

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金  
2011 年度 报告摘要

## 三度 报告摘要

8.4.1 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计计入金额	占本期非公开发行净资产比例(%)
1	600050	中国联通	25,426,759.88	19.41
2	600036	招商银行	17,242,272.19	15.80
3	600575	中航电气	18,091,447.03	14.86
4	600018	北汽股份	19,008,433.58	13.97
5	600118	中国平安	15,535,031.49	13.66
6	600033	长江电力	15,366,726.54	12.79
7	601299	工商银行	14,883,544.51	12.23
8	300027	华谊兄弟	13,466,783.58	11.80
9	300070	联华香	13,855,714.00	11.38
10	000803	一汽轿车	13,298,417.49	11.09
11	601166	兴业银行	13,346,149.55	10.94
12	600030	中信证券	12,710,038.02	10.06
13	600098	云天化	11,386,423.03	9.35
14	000792	双林股份	11,328,639.37	9.30
15	600626	新世界	11,111,747.63	9.13
16	600031	宏业股份	10,616,292.38	8.72
17	600028	中国石化	9,920,567.66	8.15
18	601668	招商局	9,778,728.71	8.03
19	600529	南方航空	9,768,297.88	8.02
20	600441	兴发集团	9,760,295.46	8.02
21	002477	德棉股份	9,179,692.71	7.98
22	601089	中信特钢	9,114,914.80	7.49
23	600187	中国广核	8,990,888.36	7.36
24	600597	宁波银行	8,673,189.53	7.12
25	500010	国联证券	8,552,563.38	7.01
26	601068	华海药业	8,487,456.88	6.97
27	300159	新研股份	8,249,280.00	6.78
28	601186	中国铁建	8,109,177.33	6.66
29	002178	中航光电	8,087,698.52	6.58
30	002215	普鲁宝	7,956,235.95	6.51
31	000630	铜陵有色	7,892,841.59	6.48
32	000513	华夏银行	7,862,952.39	6.46
33	300529	华康药业	7,760,278.78	6.37
34	600562	江西铜业	7,742,458.06	6.36
35	601199	中国重工	7,660,141.40	6.32
36	601018	中国化学	7,297,302.84	5.97
37	000712	广生堂	7,129,352.88	5.91

[illegible]

成都工业投资集团有限公司 基金管理人/大股东

中国对外经济贸易信托有限公司 基金管理人/大股东

注：工业投资集团和信托公司均于2019年12月31日通过一致行动人协议一致行动。

7.4.8.2 报告期内，上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.2.1 借款及关联方担保

本基金的借款及上年度可比期间未通过关联方进行交易。

7.4.8.2.2 关联方担保

7.4.8.2.3 基金管理人

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,493,833.39	2,275,183.86
其中：支付给基金管理人的固定管理费	217,144.00	234,094.95

其支付的管理费与基金管理人收取的基金管理费一致。本基金管理人收取的管理费按照基金资产净值的0.5%计提，计提日为每月月末，计提基数为1日基金资产净值。一日基金资产净值1.5%，每季计提。

单位：人民币元				
项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日		
当发生关联方交易时支付的现金	246,472.22	179,107.34		
注：上述关联方支付中国银行股份有限公司的基本贷款利息按照一日基准利率上浮25%的年利率计算，且自支付之日起每月支付，到期支付，并随本金一并予以结息支付。前一日基准利率为人民币贷款基准利率4.75%。				
7.4.8.1.1 关联方支付进行银行间市场的债券回购	2,054,470.00	0.00		
本期发生额	2,054,470.00	0.00		
上期发生额	0.00	0.00		
7.4.8.1.2 关联方支付资金拆借	0.00	0.00		
本期发生额	0.00	0.00		
上期发生额	0.00	0.00		
7.4.8.1.3 关联方支付基金管理人运用固有资金投资本基金的成本	0.00	0.00		
本期发生额	0.00	0.00		
上期发生额	0.00	0.00		
7.4.8.1.4 关联方支付基金管理人运用固有资金投资其他基金的成本	0.00	0.00		
本期发生额	0.00	0.00		
上期发生额	0.00	0.00		
7.4.8.1.5 关联方支付基金管理人运用固有资金支付其他基金的费用	0.00	0.00		
本期发生额	0.00	0.00		
上期发生额	0.00	0.00		
7.4.8.1.6 关联方支付保管的银行存款余额及当期产生的利息收入	0.00	0.00		
本期	0.00	0.00		
上期	0.00	0.00		
关联方名称	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日		
	期末余额	当期收入	期末余额	当期收入
中国银行	23,263,241.63	121,121.92	2,122,145.78	147,485.18
注：本报告期内不存在由关联方提供支付担保的情况，不存在担保利息支付。				
7.4.8.1.8 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.9 关联方支付其他资产与关联方承购或出售与关联方承购的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.10 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.11 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.12 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.13 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.14 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.15 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.16 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.17 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.18 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.19 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.20 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.21 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.22 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.23 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.24 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.25 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.26 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.27 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.28 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.29 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.30 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.31 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.32 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.33 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.34 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.35 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.36 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.37 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.38 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.39 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.40 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.41 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.42 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.43 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.44 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.45 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.46 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.47 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.48 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.49 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.50 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.51 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.52 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.53 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.54 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.55 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.56 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.57 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.58 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.59 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.60 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.61 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.62 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.63 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.64 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.65 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.66 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.67 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.68 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.69 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.70 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.71 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.72 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.73 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.74 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.75 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.76 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.77 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.78 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.79 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.80 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.81 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.82 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.83 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.84 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.85 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.86 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.87 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.88 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.89 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.90 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.91 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.92 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.93 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.94 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.95 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.96 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.97 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.98 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.1.99 关联方支付其他资产与关联方承购或出售的证券				
本期发生额		0.00		
上期发生额		0.00		
7.4.8.2 关联方提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.4.9 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.5 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.6 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.7 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.8 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.9 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.10 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.11 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.12 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.13 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.14 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.15 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.16 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.17 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.18 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.19 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.20 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.21 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.22 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.23 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.24 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.25 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.26 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.27 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.28 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.29 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.30 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.31 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.32 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.33 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.34 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.35 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.36 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.37 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.38 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.39 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.40 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.41 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.42 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.43 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.44 关联方为基金提供支付担保				
本期		0.00		
上期		0.00		
7.45 关联方为基金提供支付担保				

[illegible]

除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§8 投资组合报告**

**8.1 期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额	金额单位:人民币元 占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	34,613,760.00	45.37
	其中:股票	34,613,760.00	45.37
2	固定收益投资	13,319,950.00	17.45
	其中:债券	13,319,950.00	17.45
	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:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	24,227,169.52	31.74
6	其他各项资产	4,147,569.68	5.43
7	合计	76,328,449.20	100.00

**8.2 期末按行业分类的股票投资组合**

金额单位:人民币元

38	600019	海螺水泥	7,013,000.08	5.76
39	300022	吉峰农机	6,571,907.94	5.40
40	000089	烟台万华	6,504,385.57	5.34
41	601766	中国铝业	6,463,767.80	5.31
42	000911	南宁糖业	6,456,330.33	5.30
43	000423	青岛双胶	6,395,499.32	5.25
44	601111	中国国旅	6,251,606.15	5.13
45	000187	永清环保	6,143,702.80	5.05
46	002258	金士顿通	6,072,386.99	4.99
48	000905	厦门水务	6,017,946.71	4.94
49	600048	保利水务	5,803,010.92	4.77
50	000720	保利地产	5,685,385.32	4.68
51	000708	兴普电气	5,664,554.54	4.65
52	300035	中科电气	5,588,177.50	4.59
53	600116	洪兴集团	5,475,473.99	4.50
54	000763	长江证券	5,346,466.79	4.39
55	300044	振源股份	5,320,796.23	4.37
56	601717	国投机械	5,320,124.76	4.37
57	002880	康缘药业	5,311,851.17	4.36
58	000938	云南白药	5,307,972.00	4.36
59	604045	西南石油	5,290,025.87	4.34
60	000807	美盛股份	5,194,913.30	4.24
61	000858	广 韵 油	5,044,798.24	4.17
62	600666	宇通客车	4,981,421.11	4.09

63	601179	中国医药	4,921,672.40	4.04
64	002678	顺络电子	4,913,085.80	4.04
65	601158	美敦医疗	4,902,935.72	4.02
66	000017	石油济柴	4,839,925.70	3.98
67	601628	中国人寿	4,760,409.02	3.91
68	000564	天康牧业	4,690,976.30	3.85
69	600198	大唐电信	4,664,530.39	3.83
70	600050	金龙汽车	4,660,977.79	3.78
71	600118	中国卫星	4,567,019.77	3.75
72	000758	中色股份	4,509,245.62	3.70
73	601668	中国铁建	4,461,306.70	3.66
74	601661	中国建筑	4,367,782.74	3.59
75	002285	世联地产	4,312,400.35	3.54
76	700053	周大生	4,290,625.67	3.50
77	000202	苏宁电器	4,077,141.95	3.33
78	002645	海康威视	4,043,028.22	3.32
79	600419	贵州茅台	3,986,024.01	3.26
81	002097	山河智能	3,886,679.63	3.19
82	601168	西南铝业	3,471,121.59	3.15
83	300228	富临精工	3,435,836.48	3.14
84	000060	中金岭南	3,717,765.34	3.05
85	600583	海油工程	3,642,565.00	2.99

86	000428	中国远洋	3,580,019.84	2.94
87	000403	中国铝业	3,557,951.20	2.92
88	600717	中航工业	3,557,461.54	2.92
89	600118	江淮汽车	3,527,995.01	2.90
90	000625	长安汽车	3,520,370.07	2.89
91	000623	攀钢钒钛	3,477,613.64	2.86
92	000684	烟台冰厂	3,379,203.80	2.78
93	000913	神火股份	3,341,062.41	2.74
94	000954	泰山石油	3,272,388.11	2.69
95	600075	新疆八一	3,234,028.96	2.66
96	601106	中国一重	3,206,023.15	2.63
97	300215	华锐钛	3,099,607.20	2.55
98	002583	南都电源	3,069,562.40	2.52
99	300134	大富科技	3,031,584.14	2.52
100	600970	中国彩印	2,903,828.59	2.39
101	600186	大冶特钢	2,891,484.49	2.38
102	002313	海海国防	2,851,941.59	2.34
103	000108	中国南华	2,846,684.84	2.34
104	300178	双林股份	2,816,035.25	2.30
105	600070	寿星堂	2,706,217.30	2.22
106	600425	华信国际	2,694,190.83	2.19
107	600523	鲁商股份	2,606,354.00	2.14
108	002436	兴齐药业	2,574,576.40	2.11
109	300030	超图软件	2,492,533.02	2.05
110	600031	三一重工	2,488,870.77	2.02

基金资产净值及基金份额净值					
					金额(人民币元)
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末总资产净值比例 (%)	占期末基金份额净值比例 (%)
1	600050	中国联通	20,179,279.01	23.97	
2	600036	招商银行	18,800,357.00	15.44	
3	600085	东方电力	17,463,357.06	14.34	
4	600118	中国神华	17,161,641.20	14.10	
5	600018	上汽集团	16,361,293.06	12.62	
6	300027	华谊兄弟	14,714,611.33	12.09	
7	601299	中信银行	14,425,060.13	11.85	
8	000800	一汽轿车	13,826,048.90	11.36	
9	600038	哈飞股份	13,438,615.64	11.04	
10	300070	碧水源	13,411,815.32	11.02	
11	601166	兴业银行	12,931,998.53	10.62	
12	600030	中信证券	12,396,219.27	10.18	
13	600628	新世界	11,380,784.67	9.35	
14	600087	中国绿岛	11,055,483.89	9.08	
15	600019	宝钢股份	10,223,873.75	8.40	
16	600028	中国石化	10,020,446.59	8.23	
17	601169	北京银行	9,703,825.07	7.97	
18	600029	南方航空	9,287,110.14	7.63	

19	601117	中国化学	9,230,000.67	7.58
20	601158	重庆水务	8,795,152.68	7.22
21	601009	南京银行	8,603,309.37	7.07
22	601060	国际电力	8,580,736.31	7.05
23	601088	中国铁建	8,380,337.82	6.89
24	300159	新研股份	8,314,360.91	6.83
25	601186	中国铁建	8,272,280.76	6.79
26	002087	山河智能	7,676,151.85	6.30
27	600141	兴发集团	7,667,117.84	6.30
28	600531	宏达股份	7,628,697.95	6.27
29	002185	京东方A	7,607,991.83	6.25
30	000792	盐湖股份	7,588,430.99	6.23
31	000630	铜陵有色	7,585,235.77	6.23
32	600479	千金药业	7,464,030.83	6.13
33	600597	光明乳业	7,415,895.20	6.09
34	002477	德棉股份	7,283,226.26	5.98
35	600662	江西铜业	7,254,988.18	5.96
36	600617	天津港	7,171,350.82	5.89
37	601018	中国海能	7,170,705.88	5.89
38	600009	烟台万华	7,105,921.08	5.84
39	300029	天龙光电	7,092,797.08	5.83
40	002179	中航光电	7,072,147.29	5.81

41	601766	中国南车	6,922,935.21	5.69
42	600066	云天化	6,351,572.48	5.22
43	600108	海螺集团	6,301,217.42	5.18
44	600519	贵州茅台	6,262,597.74	5.14
45	300022	吉峰农机	6,187,538.22	5.08
46	601111	中国国航	6,097,972.31	5.01
47	600195	中牧股份	6,073,114.79	4.99
48	002268	卫 士 通	5,978,010.83	4.91
49	601078	东方动力	5,963,897.27	4.90
50	000598	兴农投资	5,909,425.03	4.85
51	000905	鹏南多	5,785,203.90	4.75
52	000583	海油工程	5,760,210.79	4.73
53	600000	浦发银行	5,686,896.75	4.67
54	300316	洪都航空	5,634,307.22	4.63
55	601006	大秦铁路	5,522,839.12	4.54
56	000911	南宁糖业	5,495,210.49	4.51
57	000048	保利地产	5,460,758.80	4.49
58	601717	海螺煤机	5,459,372.47	4.48
59	000066	宇通客车	5,436,194.30	4.47
60	002589	瑞康医药	5,365,701.97	4.41
61	604085	晋西车轴	5,302,332.12	4.36
62	000423	泰阿阿牧	5,248,429.16	4.31
63	000807	云南股份	5,223,899.86	4.29
64	000538	云南白药	5,199,251.39	4.27
65	600858	五 粮 液	5,139,472.25	4.22
66	300187	永源环保	5,096,925.70	4.19
67	000783	江舒重工	5,091,079.04	4.18
68	300025	中电电气	5,007,665.08	4.11
69	001428	中国人寿	4,985,095.50	4.09
70	600616	金枫酒业	4,843,799.28	3.98
71	601401	中国太保	4,814,073.58	3.95
72	000617	石油济柴	4,797,226.86	3.94
73	001989	中国重工	4,766,604.26	3.92
74	002215	捷 普 信	4,749,800.76	3.90
75	600550	天威保变	4,701,015.67	3.86
76	000276	创源动力	4,637,408.74	3.81
77	000758	中色股份	4,535,255.61	3.73
78	000686	金矿汽车	4,533,179.43	3.72
79	601918	大唐电信	4,510,718.52	3.70
80	300053	欧比特	4,449,328.18	3.65
81	300044	魔方智能	4,245,511.20	3.49
82	002032	裕龙管	4,116,355.88	3.38
83	601668	中国建筑	4,070,000.00	3.24
84	000629	攀钢钒钛	3,861,192.66	3.17
85	002345	潮 衣 鞋	3,826,124.86	3.14
86	000951	中国重汽	3,778,265.59	3.10
87	002285	世联地产	3,743,308.44	3.07
88	601168	招商局港	3,721,404.00	3.06
89	600418	江淮汽车	3,664,040.00	3.01
90	300228	富锦特纸	3,619,857.72	2.97
91	000625	长安汽车	3,587,995.52	2.95
92	600428	中航光电	3,500,050.95	2.87
93	600825	新华传媒	3,480,090.85	2.86
94	300084	海康科技	3,479,140.66	2.86
95	000953	神火股份	3,450,753.15	2.83
96	600118	中国卫宁	3,444,385.91	2.83
97	002283	海能达	3,304,941.71	2.71
98	000554	泰山石油	3,275,981.84	2.69
99	600990	四国电子	3,218,801.72	2.64
100	600737	中航电测	3,193,647.50	2.62
101	000880	山推股份	3,183,217.80	2.61
102	600270	外运发展	3,182,735.74	2.61
103	601106	中国一重	3,128,686.80	2.57
104	600075	新疆天华	3,044,277.07	2.50
105	601088	中国神华	2,817,872.65	2.31
106	600970	中材国际	2,811,591.28	2.31
107	600425	青松超纤	2,735,683.33	2.25
108	600995	文山电力	2,621,318.00	2.15
109	002465	海格通信	2,585,524.26	2.12
110	300036	超思软件	2,539,901.08	2.09
111	300186	大华农	2,534,083.30	2.08
112	300134	大富科技	2,505,232.29	2.06
113	300215	电利院	2,503,055.52	2.06
114	002313	日海通讯	2,471,413.58	2.03
115	600031	三一重工	2,452,961.23	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本 成交 总额	800,123,906.87
卖出股票的收入 成交 总额	820,549,259.49

注：买入股票成本 成交 总额、卖出股票收入 成交 总额，均按买入成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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 (6)
1	国家债券	13,319,950.00	17.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	13,319,950.00	17.77

				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	040023	02国债03	133,000	13,319,950.00	17.77
8.7期末按公允价值计量的基金资产净值前十大持仓的前十名资产支持证券投资明细					
本基金未持有资产支持证券投资。					
8.8期末按公允价值计量的基金资产净值前十大持仓的前五名权证投资明细					
本基金未持有股票期权和权证投资。					
8.9报告期末前十名资产支持证券的投资情况					
8.9.1报告期内本基金所持有的前十名资产支持证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、处罚的情况					
8.9.2 本基金所投资的资产支持证券没有超出基金合同约定的备选投资库。					
8.9.3 期末其他各项资产的构成					
序号	名称			金额	
1	存出保证金			750,000.00	
2	应收证券清算款			3,147,656.51	
3	应收股利			—	
4	应收利息			243,460.69	
5	应收申购款			6,452.48	
6	其他应收款			—	
7	待摊费用			—	
8	其他			—	
9	合计			4,147,569.68	

[illegible]

§10 开放式基金净值变动		单位:元
基金合同生效日 2009年3月17日 基金净值总额		776,687,900.16
本报告期初基金净值总额		128,406,396.71
本报告期基金申购份额		7,963,088.79
减:本报告期基金赎回份额		29,088,086.06
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期末基金净值总额		107,281,399.44

[illegible]

券商名称	交易单元数	股票交易		应支付券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额	佣金	占当期佣金总量
长城证券	1	197,882,776.17	12.21%	168,200.00	12.41%
渤海证券	1	45,779,390.02	2.82%	37,195.78	2.74%
兴亚证券	1	278,951,068.56	17.21%	226,640.45	16.72%
中金公司	1	659,952,926.46	40.70%	560,651.56	41.36%
安信证券	1	172,445,553.15	10.64%	146,576.45	10.81%
瑞银证券	1	266,021,533.00	16.49%	216,143.76	15.95%

1.7.2 基金租用证券公司交易单元进行融资融券的情况					单位:人民币元	
券商名称	债券交易		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
长城证券	7,195,239.80	41.81%	-	-	-	-
海南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华安公司	10,013,172.30	58.19%	100,000,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-