

华安核心优选股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年 12 月 31 日

X2 报告期末按行业分类的证券投资组合			
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	-	-
C	制造业	558,153,318.64	45.95
CD	食品、饮料	113,416,455.01	9.34
C1	纺织、服装、皮毛	14,480,000.00	1.19
C2	木材、家具	5,178,000.00	0.43
C3	造纸、印刷	-	-
G4	石油、化学、塑胶、塑料	145,168,581.12	11.95
C5	电子	40,265,452.84	3.31
C6	金属、非金属	20,125,000.00	1.66
C7	机械、设备、仪表	116,630,980.35	9.60
C8	医药、生物制品	102,888,851.32	8.47
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,139,907.18	0.59
E	建筑业	8,058,000.00	0.66
F	交通运输、仓储业	9,648,000.00	0.79
G	信息技术业	111,035,893.94	9.14
H	批发和零售贸易	42,920,002.94	3.53
I	金融、保险业	69,461,554.61	5.72
J	房地产业	12,744,000.00	1.05
K	社会服务业	43,938,243.73	3.62
L	传播与文化产业	36,889,150.44	3.04
M	综合类	-	-
	合计	899,988,072.44	74.09

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	002595	蒙彼科技	2,000,089	48,002,136.00	3.95
2	002648	卫驱石化	1,200,000	43,320,000.00	3.57
3	000858	五 粮 源	1,200,000	39,360,000.00	3.24
4	600016	民生银行	6,500,000	38,285,000.00	3.15
5	601208	东材科技	1,719,999	32,473,581.12	2.67
6	002582	好想你	599,966	31,198,232.00	2.57
7	000001	深发展A	1,999,779	31,176,554.61	2.57
8	600160	巨化股份	1,500,000	30,075,000.00	2.48
9	300245	天阳科技	930,000	25,482,000.00	2.16
10	300588	蓝色光标	800,038	24,241,151.40	2.00



序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国债债券	70,000,000.00	5.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	26,678,765.80	2.20
5	企业短期融资券	30,122,000.00	2.48
6	中期票据	-	-
7	可转债	39,566,883.57	3.26
8	其他	-	-
9	合计	166,367,649.37	13.70

5.5 报告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	110011	11财国债11H	700,000	70,000,000.00	5.76
2	131001	央行票据	765,560	31,607,618.00	2.60

3	1181147	11月中天CP01	200,000	20,060,000.00	1.65
4	122021	09万业债	175,246	16,483,203.00	1.36
5	1181067	11江经CP01	100,000	10,062,000.00	0.83

5.6 报告期期末公允价值占金融资产净值比例大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。

5.7 报告期期末公允价值占金融资产净值比例大排名的前五名权益证券投资明细

本基金本报告期末未持有权益证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 2011年05月27日，五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金该股票投资的决策程序符合相关法律法规的要求。报告期内，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资前十名股票，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	1,109,650.32
2	应收证券清算款	

3	应收账款			-
4	应收利息		2,803,889.10	
5	应收中购款		1,124,449.83	
6	其他应收款			
7	待摊费用			
8	其他			
9	合计		5,037,989.25	
5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	34,697,618.80	2.86
2	110015	石化转债	4,459,628.70	0.37
3	125887	中钢转债	409,636.07	0.03
5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明				
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况				

本报告期初基金份额总额	1,418,265,187.66
本报告期基金总申购份额	63,329,033.69
减:本报告期基金总赎回份额	85,913,463.29
本报告期基金份额变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,395,680,758.06

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《平安定兴灵活配置混合型证券投资基金合同》

2、《平安定兴灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

3、《平安定兴灵活配置混合型证券投资基金招募协议》

7.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网网站<http://www.fundam.com.cn>。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网网站,或在营业时间内在基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

平安定兴灵活配置混合型证券投资基金
二〇一三年二月二十日

华安MSCI中国A股指

2011 第II

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任期日期 离任日期	证券从业年限	说明

[illegible][illegible][illegible]

§5 投资组合报告				
§5.1 报告期末基金投资组合概况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	备注
1	权益投资	209,816,075.62	88.65	
	其中:股票	209,816,075.62	88.65	
2	固定收益投资	38,156.40	0.02	
	其中:债券	38,156.40	0.02	
	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	24,464,396.07	10.34	
6	其他各项资产	2,368,391.07	1.00	
7	负债合计	236,687,019.14	100.00	
§5.2 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	1,483,000.00	0.64	
B	采掘业	4,453,057.42	2.80	
C	制造业	71,034,064.64	30.87	
C1	食品、饮料	6,883,310.30	2.99	
C2	纺织、服装、皮毛	-	-	
C3	木材、家具	-	-	
C4	造纸、印刷	-	-	
C5	石油、化学、塑胶、塑料	1,290,000.00	0.56	

C6	电子、非金属	5,351,000.00	1.04
C7	金属、非金属	4,464,000.00	1.04
C8	机械、设备、仪表	46,976,154.34	20.71
C9	医药、生物制品	6,272,000.00	2.43
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	928,557.00	0.80
E	建筑业	2,045,000.00	0.89
F	交通运输、仓储业	9,124,000.00	3.96
G	信息技术业	24,938,030.56	10.84
H	批发和零售贸易	19,934,600.00	8.66
I	金融、保险业	48,469,638.00	21.06
J	房地产业	9,285,328.00	4.04
K	社会服务业	714,000.00	0.31
L	传播与文化产业	5,131,000.00	2.23
M	综合类	10,275,800.00	4.47



合计			209,816,075.62		91.18	
5.3 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名前十股票投资明细						
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	600015	华夏银行	1,100,000	12,353,000.00	5.37	
2	601601	中国太保	596,600	11,460,686.00	4.98	
3	600016	民生银行	1,500,000	8,835,000.00	3.84	
4	602802	南京中商	280,000	7,008,400.00	3.05	
5	600570	恒生电子	550,000	6,732,000.00	2.93	
6	600837	海通证券	880,000	6,520,800.00	2.83	
7	601766	中国南车	1,500,000	6,495,000.00	2.82	
8	600153	建发股份	1,000,000	6,380,000.00	2.77	
9	000926	福耀股份	880,000	6,230,400.00	2.71	
10	601600	中国铝业	301,366	6,024,306.34	2.62	
5.4 报告期末按股票品种分类的股票投资组合						
序号	债券品种		公允价值 (元)		占基金资产净值比例 (%)	

1	国家债券	-	-	-
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	38,156.40	-	0.02
8	其他	-	-	-
9	合计	38,156.40	-	0.02

5.5 报告期末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	110018	国电转债	360	38,156.40	0.02

5.6 报告期末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。

5.7 报告期末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
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	130,350.43
2	应收证券清算款	2,218,482.55
3	应收股利	—
4	应收利息	5,140.63
5	应收申购款	14,417.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,368,391.05

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况	
§6 开放式基金份额变动	
	单位:份
本报告期初基金份额总额	279,007,942.01
本报告期基金总申购份额	8,845,810.82
减:本报告期基金总赎回份额	9,594,242.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	278,259,510.11
§7 备查文件目录	
7.1 备查文件目录	
1、《伊泰核心成长股票型证券投资基金合同》	
2、《伊泰核心成长股票型证券投资基金托管协议》	
3、《伊泰核心成长股票型证券投资基金投资协议》	
7.2 存放地点	
基金管理人及基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网网站 http://www.ljzuan.com.cn 。	
7.3 查阅方式	
投资者可至基金管理人互联网网站查阅,或在营业时间至基金管理人或基金托管人的办公场所查询。	
伊泰基金管理有限公司	
二〇一二年一月二日	

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	600016	民生银行	18,529,025	109,135,975.25	2.54
2	600036	招商银行	1,083,353	108,683,308.24	2.55
3	601661	中国太保	4,389,948	138,197,900.08	2.85
4	000858	五粮液	2,313,098	82,429,614.40	1.92
5	601318	中国平安	2,109,963	72,666,436.92	1.69
6	600000	浦发银行	8,502,123	72,183,024.77	1.68
7	600519	贵州茅台	372,353	70,106,628.00	1.67
8	601166	兴业银行	5,118,626	64,083,197.52	1.49
9	600887	伊利股份	3,100,915	63,351,604.37	1.46
10	000002	万科A	7,757,635	57,949,533.45	1.35
5.3.2期末和期间投资公允价值占基金资产净值比例大于3%的资产公允价值投资明细					
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	600388	龙净环保	286,495	59,977,978.85	0.15
2	000677	ST海龙	581,654	2,803,572.58	0.07
3	000873	朗姿股份	771,641	2,156,879.54	0.08

3.4 报告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 (元)	占基金资产净值比例 (%)	
1	国家债券		-	-	
2	央行票据		154,784,000.00	3.60	
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		3,324,170.28	0.08	
8	其他		-	-	
9	合计		158,108,170.28	3.68	
3.5 报告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	1101022	11国债零	1,600,000	154,784,000.00	3.60
2	110018	国电转债	17,510	1,855,884.90	0.04
3	110017	中电转债	8,310	762,691.80	0.02

4	125089	深圳证券时报	7.662	705,593.58	0.02
5	76 报告期内未发生前五名证券资产净值比例大于1%排名的前十名资产证券化证券投资情况				
5.1	本基金本报告期末未持有资产证券化支持证券				
5.2	报告期内未发生前五名基金资产净值比例大于1%排名的前五名证券投资情况				
5.3	本基金本报告期末未持有股票				
5.4	证券投资合规报告情况				
5.8.1	2015年5月27日,中国证监会、中国证券业协会和中国证券投资基金业协会联合发布《证券投资基金参与融资融券业务指引》,规定:“基金管理人应当建立融资融券业务合规管理制度,明确融资融券业务的投资决策程序、风险控制措施、信息披露要求、合规管理要求等,并报中国证监会备案。基金管理人应当建立融资融券业务合规管理制度,明确融资融券业务的投资决策程序、风险控制措施、信息披露要求、合规管理要求等,并报中国证监会备案。”				
5.8.1.1	报告期内,本基金前十大其他证券发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告期内前一日前一日受到公开谴责、处罚的情况				
5.8.3	其他各项资产构成				
序号	名称		金额(元)		
1	存出保证金		967,247.87		
2	应收证券清算款		23,356,196.04		
3	应收股利				
4	应收利息				
5	应收申购款		3,699,454.78		
6	其他应收款		18,613,309.11		
7	待摊费用				
8	其他				

9	合计			46,436,207.90
5.8.4	报告期内持有待处理的长期股权投资附注说明			
5.8.5	本期长期股权投资未有减值计提附注说明			
5.8.5.1	本期长期股权投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明			
5.8.5.2	本期不存在长期股权投资计提减值准备附注说明			
5.8.5.3	期末长期股权投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明			
序号	股票代码	股票名称	流通受限股份占公允价值比例 (%)	占基金资产净值比例 (%)
1	000677	ST海龙	2,803,572.28	0.07
96 开放式基金投资组合表				
单位:元				
本报告期前基金投资组合总额				
减:本报告期基金申购份额				
减:本报告期基金赎回份额				
减:本报告期基金拆分变动份额				
本报告期前基金投资组合总额				
97 备查文件目录				
7.1 备查文件目录				
1、在MSCI中国A股指数增强型证券投资基金				
2、在MSCI中国A股指数增强型证券投资基金				

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网网站<http://www.huasun.com.cn>。
7.3 查阅方式
投资者可登录基金管理人互联网网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。
