

2010年 6 月 30 日

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	323,591,478.49	3.39

1	601166	兴业银行	223,501,478.49	2.29
2	600050	中国联通	182,029,209.94	1.87

1	601166	兴业银行	223,301,478.49	2.29
2	600050	中国联通	182,029,209.94	1.87
3	021024	苏宁电器	170,270,153.23	1.75
4	601601	中国太保	137,924,015.92	1.41
5	000625	长安汽车	133,947,289.75	1.37
6	000988	蓝星清洗	132,435,607.15	1.36
7	000651	格力电器	125,375,212.25	1.29
8	000718	苏宁环球	117,648,736.60	1.21
9	600271	航天信息	116,109,764.44	1.19
10	600036	招商局	112,466,683.79	1.15
11	002022	科伦药业	107,484,134.46	1.10
12	000851	威孚高科	104,197,007.64	1.07
13	600016	民生银行	100,959,306.84	1.04
14	000038	神华动力	99,088,223.71	1.02
15	600519	贵州茅台	94,034,179.40	0.96
16	600138	中国平安	93,557,112.80	0.96
17	600115	东方航空	89,801,162.27	0.92
18	000858	五粮液	89,299,140.96	0.92
19	000063	中兴通讯	88,948,632.80	0.91
20	020405	广州国光	84,579,604.58	0.87

2. 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币万元				
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	320,852,866.18	3.29
2	000625	长安汽车	289,153,749.24	2.96
3	000063	中兴通讯	261,237,026.28	2.68
4	601166	兴业银行	218,527,958.96	2.24

6	601088	中国神华	164,089,434.11	1.68
7	000898	鞍钢股份	164,045,037.51	1.68
8	601318	中国平安	134,402,446.85	1.38
9	600104	上汽汽车	133,764,665.18	1.37
10	601998	中信银行	116,599,324.72	1.20
11	002024	苏宁电器	99,345,076.01	1.02
12	600476	华鲁恒升	99,043,540.73	1.02

13	000024	招商地产	96,600,779.58	0.99
14	000338	潍柴动力	95,222,879.37	0.98
15	600115	东方航空	92,733,800.85	0.95
16	600030	中信证券	90,122,784.57	0.92
17	000778	新兴铸管	84,973,449.72	0.87

19	002106	莱宝高科	79,489,536.21	0.81
----	--------	------	---------------	------

本期累计支出金额"按卖出成交金额 成交单价乘以成交数量 孰低"原则,不考虑相关交易费用。	85,954,530.17	0.61	
3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额			
单位:人民币元			
买入股票成本 成交总额	4,633,397,159.80		
卖出股票收入 成交总额	5,027,858,083.84		
买入股票成本"成交总额"和"卖出股票收入"按买卖成交金额 成交单价乘以成交数量 孰低"原则,不考虑交易费用。			
期末按债券品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

1	国家债券	198,060,000.00	2.70
2	央行票据	264,061,000.00	3.60
3	金融债券	-	-

4	其中:政策类金融债		-	-
5	企业债券		-	-
6	企业短期融资券		-	-
7	可转债	60,134,809.80		0.82
8	其他	-		-
9	合计	522,255,809.80		7.11

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	020300	10国债 04	2,000,000	198,060,000.00	2.70
2	1201015	12中票 35	2,000,000	195,580,000.00	2.66

金额单位:人民币元

3	1001025	10天票25	700,000	68,481,000.00	0.93
4	113001	中行转债	594,570	60,134,809.80	0.82

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

1.申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

基金本报告期内投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的。

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,996,041.12

3	应收股利	31,540.50
4	应收利息	1,324,737.42
5	应收由股款	360,476.50

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	16,196,492.02
---	----	---------------

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	001318	中国平安	220,236,201.93	3.08	筹划重大事项
2	000001	深发展 A	210,527,247.58	2.87	筹划重大事项
3	600703	三安光电	196,330,000.00	2.67	非公开发行股票

四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

持有人名称	户均持有的 基金份额数量	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

	基金份额	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
505043	20,121.26	168,744,142.67	1.66	9,993,356,166.19	98.34

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	781,996.44	0.0077

§9 开放式基金份额变动		单位:份
基金合同生效日 2007 年 04 月 27 日	基金份额总额	500,000,000.00

本报告期基金总申购份额	47,687,997.43
减:本报告期基金总赎回份额	580,819,711.69

本报告期末基金份额总额	10,162,100,308.86
-------------	-------------------

§10 重大事件揭示

1.基金份额持有人大会决议

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

4基金投资策略的改变
报告期本基金投资策略无改变。

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

金额单位：人民币元				
股票交易	债券交易	债券回购交易	权证交易	应支付该券商的佣金

券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总额的比例 (%)	备注
------	--------	------	------------------	------	------------------	------	------------------	----	----------------	----

[illegible]

长江证券	1	1,344,634,775.33	14.10	54,355,851.20	21.47	717,000,000.00	37.88	-	-	1,142,927.97	14.39	-
德邦证券	1	357,963,432.34	3.75	-	-	55,000,000.00	2.91	-	-	304,262.49	3.83	-

高华证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	2	1,303,465,196.71	14.51	-	-	-	-	-	-	1,126,864.90	14.19	-

国库券	1	1,559,854,057.89	16.36	-	-	-	-	-	-	1,267,292.73	15.96	-
政府债券	2	951,280,770.01	9.98	198,644,000.00	78.50	-	-	-	-	781,554.21	9.84	-

[illegible][illegible][illegible]

中国际	1	755-200-87639	7.92	-	-	-	-	-	-	613.685.79	7.73	-
-----	---	---------------	------	---	---	---	---	---	---	------------	------	---

我公司对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的;我公司对基金交易席位的选

§11 影响投资者决策的其他重要信息

2010年6月21日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。
