



博时宏观回报债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31日

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月18日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告中所载资料未构成任何投资建议,投资者在作出投资决策前应咨询其投资顾问。

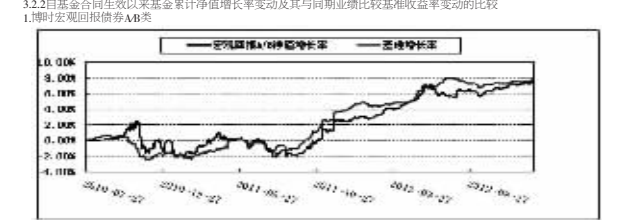
本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	博时宏观回报债券
基金代码	000016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月27日
报告期内基金份额总额	189,232,551.52份
投资目标	通过一定范围内固定收益类与权益类资产,以及不同久期固定收益类资产的风配置,获取长期稳定增值,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合,自上而下分析为宏观、中观分析,自下而上分析为个股分析等各种分析有效结合的方法进行大类资产配置,在确定基金资产在固定收益类资产(债券、货币、可转债、结构化权益类资产)权重之间的大体配置后,再确定不同期限债券的配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险高于货币型基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险收益的产品。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属同属基金的基金简称	博时宏观回报债券A类
下属同属基金的交易代码	000016 (前) 051016 (后)
报告期内下属同属基金的份额总额	103,678,096.89份

§3主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 2012年10月1日-2012年12月31日	博时宏观回报债券A类
1.本期已实现收益	1,519,387.39	1,227,458.45
2.本期利润	1,469,915.39	1,288,629.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0136	0.0132
4.期末基金资产净值	111,061,099.38	91,103,099.38
5.期末基金份额净值	1.071	1.062
6.期末基金份额持有人户数	10,000	10,000
7.期末基金份额持有人平均持有基金份额	11,106.11	9,110.31
8.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
9.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
10.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
11.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
12.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
13.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
14.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
15.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
16.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
17.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
18.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
19.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
20.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
21.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
22.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
23.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
24.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
25.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
26.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
27.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
28.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
29.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
30.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
31.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
32.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
33.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
34.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
35.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
36.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
37.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
38.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
39.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
40.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
41.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
42.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
43.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
44.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
45.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
46.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
47.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
48.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
49.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
50.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
51.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
52.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
53.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
54.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
55.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
56.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
57.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
58.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
59.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
60.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
61.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
62.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
63.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
64.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
65.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
66.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
67.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
68.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
69.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
70.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
71.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
72.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
73.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
74.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
75.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
76.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
77.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
78.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
79.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
80.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
81.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
82.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
83.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
84.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
85.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
86.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
87.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
88.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
89.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
90.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
91.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
92.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
93.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
94.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
95.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
96.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
97.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
98.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
99.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
100.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%



姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
戴成	基金经理	2010-7-27	-	7.5	2005年加入博时基金管理有限公司,担任固定收益部基金经理职务。2010年7月加入博时宏观回报债券基金,担任基金经理职务。2011年加入博时宏观回报债券基金,担任基金经理职务。2012年加入博时宏观回报债券基金,担任基金经理职务。

4.2报告期内本基金运作合规性情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规,严格执行了基金合同,没有出现任何违法违规行为,也没有损害基金份额持有人的利益。

4.3公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.4关联交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理人关联交易制度》和公司制定的关联交易相关制度。

4.5报告期内本基金管理人不存在任何违法违规行为,也没有损害基金份额持有人的利益。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	14,734,500.00	4.63
2	固定收益投资	286,237,222.60	89.89
3	其中:债券	286,237,222.60	89.89
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	6,431,400.28	2.02
9	其中:应收利息和应收股利	11,000,852.23	3.46
10	其他资产	318,413,975.70	100.00

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月18日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告中所载资料未构成任何投资建议,投资者在作出投资决策前应咨询其投资顾问。

本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金名称	博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	050013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月29日
报告期内基金份额总额	1,211,208,836.12份
投资目标	通过投资于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,实现长期资本增值,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。
业绩比较基准	上证超级大盘指数(价格净值)
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型基金,其风险收益特征与标的指数的特征相类似,其风险收益特征与标的指数的特征相类似。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属同属基金的基金简称	博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金
下属同属基金的交易代码	050013
报告期内下属同属基金的份额总额	1,211,208,836.12份

§3主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 2012年10月1日-2012年12月31日	博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金
1.本期已实现收益	1,519,387.39	1,227,458.45
2.本期利润	1,469,915.39	1,288,629.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0136	0.0132
4.期末基金资产净值	111,061,099.38	91,103,099.38
5.期末基金份额净值	1.071	1.062
6.期末基金份额持有人户数	10,000	10,000
7.期末基金份额持有人平均持有基金份额	11,106.11	9,110.31
8.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
9.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
10.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
11.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
12.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
13.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
14.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
15.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
16.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
17.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
18.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
19.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
20.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
21.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
22.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
23.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
24.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
25.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
26.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
27.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
28.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
29.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
30.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
31.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
32.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
33.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
34.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
35.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
36.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
37.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
38.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
39.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
40.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
41.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
42.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
43.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
44.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
45.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
46.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
47.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
48.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
49.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
50.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
51.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
52.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
53.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
54.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
55.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
56.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
57.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
58.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
59.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
60.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
61.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
62.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
63.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
64.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
65.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
66.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
67.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
68.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
69.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
70.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
71.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
72.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
73.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
74.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
75.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
76.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
77.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
78.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
79.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
80.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
81.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
82.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
83.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
84.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
85.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
86.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
87.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
88.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
89.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
90.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
91.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
92.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
93.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
94.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
95.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
96.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
97.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
98.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
99.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%
100.期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	10.00%	10.00%

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金净值增长率不包括任何交易基金的各类费用,计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数据。

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	采矿业	973,700.00	0.48
C	制造业	5,123,100.00	2.53
CO	食品饮料	999,700.00	0.47
C1	纺织服装、皮毛	997,200.00	0.49
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	2,156,600.00	1.07
C8	医药、生物制品	1,009,600.00	0.50
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,137,000.00	1.06
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	3,450,500.00	1.71
G	信息技术业	984,200.00	0.49
H	金融、保险业	-	-
I	房地产业	1,070,000.00	0.53
J	其他服务业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	996,000.00	0.49
N	合计	14,734,500.00	7.29

5.3 报告期末基金资产组合公允价值(中国境内A股市场持仓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	601006	大秦铁路	200,000	1,352,000.00	0.67
2	000539	粤电力A	200,000	1,184,000.00	0.59
3	603016	洪都航空	80,000	1,097,600.00	0.54
4	600125	铁龙物流	150,000	1,078,500.00	0.53
5	601628	中国人寿	100,000	1,070,000.00	0.53
6	600031	三一重工	50,000	1,059,000.00	0.52
7	601111	中国国航	170,000	1,020,000.00	0.50
8	600195	中牧股份	80,000	1,009,600.00	0.50
9	601339	百隆东方	120,000	997,200.00	0.49
10	600445	小商品城	150,000	996,000.00	0.49