61
47	002583	海能达	1,149,900	20,215,242.00	0.61
48	002011	盾安环境	1,895,478	20,186,840.70	0.61
49	000598	兴蓉投资	2,450,199	19,969,121.85	0.60
50	601808	中海油服	1,017,835	16,804,455.85	0.51
51	002408	齐翔腾达	1,014,757	16,499,948.82	0.50
52	002099	海翔药业	1,500,000	15,960,000.00	0.48
53	300183	东软载波	597,800	15,698,228.00	0.47
54	600657	信达地产	3,495,741	15,486,132.63	0.47
55	002470	金正大	1,105,661	14,638,951.64	0.44
56	002106	莱宝高科	602,998	12,102,169.86	0.36
57	300068	南都电源	800,000	10,512,000.00	0.32
58	000031	中粮地产	1,999,949	9,079,768.46	0.27
59	300177	中海达	659,900	7,173,113.00	0.22
60	002116	中国海诚	600,680	7,088,024.00	0.21
61	300072	三聚环保	585,701	6,062,005.35	0.18
62	300128	锦富新材	351,799	5,839,863.40	0.18
63	300125	易世达	350,000	5,376,000.00	0.16
64	601588	北辰实业	1,499,928	4,274,794.80	0.13
65	000698	沈阳化工	850,000	4,241,500.00	0.13
66	002051	中工国际	111,545	2,962,635.20	0.09
67	002484	江海股份	260,000	2,831,400.00	0.09
68	000528	柳 工	172,700	2,143,207.00	0.06
69	601898	中煤能源	269,997	2,089,776.78	0.06
70	600499	科达机电	199,999	2,055,989.72	0.06
71	600581	八一钢铁	299,990	1,976,934.10	0.06
72	002376	新北洋	42,710	825,157.20	0.02
73	002649	博彦科技	22,350	329,662.50	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	600030	中信证券	291,602,924.70	8.43
2	600383	金地集团	282,988,025.92	8.18
3	000002	万科A	199,598,773.23	5.77
4	600048	保利地产	173,464,231.88	5.01
5	000402	金融街	150,967,381.50	4.36
6	600104	上汽集团	145,504,572.90	4.21
7	600549	厦门钨业	136,354,614.38	3.94
8	600362	江西铜业	121,567,726.25	3.51
9	600260	凯乐科技	120,338,215.62	3.48
10	601318	中国平安	119,402,036.81	3.45
11	600036	招商银行	119,068,750.66	3.44
12	601688	华泰证券	112,752,961.39	3.26
13	000630	铜陵有色	112,013,009.63	3.24
14	000728	国元证券	111,864,569.80	3.23
15	000157	中联重科	110,466,777.41	3.19
16	600406	国电南瑞	106,955,313.53	3.09
17	600015	华夏银行	101,413,376.24	2.93
18	000858	五粮液	98,977,328.58	2.86
19	000024	招商地产	97,808,548.59	2.83
20	000100	TCL 集团	82,100,081.65	2.37
21	600690	青岛海尔	81,533,730.50	2.36
22	600016	民生银行	81,175,500.00	2.35
23	600887	伊利股份	77,832,921.05	2.25
24	601717	郑煤机	72,601,106.91	2.10
25	600703	三安光电	71,759,281.39	2.07
26	002024	苏宁电器	71,086,876.77	2.05
27	600815	厦工股份	70,900,139.68	2.05

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	229,876,480.97	6.64
2	000002	万科A	215,726,549.29	6.23
3	600015	华夏银行	215,254,467.03	6.22

4	600030	中信证券	203,783,782.23	5.89
5	600887	伊利股份	202,860,247.72	5.86
6	600016	民生银行	197,156,032.65	5.70
7	600383	金地集团	183,766,632.64	5.31
8	600519	贵州茅台	174,856,138.90	5.05
9	000858	五粮液	158,734,318.14	4.59
10	600406	国电南瑞	152,734,675.22	4.41
11	000538	云南白药	147,403,632.34	4.26
12	000423	东阿阿胶	142,563,133.07	4.12
13	600260	凯乐科技	132,831,523.95	3.84
14	601318	中国平安	122,189,372.77	3.53
15	600362	江西铜业	120,947,525.51	3.50
16	601009	南京银行	114,368,696.68	3.31
17	000630	铜陵有色	111,744,022.86	3.23
18	600123	兰花科创	96,422,562.80	2.79
19	601898	中煤能源	96,168,943.04	2.78
20	000895	双汇发展	86,265,655.45	2.49
21	600104	上汽集团	83,727,183.22	2.42
22	600690	青岛海尔	82,209,343.39	2.38
23	600048	保利地产	76,037,310.75	2.20
24	601717	郑煤机	75,508,760.69	2.18
25	600837	海通证券	75,493,728.00	2.18
26	601633	长城汽车	74,007,113.74	2.14
27	600366	宁波韵升	71,882,232.14	2.08

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,267,997,702.81
卖出股票收入（成交）总额	8,048,572,925.63

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	5,237,000.00	0.16
2	央行票据	140,621,000.00	4.24
3	金融债券	4,060,000.00	0.12

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	60,812,828.00	1.83
5	企业短期融资券	72,557,000.00	2.19
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	283,287,828.00	8.54

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	1101096	11 央行票据 96	1,450,000	140,621,000.00	4.24
2	068019	06 京投债	300,000	29,811,000.00	0.90
3	041259018	12 南高轮 CP001	170,000	17,283,900.00	0.52
4	112044	11 中泰 01	160,000	17,168,000.00	0.52
5	041254010	12 阳泉 CP001	170,000	17,132,600.00	0.52

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 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.9.3 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	5,238,175.81
2	应收证券清算款	19,563,028.44
3	应收股利	795,654.72
4	应收利息	5,224,937.27

5	应收申购款	9,288.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	100,547.92
8	其他	-
9	合计	30,931,632.47

7.9.4 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。

7.9.5 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。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
195,062	22,928.24	87,223,162.00	1.95%	4,385,204,587.21	98.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	449,171.97	0.01%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年7月11日）基金份额总额	7,238,122,974.81
---------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	4, 575, 288, 483. 10
本报告期基金总申购份额	4, 163, 262. 46
减:本报告期基金总赎回份额	107, 023, 996. 35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4, 472, 427, 749. 21

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人及基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金进行审计的会计师事务所改聘立信会计师事务所有限公司。

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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	1, 513, 335, 401. 26	9. 28%	1, 240, 679. 84	9. 06%	-

东兴证券	1	1,383,687,078.92	8.48%	1,178,354.84	8.60%	-
光大证券	1	1,025,954,671.91	6.29%	833,594.10	6.08%	-
国金证券	1	964,935,606.96	5.92%	820,193.04	5.99%	-
申银万国	1	932,879,589.65	5.72%	799,403.23	5.83%	-
浙商证券	1	917,428,931.25	5.62%	788,310.34	5.75%	-
东方证券	1	863,517,276.42	5.29%	706,751.57	5.16%	-
招商证券	1	842,525,282.90	5.17%	716,144.78	5.23%	-
民生证券	2	798,320,605.57	4.89%	678,650.97	4.95%	-
银河证券	1	763,675,320.78	4.68%	652,519.23	4.76%	-
齐鲁证券	1	707,411,077.15	4.34%	606,147.19	4.42%	-
海通证券	1	652,144,243.71	4.00%	529,869.42	3.87%	-
中信建投	2	607,252,655.15	3.72%	515,879.26	3.77%	-
西南证券	1	531,192,684.22	3.26%	451,512.55	3.30%	-
金元证券	1	491,129,494.10	3.01%	424,129.42	3.10%	-
中信证券	1	456,300,744.19	2.80%	387,854.92	2.83%	-
华创证券	1	395,280,842.07	2.42%	321,169.80	2.34%	-
兴业证券	1	335,010,180.86	2.05%	272,197.83	1.99%	-
广发证券	1	298,902,644.17	1.83%	242,860.87	1.77%	-
国元证券	1	259,136,352.62	1.59%	220,263.83	1.61%	-
高华证券	1	254,447,024.55	1.56%	216,280.03	1.58%	-
中银国际	1	248,897,836.49	1.53%	211,563.42	1.54%	-
国联证券	1	246,932,201.43	1.51%	202,207.03	1.48%	-
中投证券	1	238,941,145.10	1.47%	196,208.50	1.43%	-
安信证券	1	197,414,514.64	1.21%	167,802.21	1.22%	-
中金公司	2	152,347,925.46	0.93%	127,722.31	0.93%	-
国信证券	1	129,634,934.50	0.79%	110,188.45	0.80%	-
国泰君安	1	101,327,173.51	0.62%	82,329.05	0.60%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

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
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	100,000,000.00	1.39%	-	-

光大证券	-	-	-	-	-
国金证券	32,060,740.80	21.17%	300,000,000.00	4.18%	-
申银万国	-	-	1,100,000,000.00	15.33%	-
浙商证券	-	-	450,000,000.00	6.27%	-
东方证券	-	-	-	-	-
招商证券	27,530,019.90	18.18%	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	2,400,000,000.00	33.44%	-
齐鲁证券	-	-	508,000,000.00	7.08%	-
海通证券	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-
西南证券	83,169,149.20	54.91%	869,200,000.00	12.11%	-
金元证券	-	-	400,000,000.00	5.57%	-
中信证券	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	650,000,000.00	9.06%	-
中银国际	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
安信证券	8,701,882.72	5.75%	400,000,000.00	5.57%	-
中金公司	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

(1) 基本情况：资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机构的处罚；主要股东实力强大；具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(2) 公司治理：内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能根据基金投资

的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强的风险意识和风险测算能力；

(4) 服务能力：具备较强的服务意识，能主动为基金提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会；

(5) 综合业务能力：在投资银行业务上有较强的实力，能协助本公司基金参与股票、债券的发行；在新产品开发方面经验丰富，能帮助本公司拓展基金管理业务（如 QDII、集合理财产品等）；在证券创新品种开发方面处于行业前列（如交易所固定收益平台、融资融券、金融期货等）；

(6) 其他因素。

2、本公司租用券商交易单元的程序：

(1) 投资总监组织研究部、金融工程部、投资部经集体讨论后遵照上述标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够的席位以保障交易安全。必要时可要求券商提供相应证明文件；

(2) 投资总监向投资决策委员会上报拟选券商名单、相应的席位租用安排以及相关评选材料；

(3) 投资决策委员会审查拟选券商名单及相应的席位租用安排，审查通过后由总经理上报董事会，董事会如有相应授权的，由公司管理层依据授权内容办理；

(4) 券商名单及相应的席位租用安排确定后由交易部会同所选券商共同拟定席位租用协议，并交监察稽核部审核通过；

(5) 审核完成后交易部负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增金元证券及齐鲁证券上海证券交易所证券交易单元两个；新增中信建投、民生证券及兴业证券深圳交易所证券交易单元三个。

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	益民创新优势混合型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 1 月 20 日
2	益民基金管理有限公司关于网上直销开通定期不定额申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 2 月 1 日
3	益民基金管理有限公司关于旗下基金在农业银行、银河证券等代销机构开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 2 月 24 日
4	益民创新优势混合型证券投资基金更新招募说明书	《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 2 月 24 日
5	益民创新优势混合型证券投资基金更新招募说明书（摘要）	《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 2 月 24 日

6	关于增聘益民创新优势混合型证券投资基金基金经理的公告	《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 3 月 23 日
7	益民创新优势混合型证券投资基金 2011 年年度报告摘要	《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 3 月 27 日
8	益民创新优势混合型证券投资基金 2011 年年度报告	公司网站	2012 年 3 月 27 日
9	益民基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 4 月 5 日
10	益民创新优势混合型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 4 月 24 日
11	益民基金管理有限公司调整网上交易转换优惠费率的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 4 月 26 日
12	益民基金管理有限公司关于旗下基金在国信证券、华泰证券等代销渠道开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 5 月 17 日
13	益民基金管理有限公司关于开通汇付天下“天天盈”网上直销交易的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 5 月 22 日
14	关于益民基金管理有限公司新增浙商证券、国都证券等代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 7 月 3 日
15	益民基金管理有限公司关于基金代销机构信息更新的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 7 月 11 日
16	关于益民基金管理有限公司新增国盛证券有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2012 年 7 月 11 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立益民创新优势混合型证券投资基金的文件；
- 2、益民创新优势混合型证券投资基金基金合同；
- 3、益民创新优势混合型证券投资基金托管协议；
- 4、中国证监会批准设立益民基金管理有限公司的文件；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的公告。

11.2 存放地点

北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A。

11.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人益民基金管理有限公司。

咨询电话：(86) 010-63105559 4006508808

公司传真：(86) 010-63100608

公司网址：<http://www.ymfund.com>

益民基金管理有限公司
2012年8月25日