

**【上海 D30 版】**  
 8) 中央企业按照国务院规定履行出资人职责的监管机构,承担一线风险监控职责。  
 9) 国资委按照《中央企业全面风险管理指引》,指导中央企业建立健全风险管理机制,并提供基金治理进行组合调整参考。  
 10) 国资委按照《中央企业全面风险管理指引》,指导中央企业建立健全风险管理机制,并提供基金治理进行组合调整参考。  
 11) 国资委按照《中央企业全面风险管理指引》,指导中央企业建立健全风险管理机制,并提供基金治理进行组合调整参考。

**十一、基金的业绩比较基准**  
 本基金以沪深 300 指数为标的指数。  
 本基金业绩比较基准为 95% × 沪深 300 指数 + 5% × 银行间存款利率。  
 如果沪深 300 指数停止编制发布,或沪深 300 指数供应商终止授权本基金使用其作为标的指数,或沪深 300 指数供应商发生重大事件威胁到其提供和授权沪深 300 指数的能力,或由于证券市场发生重大变化导致本基金业绩比较基准不再适用,基金管理人有权变更标的指数,或变更标的指数的权重和比较基准,并在变更前至少提前 10 个工作日在指定媒体上公告。  
 中证 500 指数由中证指数有限公司编制和计算。关于该指数和成分股名单的所有权利归属中证指数有限公司。

**十二、基金的投资组合报告**  
 本基金管理人的董事会及高级管理人员根据基金合同规定,于 2012 年 7 月 17 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。  
 本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,也不保证基金份额净值不出现波动及其其他类似表述。投资者有风险,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。  
 本投资组合报告所载数据截至 2012 年 6 月 30 日,本报告财务资料未经审计。

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	812,005,175.05	94.37
	其中:股票	812,005,175.05	94.37
2	固定收益投资	1,176,588.00	0.14
	其中:债券	1,176,588.00	0.14
3	货币资金	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	45,610,110.20	5.30
6	其他资产	1,614,918.76	0.19
7	合计	860,406,792.01	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

1) 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、渔业	-	-
B	采掘业	22,553,108.30	2.63
C	制造业	17,500,660.70	2.04
CD	食品饮料	17,017,937.60	1.98
CE	纺织服装、皮毛	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	106,335.00	0.01
C8	医药、生物制品	376,388.10	0.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,232,000.00	0.26
H	批发和零售贸易	53,678,889.16	6.26
I	金融、保险业	78,469,017.74	9.15
J	房地产业	8,880,597.00	1.04
K	社会服务业	15,490,711.60	1.81
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
N	合计	198,804,984.50	23.17

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、渔业	3,921,286.54	0.46
B	采掘业	61,546,901.93	7.17
C	制造业	215,183,488.53	25.08
CD	食品饮料	44,763,912.18	5.22
CE	纺织服装、皮毛	2,412,683.58	0.28
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,767,411.89	1.60
C5	电子	11,830,216.21	1.38
C6	金属、非金属	47,699,837.62	5.56
C7	机械、设备、仪表	85,364,921.31	7.62
C8	医药、生物制品	29,156,610.28	3.40
C99	其他制造业	187,895.46	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,219,330.64	1.89
E	建筑业	20,723,364.45	2.42
F	交通运输、仓储业	18,697,314.30	2.11
G	信息技术业	17,378,836.32	2.03
H	批发和零售贸易	16,881,999.51	1.97
I	金融、保险业	193,307,419.19	22.53
J	房地产业	33,264,955.61	3.88
K	社会服务业	5,179,043.61	0.60
L	传播与文化产业	2,212,097.17	0.26
M	综合类	9,313,971.55	1.09
N	合计	613,200,190.55	71.48

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资与指数投资的前五名股票投资组合

4) 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组合

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	601318	中国平安	419,443	19,185,322.82	2.24
2	600016	民生银行	3,121,253	18,696,305.47	2.18
3	600036	招商银行	4,029,129	17,699,013.88	2.06
4	601328	交通银行	3,049,121	13,843,009.34	1.61
5	601166	兴业银行	1,006,479	13,064,097.42	1.52
6	600519	贵州茅台	50,805	12,150,015.75	1.42
7	600000	浦发银行	1,470,999	11,959,221.87	1.39
8	600003	中信证券	858,386	10,841,415.18	1.26
9	000002	万科 A	1,201,746	10,707,556.86	1.25
10	600837	海康证券	1,002,915	9,658,071.45	1.13

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股票投资组合

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	600778	友好集团	4,467,135	50,210,597.40	5.85
2	600036	招商银行	1,759,650	19,215,378.00	2.24
3	300070	碧水源	518,084	15,490,711.60	1.81
4	002385	大北农	699,904	13,578,137.60	1.58
5	600000	浦发银行	1,500,000	12,195,000.00	1.42

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

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
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组合  
 本基金本报告期末未持有权证。  
 8) 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股指期货投资组合  
 本基金本报告期末未持有股指期货。  
 9) 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国债期货投资组合  
 本基金本报告期末未持有国债期货。  
 10) 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贵金属投资组合  
 本基金本报告期末未持有贵金属。  
 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五名大宗商品投资组合  
 本基金本报告期末未持有大宗商品。  
 12) 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其他资产投资组合  
 本基金本报告期末未持有其他资产。

13) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

14) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

15) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

16) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

17) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

18) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

19) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

20) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

21) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

22) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

23) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

24) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

25) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

26) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

27) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

28) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

29) 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股票投资组合

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	113003	重工转债	11,270	1,176,588.00	0.14
2	-				