

浦银安盛价值成长股票型证券投资基金

2011 第一季度报告

2011年3月31日

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2011年4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,基金的投资业绩并不表示对未来表现,投资风险,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。

本报告自2011年1月1日起至3月31日止。
5.2 基金产品概况
基金名称:浦银安盛价值成长股票
基金代码:519110

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2008年4月16日
报告期末基金份额总额:808,142,877.43份

投资目标:以追求长期资本增值为目的,通过投资于市场价值低估的具有价值属性或可预期的具有成长性优势的上市公司,在严格控制风险的前提下,分享中国经济快速增长的成长,实现基金资产的长期增值。

投资策略:本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资策略,在投资策略上充分体现“价值”和“成长”的主导思想,在本部分分析的基础上,结合国内的实地调研和估值研究,对于符合本基金理念的个股进行重点挖掘。

业绩比较基准:沪深300指数*75%+中信标普综合指数*25%
风险收益特征:本基金为主动操作的股票型证券投资基金,坚持长期和基于基本面研究的投资理念,属于证券投资基金中的较高收益、较高风险品种,一般情形下,其风险和收益均高于股票型基金、债券型基金和货币型基金,本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金资产的安全和增值。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 12,492,310.30
2.本期利润 -15,634,464.13
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0188

3.2 基金净值表现
阶段 净值增长率① 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

过去三个月 -1.97% 1.43% 2.63% 1.03% -4.60% 0.40%
3.2.2 自基金合同生效以来基金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

浦银安盛价值成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
008年4月16日至2011年3月31日

4.1 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.2 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.3 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.4 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.5 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.6 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.7 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.8 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.9 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.10 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.11 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.12 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.13 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.14 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.15 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.16 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

浦银安盛红利精选股票型证券投资基金

2011 第一季度报告

2011年3月31日

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2011年4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,基金的投资业绩并不表示对未来表现,投资风险,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。

本报告自2011年1月1日起至3月31日止。
5.2 基金产品概况
基金名称:浦银安盛红利精选股票
基金代码:519115

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年12月3日
报告期末基金份额总额:160,283,931.23份

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,通过投资于盈利能力高、分红稳定或分红潜力大的上市公司和国内依法公开发行的各类债券,力争为投资者提供稳定的投资收益和长期资本增值。

投资策略:本基金坚持注重稳健、长期价值投资理念,着重把握经济周期波动规律,动态捕捉不同资产类别的投资价值,及时捕捉以及其风险收益特征的变化,进行投资,捕捉收益证券投资机会等,资产配置策略,在资产高低配置过程中,始终贯彻以风险控制理念,在严格控制风险的前提下,实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准:中证红利指数*75%+中信标普综合指数*25%
风险收益特征:本基金为股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的较高收益、较高风险品种,一般情形下,其风险和收益均高于股票型基金、债券型基金和货币型基金,本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金资产的安全和增值。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 1,391,626.47
2.本期利润 -3,605,403.90
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0219

3.2 基金净值表现
阶段 净值增长率① 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

过去三个月 -2.08% 1.48% 3.77% 0.99% -5.85% 0.49%
3.2.2 自基金合同生效以来基金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

浦银安盛红利精选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2009年12月3日至2011年3月31日

4.1 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.2 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.3 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.4 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.5 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.6 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.7 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.8 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.9 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.10 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.11 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.12 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.13 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.14 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.15 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.16 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金

2011 第一季度报告

2011年3月31日

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2011年4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,基金的投资业绩并不表示对未来表现,投资风险,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。

本报告自2011年1月1日起至3月31日止。
5.2 基金产品概况
基金名称:浦银安盛优化收益债券
基金代码:519111

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2008年12月30日
报告期末基金份额总额:64,713,294.37份

投资目标:本基金通过考察宏观经济运行状况、金融市场的运行趋势进行自上而下的分析,通过自上而下分析,在严格控制风险的前提下,分享中国经济快速增长的成长,实现基金资产的长期增值。

投资策略:本基金在宏观经济和市场运行自上而下和自下而上分析的基础上,把握市场利率的变动方向,在严格控制风险的前提下,实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准:中证全债指数
风险收益特征:本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的较低收益、较低风险品种,一般情形下,其风险和收益均低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金,本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金资产的安全和增值。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 503,161.11
2.本期利润 136,364.11
3.加权平均基金份额本期利润 0.0021

3.2 基金净值表现
阶段 净值增长率① 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

过去三个月 0.10% 0.22% 0.79% 0.04% -0.69% 0.18%
3.2.2 自基金合同生效以来基金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

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2008年12月30日至2011年3月31日

4.1 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.2 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.3 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.4 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.5 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.6 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.7 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.8 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.9 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.10 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.11 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.12 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.13 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.14 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.15 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.16 基金经理 魏建伟先生,上海财经大学学士,2001年至2007年在上海浦东国际信托有限公司担任研究员、投资助理,2007年加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员、基金经理,2009年加入浦银安盛基金管理有限公司担任基金经理,2010年7月担任,担任本基金基金经理。

4.2 报告期末基金资产净值
由于资产配置、TMT等行业在报告期内表现较好,本季度净值表现低于比较基准,报告期内基金业绩为-2.08%,基准业绩为3.77%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 151,034,052.79 87.38
其中:股票 151,034,052.79 87.38

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 20,502,091.08 11.86
6 其他各项资产 1,305,859.73 0.76
7 合计 172,842,003.60 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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 -- --
B 制造业 17,561,136.10 10.35
C 采矿业 92,199,287.25 54.34

CO 食品饮料 4,536,402.50 2.67
C1 纺织、服装、皮毛 3,045,522.40 1.79
C2 木材、家具 -- --

C3 造纸、印刷 -- --
C4 石油、化学、塑胶、塑料 7,905,833.85 4.66
C5 电子 1,505,500.00 0.89

C6 金属、非金属 29,485,078.38 17.38
C7 机械、设备、仪表 34,426,102.92 20.29
C8 医药、生物制品 9,383,649.00 5.65

C9 其他制造业 2,211,000.00 1.30
D 电力、煤气及水的生产和供应业 1,653,000.00 0.97
E 建筑业 2,545,731.16 1.50

F 交通运输、仓储业 -- --
G 信息技术 -- --
H 金融、保险业 -- --
I 房地产业 28,112,244.68 16.57

J 其他 -- --
K 社会服务业 4,451,100.00 2.66
L 传播与文化产业 -- --
M 综合类 4,111,553.60 2.42
合计 151,034,052.79 89.02

5.3 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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601041 中国太保 199,908 4,421,964.96 2.61
2 601166 兴业银行 150,000 4,306,500.00 2.54

3 601009 南京银行 382,425 4,233,444.75 2.50
4 601169 北京银行 339,951 4,069,217.47 2.40

5 601118 中国平安 80,000 3,966,900.00 2.33
6 000001 深发展A 132,953 3,722,688.00 2.19
7 600449 厦门空港 89,997 3,578,270.12 2.11

8 600188 招商银行 100,000 3,450,000.00 2.03
9 600742 一汽富维 99,972 3,283,088.48 1.93
10 000023 东阿阿胶 75,100 3,236,059.00 1.91

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未有债券投资。
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未有债券投资。

5.6 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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持投资。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未有权证。

5.8 报告期末本基金持有的股指期货投资情况
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名权证的投资主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
5.8.2 本基金投资的前十名权证中,没有超出基金合同约定的备选股票的范围。
5.8.3 其他各项资产和负债

序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 461,956.02
2 应收证券清算款 829,267.52

3 应收股利 -- --
4 应收利息 3,848.81
5 应收申购款 10,787.38

6 其他应收款 -- --
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 1,305,859.73

5.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。
5.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未有流通受限情况。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持投资。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未有权证。

5.8 报告期末本基金持有的股指期货投资情况
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名权证的投资主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
5.8.2 本基金投资的前十名权证中,没有超出基金合同约定的备选股票的范围。
5.8.3 其他各项资产和负债

序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 83,333.33
2 应收证券清算款 5,000,411.81

3 应收股利 -- --
4 应收利息 1,153,998.80
5 应收申购款 80,000.00

6 其他应收款 -- --
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 6,317,743.98

5.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。
5.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未有流通受限情况。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持投资。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未有权证。

5.8 报告期末本基金持有的股指期货投资情况
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名权证的投资主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
5.8.2 本基金投资的前十名权证中,没有超出基金合同约定的备选股票的范围。
5.8.3 其他各项资产和负债

序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 83,333.33
2 应收证券清算款 5,000,411.81