

光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)摘要

光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“本基金”)于2004年6月11日经中国证监会证券投资基金业协会于2004年8月27日核准,本基金份额于2004年7月20日至8月20日发售,本基金合同于2004年8月27日正式生效。

重要提示
光大保德信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”、“本基金管理人”或“本公司”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书由中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明其对基金投资是否盈利或资金安全性有任何保证,更不保证基金管理人能完全兑现其承诺或预期,请投资者认真阅读本招募说明书,并自行承担投资风险。

投资有风险,投资者申购基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。本招募说明书所载数据截至2011年8月26日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:光大保德信基金管理有限公司
成立日期:2004年4月22日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]142号
注册地址:上海市浦东新区世纪大道232号外滩中心大厦46层
办公地址:上海市延安路222号外滩中心大厦46层
法定代表人:林昌
注册资本:人民币1.6亿元
组织形式:公募证券投资基金管理有限责任公司(以下称“光大证券”)持有55%的股权
保险投资管理有限责任公司持有45%的股权
电话:(021)13074700
传真:(021)63351152
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:张旭
网址:www.ebfund.com
(二)主要人员情况

1. 董事会成员
林昌先生,董事长,北京大学硕士,中国国籍,历任光大证券南方总部研究部总经理、投资银行一部总经理、南方总部副总经理、投资银行一部总经理、光大证券助理总裁,现任本基金管理人董事长。
Christopher Cooper,常务副董事长,曾任光大证券、美国芝加哥大学、美国福乐,历任保德信国际投资有限公司执行董事、保德信投资咨询有限公司总裁兼首席执行官、保德信国际投资有限公司亚洲区总裁,现任保德信国际投资有限公司董事。
傅晓修先生,董事,美国哥伦比亚大学硕士,中国(香港)国籍,曾任富达基金管理公司(Fidelity)业务总监,瑞士银行资产管理公司(UBS)执行董事兼大中国区主管,北寿华基金管理公司副总经理,现任本基金管理人总经理。
沈涛先生,董事,东北财经大学硕士,中国国籍,历任光大证券计划财务部高级经理、财务处处长、计划财务部总经理,现任光大证券计划部总经理。
何晓斌先生,董事,上海交通大学企业管理专业硕士,中国国籍,历任华夏证券研究所行业部经理、副所长,中信建投证券有限责任公司研究发展部副总经理,现任光大证券研究所副所长。
夏广先生,独立董事,复旦大学政府经济学系学士,中国国籍,历任交通银行研究开发部经济研究处处长、研究开发部副总经理,广东发展银行上海分行常务副行长、行长,党委书记,现任华夏银行上海分行行长。
金维生先生,独立董事,上海交通大学硕士,教授,中国国籍,曾任上海财经大学商学院工商管理系系主任、财政系副主任、证券期货学院副院长,现任上海财经大学金融学院证券研究中心主任。
王志先生,独立董事,华东政法学院(现华东政法大学)法律专业硕士,曾任上海交通大学上海分院法律事务部、国浩律师事务所(上海)事务所律师,上海东方华信律师事务所合伙人及律师,现任北京市大成律师事务所上海分所律师。

2. 监事成员

李海松先生,监事长,光大证券股份有限公司监事、风险管理部副总经理,历任南方证券有限公司营业部业务总监、中信建投证券股份有限公司稽核证券部副总经理,光大证券武汉、深圳证券部总经理,经纪业务部总经理。

熊德通先生,监事,新加坡国立大学经济和数学双学士,马来西亚国籍,香港证券业协会会员,历任新加坡Farwest国际控股集团中国区分析员、DBS唯南达亚洲有限公司合规经理,香港交易所上市部副总监,富通集团中国区副总监,现任光大保德信基金管理有限公司合规经理,香港交易所上市部副总监。
张方先生,监事,香港理工大学工商管理硕士,中国国籍,曾就职于普华永中天会计师事务所有限公司,2004年初加入光大保德信基金管理有限公司并参与公司的工作,现任本基金管理人财务部总监。

3. 公司高级管理人员
林昌先生,现任本基金管理人董事长,简历同上。
傅晓修先生,现任本基金管理人总经理,简历同上。
傅晓先生,北京大学硕士,中国国籍,历任中国光大国际信托投资公司证券交易部经理,光大证券资产管理部总经理,2003年参加光大保德信基金管理有限公司筹备工作,现任本基金管理人的董事长。
何晓斌先生,现任本基金管理人副总经理,上海交通大学机械系学士,基金从业资格,曾任美国纽约安达实业股份有限公司投资管理经理,光大证券股份有限公司南方总部机构管理部总经理兼任电脑部总经理,光大证券电子商务一部总经理,信息技术部总经理兼客户服务中心总经理,2004年7月加入光大保德信基金管理有限公司,现任本基金管理人副总经理兼首席运营官。
林浩先生,CFA,美国三藩市州立大学(Lancaster University)金融学硕士,曾任建设银行上海分行信贷部,平安基金管理有限公司产品研发经理,战略策划部总监助理,即加入光大保德信基金管理有限公司后,先后任信贷部总监、市场部及产品总监,代理市场部总监,首席市场部总监,现任本基金管理人副总经理兼首席市场总监。
(三)基金经理
何克亮先生,与常昊先生共同担任本基金基金经理时间为2004年8月27日至2005年8月6日。
常昊先生,担任本基金基金经理时间为2004年8月27日至2007年6月28日。
李国栋先生,担任本基金基金经理时间为2007年6月29日至2011年4月11日。
现任基金经理:
钱钧先生,硕士,毕业于南京国际工商管理学院,工商管理硕士专业学位,曾在联合证券担任高级研究员,在西南证券担任投资经理助理等工作,现任本基金管理人权益投资总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

5. 投资决策委员会成员

傅晓修先生,现任本基金管理人董事兼总经理。
周仲修先生,现任本基金管理人首席投资总监兼光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金经理。
戴春晓女士,现任本基金管理人首席研究员兼光大保德信核心策略股票型证券投资基金基金经理。
钱钧先生,现任本基金管理人权益投资总监,光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。
凌超先生,现任光大保德信货币市场基金基金经理。
凌敏先生,现任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理兼光大保德信添益债券型证券投资基金基金经理。
陈露女士,现任光大保德信动态灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
丁晓杰先生,现任光大保德信红利股票型证券投资基金基金经理。
高伟先生,现任本基金管理人 QDII 投资总监。
曹宇先生,现任光大保德信稳健精选股票型证券投资基金基金经理。
戴春晓先生,现任本基金管理人研究总监。
李阳先生,现任光大保德信中小盘股票型证券投资基金基金经理。
(四)基金经理助理
王彦先生,基金经理助理。

二、基金托管人

名称:中国光大银行股份有限公司(简称“中国光大银行”)
住所:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号光大中心
成立时间:1992年8月18日
注册资本:人民币404.3479亿元
法定代表人:唐双宁
联系人:李海松
电话:010-63691322
网址:www.ebchina.com

批准设立机关及批准设立文号:国函[1992]7号
基金托管资格批准文号:证监基金字[2002]75号
注册地址:北京市西城区复兴门内大街6号光大大厦
办公地址:北京市西城区复兴门内大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
组织形式:股份有限公司
存续期间:持续经营
注册资本:282,189 亿元人民币
电话:010-68560675
传真:(010)68560661
联系人:王彦平
网址:www.ebchina.com

三、相关服务机构

(一)直销机构
名称:光大保德信基金管理有限公司上海投资理财中心
地址:上海市延安路222号外滩中心大厦46层
电话:(021)63352034、63352037
网址:www.ebfund.com
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘悦,戴小娟
网址:www.ebfund.com
(二)代销机构
1. 中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
联系人:邵明雨
客服电话:95533
联系人:王嘉明
网址:www.ccb.com
2. 中国工商银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东二路318号1号楼21层-29层
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:李卫民
联系人:李菁菁
组织形式:股份有限公司
存续期间:持续经营
注册资本:282,189 亿元人民币
电话:010-68560675
传真:(010)68560661
联系人:王彦平
网址:www.ebchina.com

3. 交通银行股份有限公司
名称:光大保德信基金管理有限公司上海投资理财中心
地址:上海市延安路222号外滩中心大厦46层
电话:(021)63352034、63352037
网址:www.ebfund.com
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘悦,戴小娟
网址:www.ebfund.com
(二)代销机构
1. 中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
联系人:邵明雨
客服电话:95533
联系人:王嘉明
网址:www.ccb.com
2. 中国工商银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东二路318号1号楼21层-29层
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:李卫民
联系人:李菁菁
组织形式:股份有限公司
存续期间:持续经营
注册资本:282,189 亿元人民币
电话:010-68560675
传真:(010)68560661
联系人:王彦平
网址:www.ebchina.com

3. 交通银行股份有限公司
名称:光大保德信基金管理有限公司上海投资理财中心
地址:上海市延安路222号外滩中心大厦46层
电话:(021)63352034、63352037
网址:www.ebfund.com
客服电话:400-820-2888,(021)53524620
联系人:刘悦,戴小娟
网址:www.ebfund.com
(二)代销机构
1. 中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
联系人:邵明雨
客服电话:95533
联系人:王嘉明
网址:www.ccb.com
2. 中国工商银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东二路318号1号楼21层-29层
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:李卫民
联系人:李菁菁
组织形式:股份有限公司
存续期间:持续经营
注册资本:282,189 亿元人民币
电话:010-68560675
传真:(010)68560661
联系人:王彦平
网址:www.ebchina.com

4. 中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:肖钢
客服电话:95588
网址:www.boc.com
5. 中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595
网址:www.ebchina.com
6. 招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区长沙中路33号招商银行股份有限公司大厦
法定代表人:傅利军
客服电话:95555
联系人:邓朝朝
网址:www.cmbchina.com
7. 中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文耀
客服电话:95568
联系人:董文耀
电话:010-57092161
网址:www.cmbchina.com
8. 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:(021)61688888
联系人:吴云云
客户服务热线:95528
公司网站:www.bankofshanghai.com
9. 中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:李丹
客服电话:95558
联系人:李海平
电话:(021)52629999
联系人:邵明雨
客服电话:95561
网址:www.ecitbc.com
11. 北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街甲17号
法定代表人:闫冰竹
电话:(010)66223584
传真:(010)66226045
客服电话:95526
公司网站:www.bankofbj.com.cn
12. 兴业银行股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路294号
办公地址:宁波市鄞州区宁南路700号兴业银行大楼
法定代表人:高建平
电话:(0574)8908340
联系人:潘晓

电话:(0574)8705024
联系人:潘晓
客服电话:95562
网址:www.guowen.com.cn
42. 华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客服电话:025-83299979
传真:(025)84579763
联系人:冯攀
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
43. 中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址:广东省广州市农林下路83号
法定代表人:王东明
电话:(0755)83073087
传真:(0755)83073104
联系人:陈冲
客服电话:(0571)9608888_020-38322222
网址:www.csc.com.cn
44. 信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中农大厦10层
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63801000
传真:010-63801000
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
45. 天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
网址:www.txsec.com
46. 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信大厦7楼
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信大厦7楼
法定代表人:何如
联系人:刘澍
联系电话:0755-82024422
网址:www.guosen.com.cn
47. 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:李光伟
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
客服电话:4008888878,10108888 95525
联系人:李勇
网址:www.ebchina.com
20. 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:(021)23100000
传真:(021)23101000
客服电话:95553,4008888801
联系人:李芸
网址:www.htsec.com
21. 国联证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:芮勇
电话:(0755)82960223
传真:(0755)82943100
客服电话:4008888811
联系人:杜娟
网址:www.guosen.com.cn
22. 国君证券安多证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区城隍庙路618号
办公地址:上海市浦东新区城隍庙路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:李进
电话:(021)38676161
电话:(021)38670161
客服电话:4008888666
联系人:王毅
网址:www.gjzq.com
23. 山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:段晓刚
电话:(0351)8686703
传真:(0351)8686619
客服电话:400-666-1618
联系人:孟博
网址:www.i618.com
24. 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4188号平安国际交易广场4楼
办公地址:深圳市福田区益田路4068号平安国际交易广场4楼
法定代表人:杨宇平
联系人:杨宇平
电话:(0755)22626172
传真:(0755)84240682
客服电话:4008811062
网址:www.pingan.com
25. 中金证券股份有限公司
注册地址:北京市中西城区阜成门内大街2号
办公地址:北京市西城区金融大街19号
法定代表人:陈刚
电话:(010)85130888
传真:(010)85130888
联系人:王健
电话:(010)85130888
传真:(010)85130888
(免长话费)
联系人:王健
电话:(010)85130888
联系人:李博
电话:(010)68665880
联系人:李博
电话:(010)68665880
26. 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街33号
办公地址:北京市西城区金融大街33号
法定代表人:李伟
电话:(010)66568116
客服电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn
27. 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安信大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区深南大道2028号中国凤凰大厦1号楼B座
法定代表人:牛冠兴
联系人:孙爱明
电话:(0755)82558305
客服电话:400-800-1001
网址:www.axsec.com.cn
36. 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市虹口区东大名路336号
办公地址:上海市虹口区东大名路336号
联系人:陈皓
电话:(021)51539888
联系人:陈皓
电话:(021)51539888
37. 齐鲁证券有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
38. 华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中纺中心广场香港中旅大厦4楼
办公地址:深圳市福田区中心区中纺中心广场香港中旅大厦4楼
法定代表人:马瑞波
联系人:潘博
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
网址:www.lhjzq.com
39. 宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯伟
客服电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
40. 浙江证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
电话:(0571)87901963
联系人:潘晓
电话:(0571)87902079
网址:www.ztsec.com
41. 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼至二十六楼
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼至二十六楼

法定代表人:何如
客服电话:95556
网址:www.guowen.com.cn
42. 华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客服电话:025-83299979
传真:(025)84579763
联系人:冯攀
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
43. 中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址:广东省广州市农林下路83号
法定代表人:王东明
电话:(0755)83073087
传真:(0755)83073104
联系人:陈冲
客服电话:(0571)9608888_020-38322222
网址:www.csc.com.cn
44. 信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中农大厦10层
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63801000
传真:010-63801000
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
45. 天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
网址:www.txsec.com
46. 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信大厦7楼
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信大厦7楼
法定代表人:何如
联系人:刘澍
联系电话:0755-82024422
网址:www.guosen.com.cn
47. 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:李光伟
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
客服电话:4008888878,10108888 95525
联系人:李勇
网址:www.ebchina.com
20. 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:(021)23100000
传真:(021)23101000
客服电话:95553,4008888801
联系人:李芸
网址:www.htsec.com
21. 国联证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:芮勇
电话:(0755)82960223
传真:(0755)82943100
客服电话:4008888811
联系人:杜娟
网址:www.guosen.com.cn
22. 国君证券安多证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区城隍庙路618号
办公地址:上海市浦东新区城隍庙路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:李进
电话:(021)38676161
电话:(021)38670161
客服电话:4008888666
联系人:王毅
网址:www.gjzq.com
23. 山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:段晓刚
电话:(0351)8686703
传真:(0351)8686619
客服电话:400-666-1618
联系人:孟博
网址:www.i618.com
24. 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4188号平安国际交易广场4楼
办公地址:深圳市福田区益田路4068号平安国际交易广场4楼
法定代表人:杨宇平
联系人:杨宇平
电话:(0755)22626172
传真:(0755)84240682
客服电话:4008811062
网址:www.pingan.com
25. 中金证券股份有限公司
注册地址:北京市中西城区阜成门内大街2号
办公地址:北京市西城区金融大街19号
法定代表人:陈刚
电话:(010)85130888
传真:(010)85130888
(免长话费)
联系人:王健
电话:(010)85130888
联系人:李博
电话:(010)68665880
联系人:李博
电话:(010)68665880
26. 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街33号
办公地址:北京市西城区金融大街33号
法定代表人:李伟
电话:(010)66568116
客服电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn
27. 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安信大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区深南大道2028号中国凤凰大厦1号楼B座
法定代表人:牛冠兴
联系人:孙爱明
电话:(0755)82558305
客服电话:400-800-1001
网址:www.axsec.com.cn
36. 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市虹口区东大名路336号
办公地址:上海市虹口区东大名路336号
联系人:陈皓
电话:(021)51539888
联系人:陈皓
电话:(021)51539888
37. 齐鲁证券有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
38. 华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中纺中心广场香港中旅大厦4楼
办公地址:深圳市福田区中心区中纺中心广场香港中旅大厦4楼
法定代表人:马瑞波
联系人:潘博
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
网址:www.lhjzq.com
39. 宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯伟
客服电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
40. 浙江证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
电话:(0571)87901963
联系人:潘晓
电话:(0571)87902079
网址:www.ztsec.com
41. 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼至二十六楼
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼至二十六楼

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	000937	冀中能源	26,640,455	623,748,284.25	5.69
2	601601	中国太保	23,722,221	531,140,528.19	4.85
3	600016	民生银行	87,482,600	501,275,298.00	4.57
4	600029	南方航空	58,693,555	460,157,471.20	4.20
5	601318	中国平安	8,434,772	407,146,444.34	3.71
6	600001	浦发银行	22,706,014	387,591,688.98	3.54
7	000000	浦发银行	35,124,697	345,627,018.48	3.15
8	600036	招商银行	22,177,054	288,745,243.08	2.63
9	000792	盐湖股份	4,695,383	277,027,597.00	2.53
10	600009	上海机场	19,922,344	255,006,003.20	2.33

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	000937	冀中能源	26,640,455	623,748,284.25	5.69
2	601601	中国太保	23,722,221	531,140,528.19	4.85
3	600016	民生银行	87,482,600	501,275,298.00	4.57
4	600029	南方航空	58,693,555	460,157,471.20	4.20
5	601318	中国平安	8,434,772	407,146,444.34	3.71
6	000001	浦发银行	22,706,014	387,591,688.98	3.54
7	000000	浦发银行	35,124,697	345,627,018.48	3.15
8	600036	招商银行	22,177,054	288,745,243.08	2.63
9	000792	盐湖股份	4,695,383	277,027,597.00	2.53
10	600009	上海机场	19,922,344	255,006,003.20	2.33

序号	名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	存出保证金	3,112,397.34	
2	应收证券清算款	7,977,864.79	
3	应收股利	11,440,893.18	
4	应收利息	134,242.59	
5	其他应收款	665,299.29	
6	待摊费用	--	
7	其他	--	
8	其他	--	
9	合计	23,330,697.19	

序号	名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	--	--	--
2	--	--	--
3	--	--	--
4	--	--	--
5	--	--	--

序号	名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	存出保证金	3,112,397.34	
2	应收证券清算款	7,977,864.79	
3	应收股利	11,440,893.18	
4	应收利息	134,242.59	
5	其他应收款	665,299.29	
6	待摊费用	--	
7	其他	--	
8	其他	--	
9	合计	23,330,697.19	

(4)报告期末本基金处于转股期的可转换债券。
(5)报告期末,报告期内本基金无权益投资。
(6)报告期内本基金无投资资产支持证券。
(7)报告期内本基金无资产支持证券。
(8)报告期内本基金无资产支持证券。
(9)报告期内本基金无资产支持证券。
(10)报告期内本基金无资产支持证券。
(11)报告期内本基金无资产支持证券。
(12)报告期内本基金无资产支持证券。
(13)报告期内本基金无资产支持证券。
(14)报告期内本基金无资产支持证券。
(15)报告期内本基金无资产支持证券。
(16)报告期内本基金无资产支持证券。
(17)报告期内本基金无资产支持证券。
(18)报告期内本基金无资产支持证券。
(19)报告期内本基金无资产支持证券。
(20)报告期内本基金无资产支持证券。
(21)报告期内本基金无资产支持证券。
(22)报告期内本基金无资产支持证券。
(23)报告期内本基金无资产支持证券。
(24)报告期内本基金无资产支持证券。
(25)报告期内本基金无资产支持证券。
(26)报告期内本基金无资产支持证券。
(27)报告期内本基金无资产支持证券。
(28)报告期内本基金无资产支持证券。
(29)报告期内本基金无资产支持证券。
(30)报告期内本基金无资产支持证券。
(31)报告期内本基金无资产支持证券。
(32)报告期内本基金无资产支持证券。
(33)报告期内本基金无资产支持证券。
(34)报告期内本基金无资产支持证券。
(35)报告期内本基金无资产支持证券。
(36)报告期内本基金无资产支持证券。
(37)报告期内本基金无资产支持证券。
(38)报告期内本基金无资产支持证券。
(39)报告期内本基金无资产支持证券。
(40)报告期内本基金无资产支持证券。
(41)报告期内本基金无资产支持证券。
(42)报告期内本基金无资产支持证券。
(43)报告期内本基金无资产支持证券。
(44)报告期内本基金无资产支持证券。
(45)报告期内本基金无资产支持证券。
(46)报告期内本基金无资产支持证券。
(47)报告期内本基金无资产支持证券。
(48)报告期内本基金无资产支持证券。
(49)报告期内本基金无资产支持证券。
(50)报告期内本基金无资产支持证券。
(51)报告期内本基金无资产支持证券。
(52)报告期内本基金无资产支持证券。
(53)报告期内本基金无资产支持证券。
(54)报告期内本基金无资产支持证券。
(55)报告期内本基金无资产支持证券。
(56)报告期内本基金无资产支持证券。
(57)报告期内本基金无资产支持证券。
(58)报告期内本基金无资产支持证券。
(59)报告期内本基金无资产支持证券。
(60)报告期内本基金无资产支持证券。
(61)报告期内本基金无资产支持证券。
(62)报告期内本基金无资产支持证券。
(63)报告期内本基金无资产支持证券。
(64)报告期内本基金无资产支持证券。
(65)报告期内本基金无资产支持证券。
(66)报告期内本基金无资产支持证券。
(67)报告期内本基金无资产支持证券。
(68)报告期内本基金无资产支持证券。
(69)报告期内本基金无资产支持证券。
(70)报告期内本基金无资产支持证券。
(71)报告期内本基金无资产支持证券。
(72)报告期内本基金无资产支持证券。
(73)报告期内本基金无资产支持证券。
(74)报告期内本基金无资产支持证券。
(75)报告期内本基金无资产支持证券。
(76)报告期内本基金无资产支持证券。
(77)报告期内本基金无资产支持证券。
(78)报告期内本基金无资产支持证券。
(79)报告期内本基金无资产支持证券。
(80)报告期内本基金无资产支持证券。
(81)报告期内本基金无资产支持证券。
(82)报告期内本基金无资产支持证券。
(83)报告期内本基金无资产支持证券。
(84)报告期内本基金无资产支持证券。
(85)报告期内本基金无资产支持证券。
(86)报告期内本基金无资产支持证券。
(87)报告期内本基金无资产支持证券。
(88)报告期内本基金无资产支持证券。
(89)报告期内本基金无资产支持证券。
(90)报告期内本基金无资产支持证券。
(91)报告期内本基金无资产支持证券。
(92)报告期内本基金无资产支持证券。
(93)报告期内本基金无资产支持证券。
(94)报告期内本基金无资产支持证券。
(95)报告期内本基金无资产支持证券。
(96)报告期内本基金无资产支持证券。
(97)报告期内本基金无资产支持证券。
(98)报告期内本基金无资产支持证券。
(99)报告期内本基金无资产支持证券。
(100)报告期内本基金无资产支持证券。
(101)报告期内本基金无资产支持证券。
(102)报告期内本基金无资产支持证券。
(103)报告期内本基金无资产支持证券。
(104)报告期内本基金无资产支持证券。
(105)报告期内本基金无资产支持证券。
(106)报告期内本基金无资产支持证券。
(107)报告期内本基金无资产支持证券。
(108)报告期内本基金无资产支持证券。
(109)报告期内本基金无资产支持证券。
(110)报告期内本基金无资产支持证券。
(111)报告期内本基金无资产支持证券。
(112)报告期内本基金无资产支持证券。
(113)报告期内本基金无资产支持证券。
(114)报告期内本基金无资产支持证券。
(115)报告期内本基金无资产支持证券。
(116)报告期内本基金无资产支持证券。
(117)报告期内本基金无资产支持证券。
(118)报告期内本基金无资产支持证券。
(119)报告期内本基金无资产支持证券。<