## 泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金

### 2009 第四季度报告

2009-12-31

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
据生送出口期,2010 01 20

据省送出日期:2010-01-20

\$1 重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所就资料不存在歷景记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、 福确性和完整性承担个别及非带货任。司根据本基金合同规定,于 2010 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值 表现和投资组合报告的容易,就且复核内容不存在虚影点载、误导性陈述或者重大遗漏。 是金管理人未混为。操注复核内容不存在虚影点载、误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人未混为。操注着用、影影光明的原管理和运用基金价。但不保证基金一定盈利。 基金管理人未混为。操注者用、影发音和发生发表,是一个

本报告期间为 2009 年 10 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日。 本报告期第次 本报告财务资料未经审计

PIKEIMINI METINGETHIN O	§2 基金产品概况
基金简称	泰达荷银成长股票
交易代码	162201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003-04-25
报告期末基金份额总额	832,566,925.21 份
投资目标	泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金主要投资于成长行业类别中内 在价值被相对低估,并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公 司。在有效控制投资组合风险的前提下,为基金份额持有人提供长期稳定的投 资回报。
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资方法,具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。
业绩比较基准	65%×新华富时 A600 成长行业指数+35%×上证国债指数。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。
基金管理人	泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 1.本期已实现收益 94,420,012.40 4.期末基金资产净值 986,741,330.53 1-3 (2)-(4)

过去三个月 17,08% 1.23% 1.501% 1.005% 4.007% 1.005% 1.005% 1.45% 1.005% 1.45

#### 注:本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。 84 管理人报告

4.	<ul><li>基金经理 (成基金</li></ul>	金经理小组	)简介			
Γ	姓名	取务	任本基金的基	<b>5</b> 金经理期限	证券从业年限	10.00
	SE 43	かくラケ	任职日期	离任日期	TIE 35 3A SE 41-PR	156193
	王勇	本基金基金经理	2008-08-05	-	9	中国籍,则士学位 1999 年8 月至 2001 年 1月期间建聚于中国投资咨询 公司、抵投资则问。2001 年 11 月至 2004 年 2 月期间数 責任公司、任研究创。2004 年 2 月至 2004 年 1 月 規聚 有限责任公司、任研究创。 2004 年 1 月 月加盟奉达荷福 任任研究创、基金经理助理。研 安正管等成员、基金经理助理。研 安正管等成员、基金经理助理。研 实工管等成员、

增加 2948 亿元。 市场在经历过三季度的大幅调整之后,走出了震荡上扬的行情,沪深 300 指数从 3004 点最高上涨到 3698 点,涨幅

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	751,050,484.36	74.51
	其中:股票	751,050,484.36	74.5
2	固定收益投资	202,670,195.80	20.13
	其中:债券	202,670,195.80	20.13
	资产支持证券	-	
3	金融衍生品投资	-	
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
5	组行存款和结算条付金会计	34.469.858 14	3.43

代码		行业类别		公	允价值(元)	占基金	金资产净值比例(%)		
A	农、林、牧、渔业				-		-		
В	采掘业				-		-		
C	制造业				77,875,536.57		58.50		
C0	食品、饮料				13,952,562.00		1.41		
C1	纺织、服装、皮	E			-		-		
C2	木材、家具				-		-		
C3	造纸、印刷				-		-		
C4	石油、化学、塑制	交、塑料			24,224,821.02		2.46		
C5	电子				91,184,115.95		9.2		
C6	金属、非金属			1	40,356,571.09		14.23		
C8 C99 D E	机械、设备、仪	表		1	42,564,778.79		14.45		
	医药、生物制品 其他制造业 电力、煤气及水的生产和供应业 建筑业				65,592,687.72		16.78		
					其他制造业		-		
					-				
					-				
	交通运输、仓储	业			7,291,240.00		0.74		
	信息技术业				06,242,256.06		10.7		
Н	批发和零售贸易	5			-				
I	金融、保险业				20,495,231.40		2.08		
J	房地产业				-		-		
K	社会服务业				-		-		
L	L 传播与文化产业			播与文化产业 37,318,380.33		3.78			
M	综合类				1,827,840.00		0.19		
		合计			51,050,484.36		76.11		
报告	期末按公允价值	占基金资产净值比	例大小排序	的前十	名股票投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股	:)	公允价值(5	Ē)	占基金资产净值比例(%)		

以古期	木按公元訂旧	[白基金) 分产净值以	3列大小排序的用于	"名胶宗佼贸明细	
- 49	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002038	双鹭药业	1,423,447	63,201,046.80	6.41
2	000527	美的电器	1,949,930	45,238,376.00	4.58
3	002106	莱宝高科	1,849,386	45,125,018.40	4.57
4	600216	浙江医药	1,202,953	42,789,038.21	4.34
5	000825	太钢不锈	3,949,959	37,682,608.86	3.82
6	000651	格力电器	1,297,244	37,542,241.36	3.80
7	600037	歌华有线	2,629,907	37,318,380.33	3.78
8	002223	鱼跃医疗	1,080,574	36,988,048.02	3.75
9	000898	鞍钢股份	2,158,887	34,542,192.00	3.50
10	000063	中兴通讯	749,252	33,618,937.24	3.41
告期	末按债券品种	分类的债券投资组	合		
					上世本次本為故臣加

1		30	国家债券		32,215,823.4	3.26
2		央	央行票据		81,349,000.0	00 8.24
3		金	金融债券		88,476,000.0	00 8.97
		其中:政策性金融债			88,476,000.0	00 8.97
4		企	业债券			
5		企业短期融资券				
6		可转债			629,372.4	0.06
7		其他				
8			合计		202,670,195.8	30 20.54
.5 报告期末	报告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					
序号	f	责券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1		080311	08进出 11	500,000	48,530,000.00	4.92
2		0801047	08央票 47	200,000	20,582,000.00	2.09
3		0801035	08央票 35	200,000	20,560,000.00	2.08

8 投資組合報告附注 8.1 中期未基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一 年內受到公开通费,处罚的情形。 雅安之计信息,费特化关闭,是有一个人,由兴通讯在的接收查在少量到 16 万元的行政罚款并被要求 并做企业信息。影散检查能信和处理决定的公告力,中兴通讯在的接收查在少量到 16 万元的行政罚款并被要求 补偿企业所得税 380 万元。按照公司的使需率管理办法规定设置,在金融工程部和研资部详申研究基础 上 经过公司内部非报途程,中进讯被加入不公司的优选股票,罪,并进行定即更新和目常撤步。本公司对 中兴通讯的投资决策程序符合法律法规及公司制度的规定。中兴通讯受到处罚的公省发布后,基金经理专 可数任间据对该公司地行"强制"。经公司投资债金讨论、从为中发通在公司处理中的确存在不是当之处。 但这对该公司的业绩影响由常小、而此次基露出的问题将有助于该公司政赛特务规量、长期看这对投资者 6 和 基金格型的参考者中兴通和股份资价值、法定继续转载。

3,075,805.65 应收股利 1,062,334.37 待摊费用 18,857,584.47

9 1511 58.4 报告前课未持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期未基金未持有处于转股期的可转换债券。 58.5 报告期末前十名股票中华存充通受限情况的说明 报告期末前十名股票中本存在流通受限情况。

§6 开放式基金份和	<b>顶变动</b> 单位	
报告期期初基金份额总额	994,911,254.30	
报告期期间基金总申购份额	93,233,836.28	
报告期期间基金总赎回份额	255,578,165.37	
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	832,566,925.21	

§8 备查文件目录 8.1 备查文件目录 (一 中国证监会批准泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券 应设立的文件; )攀达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合

(三) 泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金招募说 》; 《四)《泰汰帝锡价值优化型成长举行业证券投资基金、周期举行业证券投资基金、稳定举行业证券投资基金托管协

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式 投资人可通过指定信息披露报纸(仲国证券报》、征券时报》、《仁海证券报》,就登陆基金管理人互联网网址 http:// www.auteda.com /宣阅。

### 泰达荷银价值优化型稳定类行业证券投资基金

#### 2009 第四季度报告

2009-12-31

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2010-01-20

3.1 主要财务指标

报告送出日期;2010-01-20 \$1 重要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载;误导性除法或重大遗漏;并对其内容的真实性. 他 他往和完整性发出分别及连带责任。司根据本基金合同规定;于2010年1月18日复核了本报告中的财务指标,净值表现积没领出分化资纳等。就以逐机等不存在整配过载;误导性除法或者重大遗漏。 基金管理人外混划;被实信用,勤勉尽责的规则管理和运用基金管产。但不保证基金一定盈利。 基金管理人外混划;被实信用,勤勉尽责的规则管理和运用基金管产。但不保证基金一定盈利。

。 本报告财务资料未经审计。 本据告期间为 2009 年 10 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日。

双音期间为 2009 平 10 为 1 口至 2009 平 12	82 基金产品概况
基金简称	泰达荷银稳定股票
交易代码	162203
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003-4-25
报告期末基金份额总额	363,441,668.05 份
投资目标	泰达荷银价值优化型稳定类行业证券投资基金主要投资于稳定行业类别中内在价值被相对低估,并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。 在有效控制投资组合风险的前提下,为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资方法,具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。
业绩比较基准	65%×新华富时 A600 稳定行业指数+35%×上证国债指数。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。
基金管理人	泰达荷银基金管理有限公司

20,439,583.58 4.期末基金资产净值

83 主要财务指标和基金净值表现

加上平明公元的恒度对收益。 不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。 本报告期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 净值增长率 净值增长率 业绩比较基准 业绩比较基准 收益率标准差 1)-3) 2-4 8.23% 1.39% 13.00% 交基准:65%×新华富时 A600 稳定行业指数+35%× 

注:本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

81.85	BR 46	任本基金的書	6金经理期限	证券从业年	165.107
XII. 25	181(男)	任职日期	海任日期	550	185 (0.)
AF] 249	本基金基金经理	2009-06-13	-	6	中国籍、美国官籍受卖的大学等 利用学院、加州人でA、1990。 利用学院、加州人でA、1990。 下证明。在对此时,但以为了以为, 2003年6月20年6月202年6月20 2003年6月202年6月202年6月20 2003年6月202年7月202年7月20 2003年6月202年7月202年7月20 2003年7月202年7月202年7月 月2028年7月202年7月2020年7月202年7月202年7日202年7月202年7日202年7日202年7日202年7日202年7日202年7日202年7日202年7日202年7日202年7日202
焦云	本基金基金经理	2009-12-25	-	5	北京大学金融学硕士。200 年8月至2007年4月就限于 大成基金管理有限公司任60 5克员。2007年4月加入泰辽 6有餘基金管理有限公司,先有 6有餘基金管理有限公司,先有 4位6、100 4位6、100 500 500 500 500 500 500 500 500 500

在21 管理人才报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 本报告期内、本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基

m的公司投资。随着明年年初信贷的投放以及房地产投资的上升,投资品产业公子。以上,是或用于安选持行业的选股应该更为重要,我们会关注一些内生增长比较好的公司,如医药、通信设备行业。 则内基金的业绩表现 

85 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 9,683,569. 7,573,800.

0901044 09央票 44 200,000 19,650,000.00 7.80

010110 21国備00 30,000 3,068,700,00 010112 21国備02 20,000 2,051,000,00 公元价值上基金资产净值比例大小非名的前十名资产支持证券段 

8. 投资组合保管特注

5.8.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开遗散。经别的情形。董事会 2009 年 2月27日《受判有关部门相关处罚的报示性公告》,由于公司领据的任意的任意的任意的。 10.00 年间介销售期间,未及时产格现行监管部门制订的黑化钾销售邮时指导价格公司。 10.00 年间介销售期间,未及时产格现行监管部门制订的黑化钾销售邮时指导价格公司。 10.00 年间介绍的现在 2008 年间介销售期间公司。 2008 年间介绍的第一次 10.00 年间,10.00 年间,10.

9 合日 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末益金未持有处于转股期的可转换债券。 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

86 开放式基金份额变动 §7 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 备查文件目录 (一)中国证监会批准拳达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投 资基金设立的文件: (二) 藝达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合 (三) 條达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金招募说明

(四) 傣达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金托管协 8.2 存放地点 基金管理人和基金托管人的住所。 8.3 管团人和基金托管人的住所。 8.3 管团支指定信息披露报纸(中国证券报》、征券时报》、《上海证券报》,就登陆基金管理人互联网网址 http:// www.autola.com/整阅。

#### 基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司基金托管人:交通银行股份有限公司报告送出日期:2010-01-20

3.1 主要财务指标

r。 本报告財务资料未经审计。 本报告期间为 2009 年 10 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日。

基金简称	泰达荷银风险预算混合
交易代码	162205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005-04-05
报告期末基金份额总额	160,139,445.69 份
投资目标	本基金通过风险预算的投资策略,力争获取超过业绩比较基准的长期稳定回报,分享市场向上带来的收益,控制市场向的风险。
投资策略	本基金的投資管理全面引进一种全新的投資資源。一民營 第一民營辦是指金企社學指令的建設和銀幣並并 信心度的到断來分配风险,然后根据风险的分配限制來调整 果也數是是沒勞損金在稅量和關稅主风险預齡的受 來也數是沒勞損金在稅量和關稅主风险實齡的受 沒受預算的重新等体现在投資的6个不可。大量应用數量化 的事前和單區的风险型的手段是本金的實要特色 與 提出合资产配置比例的一个重要参考來自于數理化的风险预 算。
业绩比较基准	5%×新华巴克莱资本中国国债指数+15%×新华巴克莱资本中国金融企业债指数+10%×新华巴克莱资本中国企业债指数+ 20%×新华富时 A200 指数+50%×税后一年期银行定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于风险中低的证券投资基金。
基金管理人	泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

17,108,273.05 1.5392 ឱ收益、其他收入,不含公允价值变动收益, 扣除相关费用后的系 益。

用公允价值变动收益。 认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 1)-3

巴克米资本中国企业使销额处20%。游生高时,2000 指数5.50%。校后一半期银行定期资本料率。 新华富时中国。2000 指数是新华富山情致公司编制的包含上海。深圳两个比赛交易所总市位最大的200 只股票并以 流通股本加权的股票指数,具有良好的市场代表性。 新华巴克州诸战由巴克州省大战,是自己的一个大战,是由于自己的人员会。 新华巴克州诸战由巴克州省大战,是自己的人员会。 3.2.2 自然全局自发纪火光差。累计的领导使增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

# 泰达荷银风险预算混合型证券投资基金

#### 第四季度报告

I 金融、保险业

K 社会服务业L 传播与文化

§4 管理人报告 任本基金的基金经理期限 证券从业年

姓名 职务 在职日期 高任日期 高任日期 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1		说明 中国籍。MBA,CFA。在校期
計态 金差理 2006-12-23 - / /		HER SEC MINA CEA TO 40 HE
金经理, 固定收益 部总经 7	S 表 V 所 行 会	日
	金2 贸易2 住市贸然完全9 劫手老男手段男	中国第二人府管理硕士、计量企编码士。 应编码士。2002年9月3 2004年2月任职嘉实基金经 资施用任任国史建设全线等 设施,担任国史或是设货线到 及社保基金投货包207年9月 五联光大保總信基金管理207年9月 及产配置经理、货币市场基金 资产自2006年1月至2007年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年20年3年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 47年3 50章 自2006年1月至2007年3 50章 自2006年1月至2007年3 50章 自2006年1月至2007年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2006年3 50章 自2007年3 50章 自2007年3

42 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基

金份额持有人利益的行为。 4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况 本基金管理人建立了公平交易制度和流程,并严格执行制度的规定。在投资管理活动中,本基金管理人公平对待不 同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息,投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执行投资管理职能和交易执 行职能的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先。价格优先的原则严格执行所有指令,未发生任何利益输送的情况。 4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 本基金与公司管理的其他投资组合不具有相似的投资风格。

4.3.3 异常交易行为的专项说明 本基金管理人建立了对异常交易的控制制度,在本报告期内未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度股票市场小幅上涨后在高位震荡。对于未来流动性紧缩的担心和对于上市公司业绩增长的预期共同作用于股 市,使得股票市场呈现窄幅波动。 本基金在四季度的操作有得有失。在本季度的前半部分,本基金保持了较高的股票仓位,而在后半部分,适当降低了

股票仓位。总体、政资产配对法金净值做出了50页域,在股票的行业企置,本基金超已了4年和周类航运、纸配了房地产和有色行业、契合了市场的表现。但是对于市场表现良好的家电、半导体等行业、本基金配置比例过低。
2010年处于流动性向下,业绩向上的过程,预计数指将呈现震荡的格局。在全球经济启稳回升的背景下,政府有必要 也有条件实施回收流动性的政策。而在另一方面,全球经济尤其是中国经济在2010年将继续维持复苏向上的趋势,A股上 市公司的业绩仍将有一定程度的增长。本基金管理人将采取精选股票的策略,选择有实质性业绩增长的公司构建组合

2009年四季度,随着经济形势趋于稳定,货币政策重点明确由宽松转向了适度。信贷增速和央票发行利率成为两个主 导市场的主要因素。十月上旬公布的信贷数据超出了市场的预期。十月的前半月,债市延续了九月中下旬的跌势,市场对于收缩力度的加强有所预期,尤其关注一年期央票的发行利率。十月中旬以后,央票的发行利率并未如市场所预期的上 反弹趋势。虽然市场资金仍然充裕,但由于物价上行的压力明显加大,形成对于利率产品的压制。由于较高的持有收益形 成对于小幅加息的防御功能,交易所信用债成为四季度债券市场的主要亮点

目前通货膨胀已经逐渐由预期变成了现实,通缩已经结束,通涨上行的趋势确定。能否在稳定经济复苏势头的同时, 的加速的感光上层的加速的表现。 控制通账上行的幅度成为 2010年 中一颗生鸡面的问题的工作,以及代方的通过, 力度(以央票发行利率的调整为主要标志)。宏观经济在同比重新回归到正常的增长均线上之后,环比的动能可能有所减 弱。信贷规模继续低于预期将是大概率事件。目前处于历史高位的 MI 和 M2 等将在未来 9 到 12 个月中逐渐回落到 17% 到 20%的正常水平。通货膨胀压力仍然存在,CPI 同比特转正,环化受到雪灾等因素影响,将有所调开。预计扩张性政策的 退出将是一个缓慢而持续的过程。通胀预期转加退预期的有上升给空间,无论是通胀压力还是顺控预期,都对债券市场形 成矩期的压力。因而短期反弹的空间相对有限。但中长朝雪 整体环境正定逐渐向直射一带势突破的方向转变。 风险预算基金的固定收益投资部分,在四季度操作中,本基金基于绝对收益的考虑,仍保持前期维持相对较短的久

期。以持有央票为主,以部分高息票的品种为辅助,减低价格波动风险,提高总收益的策略。2010年四季度预计将延续这一 策略, 但将神信贷节奏与通兆动量的变化有所调整。

6.1品特能試行及學問題が必要等的 4.5 报告期末法金的业绩表更 截止报告期末,本基金份额净值为 1.5392 元,本报告期份额净值增长率为 7.25%,同期业绩比较基准增长率为 3.74%。 §5 投资组合报告

87,609,498,2 35.24 2 固定收益投资 52,583,850.0 21.15 中:买断式回购的买入返售金融资 2,009,097. 0.81 农、林、牧、渔川 43.214.899. CO 食品、饮料 11,371,132. C1 纺织、服装、皮 4,177,800.0 C2 木材、家具 2,507,560.0 C4 石油、化学、塑胶、塑 11,123,765.30 C6 金属、非金属 14,030,541 医药、生物制品 4,100.0 自力、煤气及水的 1,545,000.0 交通运输、仓储。 5,243,400.0

1,217,370.0

70,590.0

26,245,053.

序号 股	票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元	占基金资产净值比例 (%)
1 6	501318	中国平安	230,324	12,688,54	9.16 5.15
2 6	500519	贵州茅台	51,486 8,743,352.52		2.52 3.55
3 6	500019	宝钢股份	869,955 8,403,765.30		5.30 3.41
4 (	000983	西山煤电	189,952	7,577,18	5.28 3.07
5 601939		建设银行	850,000 5,261,500.00		0.00 2.13
6 601111		中国国航	540,000 5,243,400.00		0.00 2.13
7 (	002028	思源电气	190,000	5,107,20	0.00
	501169	北京银行	227,600	4,401,78	
	002029	七匹猴	180,000	4,177,80	
	501009	南京银行	201,200	3,893,22	0.00
报告期末按债券品种分类的 序号 债券		的债券投資組合 券品种	公允价值(元)		占基金资产净值比例 (%)
1	1 国家债券		20,242,250.00		00 8.2
2 央行票据		行票据	20,614,000.00		00 8.36
3	金	融债券	9,706,000.00		00 3.94
其中		策性金融债	9,706,000.00		00 3.94
4		业债券	2,021,600.00		0.82
5 企业		<b>押融资券</b>	-		
6		「转债			
7		其他			
8		合计	52,583,850.00		00 21.33
报告期末按位	公允价值占基	金资产净值比例	引大小排名的前五	5名债券投资明细	
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801065	08央票 65	200,000	20,614,000.00	8.36
2	010004	20国债(4)	153,000	15,422,400.00	6.26
3	080311	08进出 11	100,000	9,706,000.00	3.94
4	010112	21国债(12)	47,000	4,819,850.00	1.96
5	068042	06石油债	20,000	2,021,600.00	0.82
期末基金未	持有资产支持 公允价值占基 持有权证。	寺证券。		十名资产支持证券投资 5名权证投资明细	<b></b>

3.1 中分か器並及取的前十名並分の次月工作平均定日出光板無益の月上末時点,成在13年日期前日前 及受到公开建設、使用的情景、使用的情景、 报告前内基金投资的前十名並券的发行主体未出現被監管部门立案調查的情况,在报告编制目前一年 未受到公开建筑。处罚。 603,913.63 510,887.43 2,009,097.31

§6 开放式基金份额变动 164,395,545,29 报告期期间基金总申购份额 22,891,459.5 27,147,559.1

\$7 影响投资者决策的其他重要信息 本报告期间未发生本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况;截止本报告期末,本基金管理人未持有 本基金份额。 160,139,445.69

§8 备查文件目录

注,本基金于 2005 年 4 月 5 日成立,在建仓期结束时及本报告期末本基金的投资比例已达到基金合同规定的各项投资比例。