# 长城双动力股票型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年6月30日

**基金管理人:长城基金管理有限公司**
**基金托管人:中国建设银行股份有限公司**
**送出日期:2010年8月24日**

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年08月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年01月01日起至06月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长城双动力股票 |
| 基金主代码 | 200010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年1月15日 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 306,483,397.39份 |
| 基金合同存续期 | - |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 充分挖掘上市公司从内生性增长到外延式扩张过程中产生的投资机会,追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 采用"自下而上、个股优选"的投资策略,运用长城基金上市公司价值创造评估系统分析上市公司内生性增长潜力与外延式扩张潜质,选择以内生性增长为基础或具备外延式扩张能力的优秀上市公司构建并动态优化投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型证券投资基金,主要投资于具有内生性增长潜力或外延式扩张潜质的优势上市公司。属于预期风险收益较高的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和混合型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 长城基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 彭洪波 | 尹东 |
| | 联系电话 | 0755-23982338 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | penghb@ccfund.com.cn | yindong.zh@ccb.cn |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-23982328 | 010-66275865 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ccfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2010年1月1日至2010年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -20,327,779.12 |
| 本期利润 | -37,150,758.98 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2660 |
| 本期基金份额净值增长率 | -14.00% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2010年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1194 |
| 期末基金资产净值 | 343,082,443.54 |
| 期末基金份额净值 | 1.1194 |

注:①"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;

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -6.07% | 1.29% | -5.73% | 1.23% | -0.34% | 0.06% |
| 过去三个月 | -7.24% | 1.78% | -17.38% | 1.35% | 10.14% | 0.43% |
| 过去六个月 | -14.00% | 1.42% | -20.55% | 1.19% | 6.55% | 0.23% |
| 过去一年 | -4.32% | 1.57% | -12.09% | 1.41% | 7.77% | 0.16% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效日起至今 | 11.94% | 1.38% | 25.44% | 1.42% | -13.50% | -0.04% |

注:从D1到Dn时间区间业绩比较基准的收益率由D0到D1区间内每个交易日收益率的合成计算而来,计算公式如下:

从D1到Dn时间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×……×(1+Dn日业绩比较基准收益率)-1

这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下:

长城双动力基金业绩比较基准每日收益率=中信标普300指数日收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%

指数收益率均以当日收盘价相对于上一交易日收盘价计算而成。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

| 负债和所有者权益 | 本期末 2010年6月30日 | 上年度末 2009年12月31日 |
|---|---|---|
| 负 债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 273,394.97 | 400,660.28 |
| 应付管理人报酬 | 427,301.46 | 89,244.43 |
| 应付托管费 | 71,216.92 | 14,874.06 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 2,445,281.62 | 108,701.07 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 173,924.29 | 56,010.10 |
| 负债合计 | 3,391,119.26 | 669,489.94 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 306,483,397.39 | 53,772,341.81 |
| 未分配利润 | 36,599,046.15 | 16,224,926.35 |
| 所有者权益合计 | 343,082,443.54 | 69,997,268.16 |
| 负债和所有者权益总计 | 346,473,562.80 | 70,666,758.10 |

注:报告截止日2010年06月30日,基金份额净值1.1194元,基金份额总额306,483,397.39份。

本基金基金合同于2009年1月15日生效。

6.2 利润表

会计主体:长城双动力股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -30,554,987.44 | 18,369,281.50 |
| 1.利息收入 | 149,154.46 | 1,464,667.38 |
| 其中:存款利息收入 | 149,154.46 | 308,073.32 |
| 债券利息收入 | - | 1,127,452.06 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 29,142.00 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -14,213,488.13 | 4,185,110.78 |
| 其中:股票投资收益 | -14,914,441.14 | 4,016,578.78 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | -264,500.00 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 700,953.01 | 433,032.00 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -16,822,979.86 | 12,067,510.00 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 332,326.09 | 651,993.34 |
| 减:二、费用 | 6,595,771.54 | 1,948,539.72 |
| 1.管理人报酬 | 1,244,108.32 | 1,380,892.31 |
| 2.托管费 | 207,351.38 | 230,148.71 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 4,961,007.22 | 159,501.92 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 183,304.62 | 177,996.78 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"填列) | -37,150,758.98 | 16,420,741.78 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -37,150,758.98 | 16,420,741.78 |

注:本基金基金合同于2009年1月15日生效,上年度可比期间为2009年1月15日至2009年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长城双动力股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 53,772,341.81 | 16,224,926.35 | 69,997,268.16 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -37,150,758.98 | -37,150,758.98 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | 252,711,055.58 | 57,524,878.78 | 310,235,934.36 |
| 其中:1.基金申购款 | 470,032,438.28 | 106,768,120.85 | 576,800,559.13 |
| 2.基金赎回款 | -217,321,382.70 | -49,243,242.07 | -266,564,624.77 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 306,483,397.39 | 36,599,046.15 | 343,082,443.54 |
| 项目 | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 485,751,247.50 | - | 485,751,247.50 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 16,420,741.78 | 16,420,741.78 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -415,425,710.64 | -4,469,926.31 | -419,895,636.95 |
| 其中:1.基金申购款 | 96,575,748.80 | 5,122,681.16 | 101,698,429.96 |
| 2.基金赎回款 | -512,001,459.44 | -9,592,607.47 | -521,594,066.91 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 70,325,536.86 | 11,950,815.47 | 82,276,352.33 |

注:本基金基金合同于2009年1月15日生效,上年度可比期间为2009年1月15日至2009年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

杨光裕 关林戈 余骏

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城双动力股票型证券投资基金(以下简称"本基金")系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]1155号文《关于核准长城双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,本基金的基金合同于2009年1月15日正式生效。本基金首次设立募集的规模为485,751,247.50份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记机构为长城基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金融资比较基准为:75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,并按照中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金信息披露的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》和《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<半度报告和年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定进行具体会计核算和信息披露。

本基金财务报表以不基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2010年6月30日的财务状况以及自2010年1月1日至2010年6月30日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度报表相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无对本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 长城基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 长城证券有限责任公司("长城证券") | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 东方证券股份有限公司("东方证券") | 基金管理人股东、基金代销机构 |

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 长城证券 | 44,301,857.66 | 1.34 | 13,135,561.09 | 11.06 |
| 东方证券 | 596,288,120.49 | 18.04 | - | - |

6.4.8.1.2 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) |
| 长城证券 | - | - | 971,400,000.00 | 100.00 |

6.4.8.1.3 权证交易

注:本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例(%) |
| 长城证券 | 37,656.49 | 1.36 | - | - |
| 东方证券 | 488,305.69 | 17.63 | 401,768.90 | 16.43 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例(%) |
| 长城证券 | 11,165.31 | 11.25 | - | - |

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,244,108.32 | 1,380,892.31 |
| 其中:支付给销售机构的客户维护费 | 334,354.34 | 389,109.83 |

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

**H=E×1.5%/当年天数**

**H**为每日应支付的基金管理费

**E**为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 207,351.38 | 230,148.71 |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

**H=E×0.25%/当年天数**

**H**为每日应支付的基金托管费

**E**为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2009年1月15日)持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 13,170,699.28 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | 5,270,602.71 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 13,170,699.28 | 5,270,602.71 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 4.30% | 7.49% |

注:基金管理人于本期及上年度可比期间2009年1月15日(基金合同生效日)至6月30日止会计期间持有本基金份额相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算并支付。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | | 上年度可比期间 2009年1月15日至2009年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 120,198,031.94 | 122,745.91 | 13,677,870.23 | 298,234.53 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金于本期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:基金于本期末未持有从事债券正回购交易中作为抵押的债券。

## §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 211,996,192.99 | 61.19 |
| | 其中:股票 | 211,996,192.99 | 61.19 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 126,915,282.53 | 36.63 |
| 6 | 其他各项资产 | 7,562,087.28 | 2.18 |
| 7 | 合计 | 346,473,562.80 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 169,169,363.41 | 49.31 |
| C0 | 食品、饮料 | 107,477,161.53 | 31.33 |
| 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 | 61,692,201.88 | 17.98 |
| C8 | 医药、生物制品 | - | - |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 19,439,330.40 | 5.67 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | - | - |
| H | 批发和零售贸易 | 23,387,499.18 | 6.82 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 211,996,192.99 | 61.79 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

| 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 | 601299 | 中国北车 | 6,399,998 | 30,975,990.32 | 9.03 |
| 2 | 601766 | 中国南车 | 6,372,658 | 30,716,211.56 | 8.95 |
| 3 | 600809 | 山西汾酒 | 727,502 | 29,849,407.06 | 8.70 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 1,047,373 | 29,556,866.06 | 8.62 |
| 5 | 600195 | 中牧股份 | 1,034,889 | 24,506,171.52 | 7.14 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 972,543 | 23,564,716.89 | 6.87 |
| 7 | 600785 | 新华百货 | 712,599 | 23,387,499.18 | 6.82 |
| 8 | 601186 | 中国铁建 | 2,699,907 | 19,439,330.40 | 5.67 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

金额单位:人民币元

| 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 | 600029 | 南方航空 | 69,471,627.79 | 99.25 |
| 2 | 000762 | 西藏矿业 | 54,095,704.20 | 77.28 |
| 3 | 601766 | 中国南车 | 53,718,199.10 | 76.74 |
| 4 | 601299 | 中国北车 | 51,902,543.83 | 74.15 |
| 5 | 002192 | 路翔股份 | 51,879,580.81 | 74.12 |
| 6 | 601006 | 大秦铁路 | 50,166,676.23 | 71.67 |
| 7 | 600115 | 东方航空 | 49,342,721.46 | 70.49 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 47,960,824.49 | 68.52 |
| 9 | 600456 | 宝钛股份 | 44,415,964.03 | 63.45 |
| 10 | 601111 | 中国国航 | 42,029,105.19 | 60.04 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 36,742,817.12 | 52.49 |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 36,659,800.00 | 52.37 |
| 13 | 600459 | 贵研铂业 | 36,160,939.22 | 51.66 |
| 14 | 000858 | 五粮液 | 34,272,446.90 | 48.96 |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 34,271,044.06 | 48.96 |
| 16 | 601169 | 北京银行 | 33,345,271.19 | 47.64 |
| 17 | 002202 | 金风科技 | 32,689,880.14 | 46.70 |
| 18 | 600000 | 浦发银行 | 32,649,059.84 | 46.64 |
| 19 | 000568 | 泸州老窖 | 32,142,678.17 | 45.92 |
| 20 | 000063 | 中兴通讯 | 32,130,244.45 | 45.90 |
| 21 | 600060 | 海信电器 | 31,842,369.36 | 45.49 |
| 22 | 600221 | 海南航空 | 31,811,453.70 | 45.45 |
| 23 | 600809 | 山西汾酒 | 31,561,573.53 | 45.09 |
| 24 | 600519 | 贵州茅台 | 31,182,754.87 | 44.55 |
| 25 | 600875 | 东方电气 | 29,445,402.15 | 42.07 |
| 26 | 000001 | 深发展A | 29,152,676.30 | 41.65 |
| 27 | 600547 | 山东黄金 | 27,038,794.91 | 38.63 |
| 28 | 600195 | 中牧股份 | 26,241,264.13 | 37.49 |
| 29 | 000713 | 丰乐种业 | 24,774,268.71 | 35.39 |
| 30 | 600983 | 合肥三洋 | 23,673,514.23 | 33.82 |
| 31 | 601899 | 紫金矿业 | 22,703,148.19 | 32.43 |
| 32 | 600111 | 包钢稀土 | 22,265,802.59 | 31.81 |
| 33 | 600489 | 中金黄金 | 21,931,686.93 | 31.33 |
| 34 | 000400 | 许继电气 | 20,288,682.07 | 28.98 |
| 35 | 601186 | 中国铁建 | 19,776,538.06 | 28.25 |
| 36 | 600900 | 长江电力 | 19,682,255.69 | 28.12 |
| 37 | 601628 | 中国人寿 | 19,526,950.35 | 27.90 |
| 38 | 600785 | 新华百货 | 19,396,406.11 | 27.71 |
| 39 | 000877 | 天山股份 | 17,102,100.40 | 24.43 |
| 40 | 000157 | 中联重科 | 16,909,289.43 | 24.16 |
| 41 | 000962 | 东方钽业 | 16,853,787.86 | 24.08 |
| 42 | 000024 | 招商地产 | 16,436,760.81 | 23.48 |
| 43 | 002155 | 辰州矿业 | 16,137,794.78 | 23.05 |
| 44 | 600997 | 开滦股份 | 16,136,029.66 | 23.05 |
| 45 | 600396 | 金山股份 | 15,729,788.63 | 22.47 |
| 46 | 600628 | 新世界 | 15,228,259.00 | 21.76 |
| 47 | 000651 | 格力电器 | 15,201,621.77 | 21.72 |
| 48 | 002041 | 登海种业 | 15,029,608.50 | 21.47 |
| 49 | 000952 | 广济药业 | 15,005,738.10 | 21.44 |
| 50 | 002304 | 洋河股份 | 14,390,217.55 | 20.56 |
| 51 | 600015 | 华夏银行 | 13,318,881.00 | 19.03 |
| 52 | 600354 | 敦煌种业 | 13,257,574.78 | 18.94 |
| 53 | 000423 | 东阿阿胶 | 13,089,895.26 | 18.70 |
| 54 | 000401 | 冀东水泥 | 12,994,330.94 | 18.56 |
| 55 | 600720 | 祁连山 | 12,389,635.00 | 17.70 |
| 56 | 002007 | 华兰生物 | 12,142,875.00 | 17.35 |
| 57 | 600664 | 哈药股份 | 10,797,682.30 | 15.43 |
| 58 | 600169 | 太原重工 | 10,349,626.64 | 14.79 |
| 59 | 600829 | 三精制药 | 10,315,141.21 | 14.74 |
| 60 | 600383 | 金地集团 | 9,736,491.70 | 13.91 |
| 61 | 601328 | 交通银行 | 9,123,944.20 | 13.03 |
| 62 | 600887 | 伊利股份 | 8,349,906.50 | 11.93 |
| 63 | 000581 | 威孚高科 | 7,704,559.36 | 11.01 |
| 64 | 601988 | 中国银行 | 7,090,500.00 | 10.13 |
| 65 | 000878 | 云南铜业 | 6,637,717.34 | 9.48 |
| 66 | 600312 | 平高电气 | 5,914,937.00 | 8.45 |
| 67 | 600239 | 云南城投 | 5,605,097.88 | 8.01 |
| 68 | 002252 | 上海莱士 | 4,884,373.20 | 6.98 |
| 69 | 600166 | 福田汽车 | 4,533,397.11 | 6.48 |
| 70 | 600546 | 山煤国际 | 4,411,028.24 | 6.30 |
| 71 | 002185 | 华天科技 | 3,665,552.00 | 5.24 |
| 72 | 002123 | 荣信股份 | 3,475,419.00 | 4.97 |
| 73 | 002017 | 东信和平 | 3,402,824.00 | 4.86 |
| 74 | 000735 | 罗牛山 | 2,921,163.00 | 4.17 |
| 75 | 000540 | 中天城投 | 2,696,285.00 | 3.85 |
| 76 | 002215 | 诺普信 | 2,652,000.50 | 3.79 |
| 77 | 600880 | 博瑞传播 | 2,338,449.40 | 3.34 |
| 78 | 000969 | 安泰科技 | 2,248,999.50 | 3.21 |
| 79 | 600273 | 华芳纺织 | 2,190,077.74 | 3.13 |
| 80 | 000338 | 潍柴动力 | 2,024,988.00 | 2.89 |
| 81 | 000937 | 冀中能源 | 2,017,762.00 | 2.88 |
| 82 | 601666 | 平煤股份 | 2,009,100.00 | 2.87 |
| 83 | 002050 | 三花股份 | 1,984,000.00 | 2.83 |
| 84 | 002121 | 科陆电子 | 1,968,459.00 | 2.81 |
| 85 | 000623 | 吉林敖东 | 1,838,900.00 | 2.63 |
| 86 | 600739 | 辽宁成大 | 1,816,517.70 | 2.60 |
| 87 | 002142 | 宁波银行 | 1,793,186.15 | 2.56 |
| 88 | 002220 | 天宝股份 | 1,777,143.00 | 2.54 |
| 89 | 002038 | 双鹭药业 | 1,487,723.00 | 2.13 |

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 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:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600029 | 南方航空 | 67,030,921.01 | 95.76 |
| 2 | 000762 | 西藏矿业 | 56,130,274.19 | 80.19 |
| 3 | 002192 | 路翔股份 | 56,052,196.31 | 80.08 |
| 4 | 600115 | 东方航空 | 49,686,143.61 | 70.98 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 47,733,265.28 | 68.19 |
| 6 | 601006 | 大秦铁路 | 47,533,207.12 | 67.91 |
| 7 | 600456 | 宝钛股份 | 43,857,550.47 | 62.66 |
| 8 | 601111 | 中国国航 | 39,495,359.27 | 56.42 |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 38,979,811.20 | 55.69 |
| 10 | 600459 | 贵研铂业 | 37,851,968.72 | 54.08 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 35,672,600.00 | 50.96 |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 34,703,720.15 | 49.58 |
| 13 | 600060 | 海信电器 | 34,411,816.98 | 49.16 |
| 14 | 601166 | 兴业银行 | 33,099,183.05 | 47.29 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 32,917,813.09 | 47.03 |
| 16 | 002202 | 金风科技 | 32,748,564.97 | 46.79 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 32,226,541.73 | 46.04 |
| 18 | 601169 | 北京银行 | 31,981,918.01 | 45.69 |
| 19 | 000001 | 深发展A | 31,548,794.06 | 45.07 |
| 20 | 600221 | 海南航空 | 30,244,579.08 | 43.21 |
| 21 | 600875 | 东方电气 | 29,890,050.80 | 42.70 |
| 22 | 600111 | 包钢稀土 | 26,422,278.44 | 37.75 |
| 23 | 600547 | 山东黄金 | 25,910,614.26 | 37.02 |
| 24 | 000713 | 丰乐种业 | 24,754,292.08 | 35.36 |
| 25 | 600983 | 合肥三洋 | 23,443,399.19 | 33.49 |
| 26 | 601628 | 中国人寿 | 22,452,111.17 | 32.08 |
| 27 | 601766 | 中国南车 | 20,995,080.02 | 29.99 |
| 28 | 601899 | 紫金矿业 | 20,721,660.24 | 29.60 |
| 29 | 600489 | 中金黄金 | 20,315,724.51 | 29.02 |
| 30 | 600900 | 长江电力 | 19,571,785.01 | 27.96 |
| 31 | 601299 | 中国北车 | 19,082,458.13 | 27.26 |
| 32 | 000400 | 许继电气 | 18,534,673.30 | 26.48 |
| 33 | 000651 | 格力电器 | 18,430,813.91 | 26.33 |
| 34 | 000877 | 天山股份 | 17,681,868.07 | 25.26 |
| 35 | 000962 | 东方钽业 | 16,918,406.33 | 24.17 |
| 36 | 000157 | 中联重科 | 16,213,694.54 | 23.16 |
| 37 | 000024 | 招商地产 | 15,986,277.71 | 22.84 |
| 38 | 600997 | 开滦股份 | 15,669,791.65 | 22.39 |
| 39 | 600015 | 华夏银行 | 15,226,473.76 | 21.75 |
| 40 | 002041 | 登海种业 | 15,216,124.84 | 21.74 |
| 41 | 000952 | 广济药业 | 14,911,784.61 | 21