中海分红增利混合型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

基金管理人:中海基金管理有限公司 基金托管人:中国农业银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一〇年八月二十七日

报告送出日期:二〇一〇年八月二十七日

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
识完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国农业银行股份有限公司以下商称"农业银行"和银本基金与周规定。于2010年8月21日复核了本报
中均财务指标、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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

	2 基金简介	
2.1 基金基本情况		
基金简称		中海分红增利混合
基金主代码		398011
交易代码	398011 前端收费模式)	398012 后端收费模式)
基金运作方式	·	契约型开放式
基金合同生效日		2005年 6 月 16 日
基金管理人		中海基金管理有限公司
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		3,920,915,723.94 份
基金合同存续期		不定期

基金合同存续期	不定期
基金产品说明	
投资目标	本基金为混合型基金,主要通过投资于中国证券市场中那些现金股息 率高、分红稳定的商品质上市公司和国内依法公开发行上市的各类债券,在控制风险,确保基金资产流动性的前提下,以表取高比例分红收益和资本相对增值的方式来读求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基企業用現金股利精造的投資策略,即,通过公司开发的 DM 模型和 POD 模型商法出级免疫 基本 6.分在稳定的高品质上的公司。1.股份持續的基础证以下三个阶段进行。
业绩比较基准	上证红利指数×70% + 上证国债指数×25% + 银行一年期定期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金,其风险收益特征从长期平均来

	风险收益特征		看,低于单纯的股票型基金,高于单纯	的债券型基金。
2.3	基金管理人和基金托	管人		
	项目		基金管理人	基金托管人
	名称		中海基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
		姓名	朱冰峰	李芳菲
	信息披露负责人	联系电话	021-38429808	010-66060069
		电子邮箱	zhubf@zhfund.com	lifangfei@abchina.com
	客户服务电话		021-38789788,400-888-9788	95599
	传真		021-68419525	010-63201816
2.4	信息披露方式			
	登载基金半年度报告正文的管理人互		www.zhfund.com	
	基金半年度报告备置	地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2	2905-2908 室及 30 层

3.1 主要会计数据和财务指标

1. 3c 2c F1 9A PB 1119/2 33 7B PD	金額单位:人
3.1.1 期间数据和指标	报告期 2010年1月1日至2010年6月30日)
本期已实现收益	214,297,004.03
本期利润	-567,021,614.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1423
本期基金份额净值增长率	-17.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 2010 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3230
期末基金资产净值	2,654,372,010.86
期末基金份额净值	0.6770
1.以上所述基金业绩指标不包括持有人	、认助或交易基金的各项费用(例加 开放式基金的由助 键回费等)

主要财务指标和基金净值表现

用品类除破麦基亚原相称小型结对有人认购原文必购施业的各项权利(约如,开放入海业中界,规则或等),订入应用品类除破麦基产等要低于两列数率则利息收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用后的余额,本期利润为本用定类取效益加上本期公允价值变动收益。 3.2 基金净值表现

3.2	.1 基金份额净值	直增长率及其与	同期业绩比较基	š 准收益率的比	较		
	阶段	份额净值增长 率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	2-4
	过去一个月	-9.89%	1.58%	-5.64%	1.01%	-4.25%	0.57%
	过去三个月	-14.67%	1.56%	-16.92%	1.15%	2.25%	0.41%
	过去六个月	-17.16%	1.41%	-21.32%	1.04%	4.16%	0.37%
	过去一年	-10.97%	1.68%	-9.87%	1.36%	-1.10%	0.32%
	过去三年	-16.05%	1.82%	-21.68%	1.78%	5.63%	0.04%
	自基金合同 生效起至今	141.77%	1.62%	102.60%	1.59%	39.17%	0.03%

生效起至今 141.77% 10.52% 10.52% 39.17% 39.17% 00.93% 11.59% 39.17% 00.93% 12.17% 12.26% 12.26% 15.95% 39.17% 00.93% 12.26% 1

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中海分紅增利混合型证券投资基金 份額累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2005年6月16日至2010年6月30日)

注:截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约: 4 管理人报告

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来,始终坚持"诚实信用、勤勉尽贵"的原则,严格履行基金管理人的责任和义务,依能强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系,为广大基金份额持有人提供规范、专

资产管理服务。截至	至 2010 年 6 月 3	0日,共管理开放式	弋证券投资基金	7 只。	
.1.2 基金经理(或	基金经理小组)及	及基金经理助理的符	前介		
姓名	职务	任本基金的基金经	A.理期限	证券从业	说明
姓冶	RT.93	任职日期	离任日期	年限	1909/1
路设本大任主	投资副总监。 本基源 中海混资 本能源型证券投理 基金基金经理	2009-06-02	-	9	上海定地大学硕士。9年证券从业经历。历任长江证券股份有限公司上海总部 市场部投资全租助理。无等,第第8机械厂管理都经是,中全东方资产管理局限。一定新年级投资管理。2007年3月起设产管理总部投资经理。2007年3月起进入本公司工作。任分析的兼基金经到期期。现任投资部均、基本金、中级市场等。

注 1.上述任职目別,高任日期根据本基金管理人对外被露的任免日期填写。 注 2.证券从业的含义灌从行业协会征证券业从业人员资格管理办法)的相关规定。 4.2 管理人对程序则内本基金征灌规与信债形成形现 基金管理人在报停期内严格遵守任中年人民共和国证券投资基金法)及其他有关法律法规《基金合同)的规定,勤勉尽 也为基金份额持有人谋求利益、不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法建规或未履行基金合同承诺。 4.3 管理人力继接制的公平支势情况的专项说明

4.3 管理人对报告期代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
为进一步完善公平交易增强,助范和杜绝不规范交易行为,保护基金份额持有人的合法权益。公司建立了有纪律、规范
为进一步完善公平交易管理,助范和杜绝不规范交易行为,保护基金份额持有人的合法权益。公司建立了有纪律、规范
化的按竞研究和决策选程来确保公平对持不同投资组合。切实助范利益输送。
公司通过制定 生构基金研究报任张量考评制度》,对立了研究导向的投资文化,强调投资应以研究作为依据,不断建立
完善系统、并学的研究方法和混程,并以他推行实施。
对于场内交易、公司制定了(中海基金需通有限公司交易管理制度)。所有的投资指令必须通过集中交易室下达,集中交
易定与投资部门相隔离,规定多基金指令处理原则是。时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡、通过公司已有交易软件进
行控制,不同基金同项其实同一证等完全通过系统进行比例分配,同时禁止多基金之间的同日反向交易,对于场外交易、通
过位固定收益证券投资管理办法》、《新股询价阁下申游花程以及《中海基金旗下基金投资流通受限证券管理办法》等规定对
交易行为进行规范。
本报告期,不同投资组合的交易得到公平对待。未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.37。本语和另全与其他投资风格相似的投资组合。公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.2 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本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

本基金与本基金管型人旗下的其他投资组合的投资风格不同。
4.3.3 异常交易行为的专项设明
本报告期,未发现未基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.4 管理人对报告期内基金检查转换。
1.4 管理人对报告期内基金检查,是一个企业者的运输表现设明
4.4 报告期内基金检查。
1.4 化自己 1.4 化

此港東的重点。 反复被调低的患是预制反映在股票市场上就是一片萧杀聚象。首先是周期性行业的连续暴跌,存置资金集中在医药、 新兴产业等狭窄的空间内部置,导致市场出现估值结构地分化;市场总体估值水平下降约同时,部分产业和公司出现更高的 估值。中小市经公司的运货中层创新高。二季度末,以医药行业的继承,获为标志,此前强势的中小公司出现大幅补跌,结 构建的统市海安为全面的下限。 本基金在 2010 年上年年转限现实产的特色比例由期到的 89%下降至期末的 78%。行业配置层面主要增持医药,食品 饮料和信息技术等行业,降低采掘。房地产和金融保险行业的配置。

4.42报告前内法金的业绩表现 4.42报告前内法金的业绩表现分额净值 0.677元(累计净值 2.077元)。报告期内本基金净值增长率为-17.16%,高于业 收基准-4.16个百分点。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 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 2010 年下半年的股票市场,首当其冲的问题是经济增速下滑究竟会到哪种程度。我们认为在通胀基本可控的前提之下,不必对经济过于悲观。如果出现经济很差的局面,政府有足够的能力来对冲,所需要的主要条件就是不出现大规模的

通胀。短期内央行公开市场操作已经体现一定宽松迹象,下半年将有2万亿票据到期,如果在回收流动性方面力度缓解,多

但对于非活跃投资品种,投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内,参与估值滚程各方之间无 末人利益冲突。 4.7 管理、对报告期内基金和润分配情况的送回。 5.1 报告期内本基金允管、浅规守信情况用明 在托管中部分红增利混合型证券投资基金的过程中,本基金托管人一中国农业银行严格遵守(证券投资基金法)相关法 结规的规定以及《中海分组增利混合型证券投资基金的过程中,本基金托管人一中国农业银行严格遵守(证券投资基金法)相关法 转规的规定以及《中海分组增利混合型证券投资基金会间》、《中海分互增利混合型证券投资基金托管协议》的约定, 对中海分五增利混合型证券投资基金管理人中海基金管理有限公司 2010年1月1日至 2010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管,认真提行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的 行为。

行为,

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作灌规守信,净值计算,利润分配等情况的说明
本托管人认为,中离基金管理有限公司在中海分型增用混合型证券投资基金的投资运作,基金资产净值的计算,基金份细申购赎回价格的计算,基金费用开文等问题上,不存在损害基金价额供查进行人。在报告期内,严格遵守了(证券投资基金法)等有关注律法规,在安全要对面的运行严格校期基金合则的规定进行。
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,中海基金管理有限公司的信息按翻事多符合(证券投资基金信息按路管理办法)及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制按键的中海分组增加是合置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,在确定整法表现有创新基金持有人利益的行为。

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未 6 半年度财务会计报告(朱经审计)

资产	本期末 2010年 6 月 30 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
资产:	2010-7-673 30 日	2009-12 /1 31 🖂
银行存款	394,922,836.97	159,303,335.79
结算备付金	10,267,023.23	5,537,711.09
存出保证金	6,880,399.80	3,841,026.39
交易性金融资产	2,250,669,978.61	3,392,478,648.85
其中:股票投资	2,084,657,168.81	3,192,853,648.85
基金投资	2,004,037,100.01	3117210331010.03
债券投资	166,012,809.80	199,625,000.00
资产支持证券投资	100,012,005.00	177,023,000.00
衍生金融资产		
买人返售金融资产		
应收证券清算款	1,525,130.00	
应收利息	471,208.25	1,248,765.24
应收股利	4,266.00	
应收申购款	383,313.32	26,543.41
递延所得税资产	_	
其他资产	_	
资产总计	2,665,124,156,18	3,562,436,030.77
负债和所有者权益	本期末 2010年 6 月 30 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
负债:		
短期借款	_	
交易性金融负债	-	
衍生金融负债	-	
卖出回购金融资产款	_	
应付证券清算款	_	
应付赎回款	134,092.81	3,221,239.27
应付管理人报酬	3,625,048.62	4,536,132.96
应付托管费	604,174.77	756,022.17
应付销售服务费	-	
应付交易费用	3,902,531.34	2,628,210.62
应交税费	-	
应付利息	-	
应付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	2,486,297.78	1,934,195.06
负债合计	10,752,145.32	13,075,800.08
所有者权益:		
实收基金	3,920,915,723.94	4,343,475,141.50
未分配利润	-1,266,543,713.08	-794,114,910.81
所有者权益合计	2,654,372,010.86	3,549,360,230.69
As Astronomorphisms of the Act AC AC A	2 665 124 156 18	2 552 125 020 22

所刊者权益合订 2.654.372.010.86 3.549.3607.20.09 金统 1.84 金6 金统 1.84 金6 同生效日为 2005 年 6 月 16 日.报告截止日 2010 年 06 月 30 日.基金份额净值 0.6770 元.基金份额总额 3920915723.94 份。
6.2 何间表 金计主集,中离分红增利混合型证券投资基金本报告期,2010 年 1月 1日 至 2010 年 6 月 30 日

本期 10年1月1日至2010年6月 30日 上年度可比期间 109年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日 1,162,995,001.7 4,509,429.8 1,195,228.4 2,718,709.6 人返售金融资产收入 投资收益 假失以""填列) 685,918,591.94 252,957,348.7 679,130,838.69 -2,355,712.09 产支持证券投资 生工具收益 9,143,465.3 7,532,810.6 公允价值变动收益 假失以 ""号 -781,318,618.0 472,324,173.43 汇兑收益 损失以 ""号填列 其他收入(损失以""号填列) 49.377.059.6 39,281,796,9 3,801,329 3,198,923.4 22,532,924.9 16,643,110.0 -567,021,614.0 1,123,713,204.7 四、净利润(净亏损以""号填列) -567,021,614.01 1,123,713,204.74

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体,中海分红增利混合型证券投资基金 本报告期;2010年1月1日至 2010年6月30日

		本期	单位:
项目	2010年	1月1日至2010年6月	30 ⊟
	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 直)	4,343,475,141.50	-794,114,910.81	3,549,360,230.6
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数 (本期利润)	-	-567,021,614.01	-567,021,614.0
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)	-422,559,417.56	94,592,811.74	-327,966,605.8
其中:1.基金申购款	209,165,396.57	-44,400,072.49	164,765,324.0
2.基金赎回款	-631,724,814.13	138,992,884.23	-492,731,929.9
四、本期向基金份额持有人 分配利润产生的基金净值变 动 (争值减少以""号填列)	-	-	
五、期末所有者权益 (基金净 直)	3,920,915,723.94	-1,266,543,713.08	2,654,372,010.8
项目	2009年	上年度可比期间 1月1日至2009年6月	30 ⊟
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 偡金净 直)	3,902,622,723.99	-1,992,563,618.38	1,910,059,105.6
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数 (本期利润)	-	1,123,713,204.74	1,123,713,204.7
三、本期基金份额交易产生 的基金净值变动数 停值减 少以""号填列)	706,522,617.43	-235,330,471.89	471,192,145.5
其中:1.基金申购款	1,013,494,499.95	-342,756,229.34	670,738,270.6
.基金赎回款	-306,971,882.52	107,425,757.45	-199,546,125.0
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 直)	4,609,145,341.42	-1,104,180,885.53	3,504,964,455.8

报告附注为财务报表的组成部分。 本报告 6.1 至 6.4、财务报表由下列负责人签署, 基金管理公司负责人,陈浩鸣,主管会计工作负责人,黄鹏,会计机构负责人,曹伟 6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况
中海分址得相信,登证券投资基金(以下简称"本基金")原名国歌分红增利混合型证券投资基金。由国歌基金管理有限
公司(現已更名为中语基金管理有限公司)"按原(中年入民共和国证券投资基金法)、《证券投资基金运作管理办法)及有关
法规规定, 总中国证券宣管管理委员会证监基金字(2005)467 号(关于河曼国联分红增利混合型证券投资基金设立的批发)
格准赛集设。《超联基金管理有限公司联会》2006 年第一次、第二次临时支收款有排款,是最后的规定,并给中国证券 监督管理委员会证监基金字(2005)90 号"关于同意国联基金管理有限公司规则是从资利。据证券宣教的发生,是他国证券宣督管理委员会监查基金字(2005)90 号"关于同意国联基金管理有限公司,是国际人员会证金、46次公司责程和变更公 运输的批发。即此他,名称变更少市基金管理有限公司,另是国际人员会国企业企业会上,从企业企业企业企业,是一个企业企业,是一个企业企业,是一个企业企业。 过,并经各基金托管人同意及中国证券宣管管理委员会基金监管部核准,将管理的开放式基金名称进行相应变更,原"国联 分红增利混合验证券投资基金"更名为"中海分组"增利混合量证券投资基金"。 本基金为规约是开放"人类规则保尔"基金管理人为中国金管管理研究司、基金托管人为中国农业银行,有关基金 赛集文件已按规定向中国证券宣誓管理委员会备案;基金合同于 2005 年 6 月 16 日生效,该日的基金份额总额为 403、405、465、83 份。

442.85 份。
4.42 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确。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",中国证券业协会于2007年5
月15日颁布的证券投资基金会计核资业务格引)。本基金合同和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。
6.43 本概是即用采用的会计政策。会计估计与最近一期中度报告相一致的说明
本基金在本报告期内的会计政策。会计估计与最近一期中度报告相一致的说明
本据发明原采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致。
6.45 老精更正的说明
本基金在本报告期内不存在重大会计差错。
6.46 税源
报谢财政部。国家税务总局财积字 [2002]128 号(关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知)。财税[2005]103 号(关于证券投资基金有关税收回题的通知)。财税[2005]103 号(关于还款投资量法成本有关税收款策问题的通知)。财税[2005]103 号(关于还款分置法成改革有关税收款策问题的通知)。财税[2007]
84 号(关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:
6.4.6.6.

54.5.1 同亚血分(取票)及勿印化优化率的超周/及共间相关优分依 64.6.1 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。 64.6.2

工 买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

04-03.3 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数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。 6.4.6.4

证的证据。 6.465 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价管免征效印花税、企业所得 6.4.7 关联方关系

基金托管人、代销机构 基金管理人的股东

关联方名称	与本基金的关系
中海基金	基金管理人、直销机构
中国农业银行	基金托管人、代销机构
国联证券	基金管理人的股东、代销机构

本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易电元进行权证交易。 6.48.13.债券更可比期间本基金未通过关联方交易电元进行债券交易。 6.48.14.债务间购收易 本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。 6.48.15.宜收头联方的佣金 本基金在本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。 6.48.2 关联方报酬 6.48.2 关联方报酬

上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日 2010年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的管 22,807,974.16 19,193,540.63 其中:支付销售机构的客户维持 2,552,666.02 2,127,310.96

任,基金管理费核前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下; H=Ex1.5%/当年天数(H 为每日应支付的基金管理费,E 为前一日的基金资产净值) 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。 6.4.8.2.2 基金托管费 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日

费: 基金托管费核前一日的基金费产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下: H=Ex0.25%/当年天数 H 为每日应支付的基金凭产费 E 为前一日的基金费产净值 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。 6-4.83—与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金在本股告期及上年度可比则而未与实地方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。 6-4.84—1 报程即基金管理人还用因者等金移查本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

用初持有的基金份額 期末持有1936歲以內國占基金包 期末持有的基金份獨占基金包 使用於 (1.92% (1.45%) (1. 1.63%

				平型:ハ	CEC 111
关联方名称	2010年1月1日至		上年度 ² 2009年1月1日至	「比期间 2009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	394,922,836.97	1,366,747.26	625,777,473.94	1,720,691.03	
:本基金的银行存款	由基金托管人中国农业	V银行股份有限公司保	管,并按银行间同业利	率计息。	•
4.8.6 本基金在承销	前期内参与关联方承销记	正券的情况			
				△ 報前 6 /2 1	F93, 787

					金额单位:人
		2010年1月1日	本期 至 2010 年 6 月	30 ⊟	
				基金在	承销期内买人
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量 (单位:股/ 张)	总金额
国联证券	300094	国联水产	分销	500	7,190.00
国联证券	601801	皖新传媒	分销	1000	11,800.00
		上年度 2009年1月1日	で可比期间 至 2009 年 6 月	30 ⊟	
				基金在	承销期内买人
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量 (单位:股/ 张)	总金额
-	-	-	-	-	-

金额单位:人民币元

2010- 06-22 2010- 04-30	国联产 唐山 和市	2010- 07-08 2010- 07-05	新股 认购 新股购	14.38	14.38	500	7,190.00	7,190.00	-
2010- 04-30 2010-	港和而			0.20					1
04-30 2010-			D/1,909	8.20	8.20	1,000	8,200.00	8,200.00	-
	泰	2010- 08-11	新股 认购	35.00	32.80	12,912	451,920.00	423,513.60	-
0,5-00	多氣多	2010- 08-18	新股 认购	39.39	41.65	20,610	811,827.90	858,406.50	-
2010- 04-12	安诺	2010- 07-23	新股 认购	21.20	18.52	58,616	1,242,659.20	1,085,568.32	-
	合众 思壮	2010- 07-02	新股 认购	37.00	48.45	41,124	1,521,588.00	1,992,457.80	-
	四维 图新	2010- 08-18	新股 认购	25.60	33.18	66,627	1,705,651.20	2,210,683.86	-
	海康 威视	2010- 08-30	新股 认购	68.00	69.30	37,586	2,555,848.00	2,604,709.80	-
	东山 精密	2010- 07-09	新股 认购	26.00	57.67	51,729	1,344,954.00	2,983,211.43	-
	国民 技术	2010- 08-02	新股 认购	87.50	116.75	46,007	4,025,612.50	5,371,317.25	-
	东山 精密 国民术	2010- 03-31 2010- 04-23	2010- 03-31 2010- 07-09 2010- 04-23 2010- 08-02	2010- 2010- 新股 03-31 07-09 认购 2010- 2010- 新股	2010- 03-31 2010- 07-09 认购 26.00 2010- 04-23 08-02 认购 87.50	2010- 03-31 2010- 07-09 认购 26.00 57.67 2010- 04-23 08-02 认购 87.50 116.75	2010- 03-31 07-09 认购 26.00 57.67 51,729 2010- 04-23 08-02 认购 87.50 116.75 46.007	$ \begin{array}{c ccccccccccccccccccccccccccccccccccc$	2010- 03-31 07-09 以版 26.00 57.67 51.729 1.344,954.00 2.983,211.43 2010- 2010- 2010- 新設 87.50 116.75 46.007 4.025,612.50 5.371,317.25

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 段)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
601318	中国平安	2010- 06-29	重大 事項 停牌	44.55	-	-	604,701	30,524,838.24	26,939,429.55	-
3 期末	债券正	回购交易	力作关	抵押的值	乔袋					

6.49.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.49.3.1 银行间市场债券正回购 本基金本程告期末无银行间市场债券正回购余额,因此无抵押债券。 6.49.3.2 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,因此无抵押债券。 7 投资组合报告

2,084,657,168.81 2,084,657,168.81 405,189,860.2

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比 例 6%)
A	农、林、牧、渔业	7,854,999.44	0.30
В	采掘业	45,362,738.86	1.7
C	制造业	1,071,477,446.84	40.3
CO	食品、饮料	133,355,183.81	5.02
C1	纺织、服装、皮毛	11,602,161.50	0.44
C2	木材、家具	66,567,469.32	2.5
C3	造纸、印刷	-	
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,132,093.95	1.55
C5	电子	49,746,586.99	1.8
C6	金属、非金属	100,097,200.88	3.7
C7	机械、设备、仪表	352,073,449.67	13.2
C8	医药、生物制品	224,397,757.20	8.4
C99	其他制造业	92,505,543.52	3.49
D	电力、煤气及水的生产和供应业	20,220,278.40	0.7
E	建筑业	100,222,596.00	3.7
F	交通运输、仓储业	77,939,115.83	2.9
G	信息技术业	223,814,512.89	8.4
Н	批发和零售贸易	111,545,958.09	4.2
I	金融、保险业	389,485,466.42	14.6
J	房地产业	-	
K	社会服务业	25,202,490.04	0.9
L	传播与文化产业	831,978.00	0.03
M	综合类	10,699,588.00	0.40
	合计	2.084.657.168.81	78.5

股票代码 600036 600970	股票名称 招商银行	数量 般)	公允价值	占基金资产净 值比例 %)
600970		11,306,730		
	1.11		147,100,557.30	5.54
	中材国际	5,567,922	100,222,596.00	3.78
600000	浦发银行	6,322,680	85,988,448.00	3.24
000969	安泰科技	5,552,864	81,516,043.52	3.07
600337	美克股份	9,760,626	66,567,469.32	2.51
002304	洋河股份	408,684	60,035,679.60	2.26
600406	国电南瑞	1,560,199	59,896,039.61	2.26
601601	中国太保	2,525,890	57,514,515.30	2.17
000423	东阿阿胶	1,547,733	53,799,199.08	2.03
600581	八一钢铁	5,612,104	52,641,535.52	1.98
-	601601 000423 600581	601601 中国太保 000423 东阿阿胶	601601 中国太保 2.525.890 000423 东阿阿胶 1,547,733 600581 八一钢铁 5,612,104	601601 中国太保 2.525.890 57.514.515.30 000423 东阿阿胶 1.547.733 53,799.199.08 600581 八一钢铁 5,612,104 52,641,535.52

7.4	报告期内股票投资组合的重大变动			
7.4	即共71人處却山期初せ人次立為店	200, 100 200	20	夕的即画明柳

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产 净值比例 %)
1	600036	招商银行	206,789,908.82	5.83
2	000969	安泰科技	150,237,490.81	4.23
3	600970	中材国际	146,290,154.67	4.12
4	000996	中国中期	144,035,227.61	4.06
5	000400	许继电气	136,379,286.39	3.84
6	600016	民生银行	130,152,361.72	3.67
7	002028	思源电气	121,307,727.56	3.42
8	600704	中大股份	102,393,506.34	2.88
9	600271	航天信息	99,349,232.50	2.80
10	600176	中国玻纤	98,864,624.71	2.79
11	600000	浦发银行	93,853,645.11	2.64
12	600128	弘业股份	88,828,802.96	2.50
13	600837	海通证券	88,627,356.90	2.50
14	600067	冠城大通	88,047,933.24	2.48
15	600100	同方股份	87,076,254.29	2.45
16	600406	国电南瑞	83,565,957.49	2.35
17	600739	辽宁成大	82,583,469.64	2.33
18	600581	八一钢铁	78,774,028.24	2.22
19	600884	杉杉股份	77,789,717.65	2.19
20	600312	平高电气	76,110,897.37	2.14
21	000623	吉林敖东	71,320,012.40 額(成交单价乘以成交数量)列示的	2.01

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	000983	西山煤电	174,243,557.17	4.91
2	600016	民生银行	146,468,871.69	4.13
3	000063	中兴通讯	130,561,698.53	3.68
4	600036	招商银行	118,034,428.87	3.33
5	000400	许继电气	115,439,947.85	3.25
6	600031	三一東工	114,463,821.86	3.22
7	601601	中国太保	114,062,590.46	3.21
8	000060	中金岭南	106,646,536.79	3.00
9	600837	海通证券	100,883,528.03	2.84
10	600100	同方股份	98,368,249.02	2.77
11	600348	国阳新能	92,899,414.60	2.62
12	600704	中大股份	89,095,146.05	2.51
13	002028	思源电气	86,232,673.00	2.43
14	000996	中国中期	85,130,170.39	2.40
15	600884	杉杉股份	76,053,929.50	2.14
16	600176	中国玻纤	74,902,290.21	2.11
17	600550	天威保变	71,882,220.44	2.03
18	601318	中国平安	69,411,138.88	1.96
19	600739	辽宁成大	68,284,821.85	1.92
20	600584	长电科技	67,571,806.96	1.90

7.4	.3 头人股票E	的成本忌額及实出股票的收入忌額			
				金额单位:人	无
	买入股票的	成本 (成交)总额		7,032,494,316.41	
	卖出股票的	收入 (战交)总额		7,612,539,717.38	
		,买人股票成本总额和卖出股票收入总额	都以股票成交金额(成交单价率	美以成交数量)列示的,不	砦
	费用。 - 期末拡係者	品种分类的债券投资组合			
//	79171413419430	-1817 17 3C 17 18C 37 1X 3C 182 E1		金额单位:人	民
	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	156,448,000.00	5.89	
	3	金融债券	-	-	
		其中:政策性金融债	-	-	
	4	企业债券	-	-	
	-	A in the district total dis-			

	,	261E				_		_	
	8	合计				166,012,809.80		6.25	1
5	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	(Ri
	序号	债券代码	债券名称	数量	(长)	公允价值		占基金资产 净值比例 %)	
	1	1001038	10央票 38	1,	600,000	156,44	8,000.00	5.89	1
	2	113001	中行转债		94,570	9,56	4,809.80	0.36	1
7	期末按	公允价值占基金	资产净值比例大小排	*名的前-	十名资产:	支持证券投资明细			

本基金基础影响来来持有竞争支持证券。 73. 期末校公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 本基金土销售期末来持有股份 79.1 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成在本报告编制目前一年内受到公开遗 则的检验2000 7.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

序号	名称	金額
1	存出保证金	6,880,39
2	应收证券清算款	1,525,13
3	应收股利	4,26
4	应收利息	471,20
5	应收申购款	383,31
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	9,264,31

					行有.	人结构			
	持有人户	户均持有的基		机构投资	者	个人投资者		者	
	数 (户)	金份额	持有	份额	占总份额比例	持有份	纐	占总份额 比例	
	157,096	24,958.72	736,8	374,401.04	18.79%	3,184,041	,322.90	81.21%	
8.2	期末基金管	理人的从业人员	持有本开发	(式基金的	青况				
		项目			持有份额总数(分)	占基金	金总份额比例	
	基金管理公 放式基金	司所有从业人员持	持有本开			143,482.20		0.0037%	
				9 开放式	基金份额变动			į.	自位
	基金合同生	效日 2005 年 6 月	16日)基金	金份额总额				603,405,465.83	8.002
	本报告期期	初基金份額总額					4	,343,475,141.50	
	水烬生烟丝	金草由歐份麵						200 165 306 57	

10.4 基金投资取购的改变 本报告期内本基金的投资取购来有重大变化。 10.5 报告期内改聘会计即邮车务所情况 为本基金审计的会计即邮车务所证券公证系业会计师事务所有限公司,本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事 为本基金审计的会计师事务所允证系公证实业会计师事务所有限公司,本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事

「。 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 本报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

						飯里位:ノ
		股票交易	1	应支付该券i	备注	
券商名称	交易单元数量	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	
安信证券	1	4,956,135,329.17	33.90%	4,212,707.84	34.46%	-
国金证券	1	2,338,524,450.09	15.99%	1,987,736.38	16.26%	-
海通证券	1	2,260,945,250.56	15.46%	1,837,033.43	15.03%	-
招商证券	1	1,529,649,672.96	10.46%	1,242,848.28	10.17%	-
国信证券	1	1,194,409,787.03	8.17%	970,465.25	7.94%	-
国泰君安	1	1,114,916,231.66	7.62%	947,674.69	7.75%	-
平安证券	1	477,651,988.55	3.27%	388,095.24	3.17%	-
银河证券	1	356,756,051.05	2.44%	303,242.17	2.48%	-
金元证券	1	229,070,728.34	1.57%	194,707.76	1.59%	-
东兴证券	1	163,919,758.18	1.12%	139,331.48	1.14%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
AV-4-310245	1					

注 4:由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 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

券商名称	成交金额	占当期债 券成交总 额的比例	成交金額	占当期回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期 权证总额 的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	-	-	-	-	
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	
金元证券	-	-	-	-	-	
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	
广发证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	
长江证券	-	-	-	-	-	
兴业证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	1	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-