

**（止报D18）**  
注册地址：厦门市莲前西路2号连富大厦17楼  
法定代表人：傅毅辉  
联系人：卢金杰  
电话：0592-5161642  
传真：0592-5161140  
客户服务电话：0592-5163888  
网址：www.xmzf.cn  
**83** 中国国际金融有限公司  
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址：北京市建国门外大街6号SK大厦3层  
法定代表人：李剑刚  
电话：010-85679291  
联系人：王雪菊  
客户服务电话：010-85679238、010-85679169  
网址：www.cicco.com.cn  
**84** 光大证券股份有限公司  
注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层  
办公地址：大连市中山区人民路24号  
法定代表人：陈琳  
电话：021-50122222  
客户服务电话：400-820-9898  
网址：www.eh1stock.com  
**85** 广州证券有限责任公司  
注册 办 公 地 址：广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼  
法定代表人：刘东  
电话：020-8732266  
联系人：林楚洁  
客户服务电话：020-6619033  
网址：www.gzsc.com.cn  
**86** 广州证券有限责任公司  
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7-10层  
法定代表人：黄金琳  
电话：0591-87385623  
传真：0591-87385610  
联系人：林楚洁  
客户服务电话：010-66045608  
客服电话：010-66045678  
传真：010-66045527  
大相投资顾问：http://www.hjsec.com  
大相基金网站：www.jin.com.cn  
**88** 信达证券股份有限公司  
注册 办 公 地 址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
法定代表人：高冠江  
联系人：唐静  
客户服务电话：010-63801000  
联系传真：010-63800978  
全国热线：400-800-8899  
网址：www.cindasc.com  
**89** 华龙证券有限责任公司  
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号  
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦  
法定代表人：李晓安  
联系人：李新田  
联系电话：0931-4890208  
联系传真：0931-4890628  
客服电话：0931-4890628、4890100、4890619、4890618  
网址：www.hlzqgs.com  
**90** 西部证券股份有限公司  
注册 办 公 地 址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层  
法定代表人：刘建武  
联系电话：029-87406488  
传真：029-87406387  
联系人：马彦萍  
客户服务电话：95582  
网址：www.westsec.com.cn  
**91** 红塔证券股份有限公司  
注册 办 公 地 址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦B楼  
法定代表人：况雨林  
电话：0871-3577946  
联系人：高海萍  
客户服务电话：0871-3577930  
网址：www.hongtasec.com  
**92** 湘财证券股份有限公司  
注册 办 公 地 址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A67  
法定代表人：吕承泉  
电话：0571-87091053  
传真：0571-87091913  
客户服务电话：0571-87019677  
网址：www.xcsc.com.cn  
**93** 天风证券股份有限公司  
注册 办 公 地 址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼  
联系人：余磊  
联系人：董娜  
电话：027-87618882  
传真：027-87618863  
客户服务电话：028-86711410/027-87618882  
网址：www.tfzq.com  
**94** 西藏国际证券有限责任公司  
注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路101号  
办公地址：上海市静安区118弄24号楼  
法定代表人：贾绍君  
联系人：王莉  
电话：021-36533017  
传真：021-36533017  
客户服务电话：400-881-1177  
网址：www.xzsc.com.cn  
**95** 中融证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区金融大街8号  
办公地址：北京市西城区金融大街8号A33层  
法定代表人：丁之锁  
联系人：高海萍  
电话：010-58568040  
传真：010-58568062  
客户服务电话：010-58568118

网址：www.hjsec.com.cn  
**96** 英大证券有限责任公司  
注册 办 公 地 址：深圳市福田区深南中路华能大厦30、31层  
法定代表人：赵永文  
电话：0755-83007069  
传真：0755-83007069  
客户服务电话：4008-698-698  
网址：www.ydsc.com.cn  
**97** 日信证券有限责任公司  
注册 办 公 地 址：呼和浩特市新城区锡林南路18号  
法定代表人：孔佑杰  
联系人：冯志  
电话：010-85991743  
传真：010-66412537  
客户服务电话：010-83991728  
网址：http://www.rjx.com.cn  
**98** 大通证券股份有限公司  
注册地址：大连市中山区人民路24号  
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层  
法定代表人：张建华  
联系人：谢立军  
电话：0411-39673202  
传真：0411-39673219  
客户服务热线：4008-169-169  
公司网站：www.daton.com.cn  
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。  
**C. 注册验资机构：**  
**98** 银华基金管理有限公司  
注册地址：广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层  
法定代表人：王立新（代）  
电话：010-58163000  
传真：010-58163027  
联系人：伍军辉  
**C. 出具法律意见书的律师事务所**  
名称：北京市金杜律师事务所  
注册 办 公 地 址：北京市朝阳区东三环中街39号建外SOHO A座31层  
负责人：王玲  
电话：0755-22163307  
传真：0755-22163380  
联系人：王玲萍  
经办律师：靳庆军 宋萍萍  
**(四) 会计师事务所和经办注册会计师**  
名称：安永华明会计师事务所  
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东座财经楼A座6楼（即东3办公楼）16层  
法定代表人：葛明  
电话：010-58153322、010-58152415  
传真：010-58188298  
签字注册会计师：李慧民、王珊珊  
联系人：王珊珊

**九、基金名称**  
银华沪深300企业证券投资基金  
**五、基金类型**  
契约型开放式  
**六、基金的投资目标**  
本基金为平衡型基金，主要通过投资于中国加入WTO后具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行的债券，在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式谋求基金资产的长期稳定增值。  
**七、投资对象及投资范围**  
本基金为平衡型基金，具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资的重点是中国人世后以及在 globalization 一体化过程中具有相对竞争优势和成本领先优势并确立行业龙头地位的上市公司所发行的股票，这部分投资的比例不低于本基金股票资产的80%。  
**八、投资组合比例或策略**  
基于本基金的投资理念，为实现本基金的投资目标，本基金在构建投资组合过程中将遵循以下主要原则或采取以下主要策略：  
● 资产配置：收益与风险平衡；长期收益与短期收益相平衡；在行业组合、公司组合上体现成长型与价值型配置。  
● 流动性原则：针对开放式基金赎回特性，在风险控制下将流动性风险控制作为首要原则。  
● 资产配置比例限制原则：股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产不低于基金总资产的80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的10%。  
● 双原则：本基金将持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%；本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家企业发行的证券总和，不得超过该证券的10%，并按有关规定履行信息披露义务。  
● 仓位选择优先策略：基于大盘走势关系基金投资全局，本基金投资中充分重视对市场趋势尤其是对市场趋势的研判，并由此决定基金仓位的选择和投资资产配置中优先的位置。  
● 逆向操作流程：资产配置采取自上而下的操作流程，而股票选择采取自上而下的操作流程。  
● 动态仓位策略：根据各种影响因素的变化，及时调整组合中各种资产的权重，尤其针对政策风险、经济周期及市场系统性风险。股票投资组合的系统调整周期为一年，微调可根据实际情况即时进行。  
● 备选库策略：本基金在股票方面的主要投资对象是中国人市具有竞争优势上市公司，将为本基金建立竞争优势备选库，股票资产中来自于该备选库中股票的投资权重不低于80%，投资额超过5000万元的投资须来自备选库。  
**九、业绩比较基准**  
本基金的业绩比较基准为：中信标普300指数×70%+中信全债指数×20%+同业活期存款利率×10%。  
中信标普300指数为上海、深圳两个证券交易所流通市值最大、最具流动性的300只股票并以流通股股本加权的股票指数，是目前中国证券市场中与本基金股票投资组合比较匹配同时公信力较好的股票指数。  
本基金的股票投资比例范围为20-70%，所以本基金加入20%的中信全债指数和10%的同业活期存款利率一起构成本基金业绩比较基准。  
**十、风险收益特征**  
本基金注重收益与风险的平衡，不追求高风险下的高收益，将通过控制股票、债券的投资比重来获取中低风险下的中收益。  
**十一、基金投资组合报告**  
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。  
基金托管人中国银行股份有限公司对本报告说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行了复核。

本投资组合报告所载数据截至2012年3月31日，本报告中所有财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,816,776,276.13	65.71
2	固定收益	1,816,776,276.13	65.71
3	中期票据投资	619,462,705.80	22.40
4	其中：债券	619,462,705.80	22.40
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	47,500,191.25	1.72
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	233,481,821.48	8.44
10	其他资产	47,804,705.19	1.73
11	合计	2,765,025,699.85	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,816,776,276.13	65.71
2	固定收益	1,816,776,276.13	65.71
3	中期票据投资	619,462,705.80	22.40
4	其中：债券	619,462,705.80	22.40
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	47,500,191.25	1.72
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	233,481,821.48	8.44
10	其他资产	47,804,705.19	1.73
11	合计	2,765,025,699.85	100.00

2、交通银行网上银行、手机银行优惠(仅针对处于正常申购期的指定开放式基金 前端模式)申购手续费费率，不包括基金的后端模式以及处于基金募集期的开放式基金认购费率，同样不适用于基金定投业务及转换业务等其他业务的手续费率。  
3、交通银行将与本公司协商后决定上述优惠活动是否展期，并将另行公告相关事宜。  
4、本公告的最终解释权归交通银行所有，具体业务规则请遵循交通银行的有关规定。  
五、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况  
1、交通银行客户服务电话：95559；  
网址：www.bankcomm.com  
2、本公司客户服务中心电话：400-628-5888；  
网址：www.dl5888.com  
风险提示：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，也不保证最低收益。基金管理人管理的基金的业绩不构成对其他基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。  
特此公告。

东方基金集团有限责任公司  
2012年6月28日

股票代码：002492 证券简称：恒基达鑫 公告编号：2012-0033  
**珠海恒基达鑫国际化工仓储股份有限公司**  
**关于控股子公司取得国有土地使用证的公告**  
本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
珠海恒基达鑫国际化工仓储股份有限公司（以下简称“公司”）控股子公司扬州恒基达鑫国际化工仓储有限公司（以下简称“扬州恒基达鑫”）作为公司募投项目实施主体。2012年6月22日，公司就募投项目用地及建设进展情况进行了公告，对本公司变更募投项目用地情况进行了详细披露，说明了变更后募投项目用地为扬州新城区油港路以东、前进路以南、大港路以西、管窑以北的123亩工业用地（下称“新址地块”），并说明了新址地块国有土地使用权出让手续办理进展情况（供体内容请见公司《关于募投项目用地及建设进展情况的公告》）。  
2012年6月26日，扬州恒基达鑫收到《仪征市人民政府颁发的新址地块的国有土地使用证》，现将详情公告如下：  
一、土地使用证明的有关内容  
1. 证书编号：（仪国用 2012）第0910号；  
2. 土地使用权人：扬州恒基达鑫国际化工仓储有限公司；  
3. 座落：（仪征市）大港路；  
4. 地类（用途）：工业用地；  
5. 使用权类型：出让；  
6. 终止日期：2055年12月30日；  
7. 使用权面积：81897.04㎡；  
8. 颁发单位：（仪征市）人民政府；  
9. 颁发日期：2012年6月26日。  
二、备查文件  
①《中华人民共和国国有土地使用证》  
特此公告。  
珠海恒基达鑫国际化工仓储股份有限公司  
董 事 会  
二〇一二年六月二十八日

股票代码：002477 证券简称：雏鹰农牧 公告编号：2012-0145  
**雏鹰农牧集团股份有限公司**  
**关于股东股权质押的公告**  
本公司及董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。  
雏鹰农牧集团股份有限公司（以下简称“公司”）于近日收到股东侯建芳先生的通知，获悉其将所持有的公司有限售条件流通股66,000,000股（占公司总股本的12.36%）于2012年6月25日质押与中国工商银行股份有限公司新乡支行为公司融资提供担保，融资总额3亿元，融资期限三年，用于公司购买原料以及销售网络铺设费用。上述质押手续已在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司申请办理完毕，质押期限自质押登记日起至质押双方与中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司申请办理解除质押手续为止。  
截止本公告日，侯建芳先生持有公司有限售条件流通股247,860,400股，占公司总股本的46.42%，累计质押其持有的公司股份126,000,000股，占公司总股本的23.60%。  
特此公告。  
雏鹰农牧集团股份有限公司  
董 事 会  
二零一二年六月二十七日

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	18,064,200.00	0.66
B	采矿业	99,089,937.79	3.61
C	制造业	873,092,367.87	31.68
C0	食品、饮料	414,646,958.76	15.05
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	11,044,088.00	0.40
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,122,613.77	0.44
C5	电子	8,693,819.04	0.32
C6	金属、非金属	77,965,134.61	2.83
C7	玻璃、陶瓷、仪器	262,823,170.92	9.54
C8	医药、生物制品	85,796,382.77	3.11
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	9,669,046.00	0.35
E	建筑业	21,775,942.47	0.79
F	交通运输、仓储业	25,391,180.18	0.92
G	信息技术业	113,317,117.62	4.11
H	批发和零售业	40,970,995.10	1.49
I	金融、保险业	419,974,634.09	15.24
J	房地产业	162,066,894.89	5.88
K	公共事业	14,674,000.00	0.53
L	传播与文化产业	18,689,959.52	0.68
M	其他类	-	-
合计		1,816,776,276.13	65.92

3.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	600519	贵州茅台	1,250,000	246,200,000.00	8.93
2	601318	中国平安	5,000,000	182,900,000.00	6.64
3	000651	格力电器	7,499,972	152,474,430.76	5.53
4	000858	五粮液	4,499,899	147,776,683.34	5.36
5	600016	民生银行	20,000,000	125,400,000.00	4.55
6	601088	中国神华	2,999,439	76,828,437.79	2.79
7	600336	新华保险	2,454,711	70,474,752.81	2.56
8	002032	杰 伦 东	4,000,055	61,080,839.85	2.22
9	000022	广 利 A	6,000,000	49,680,000.00	1.80
10	002007	华兰生物	2,115,289	48,397,812.32	1.76

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	国债债券	255,454,692.10	9.27
2	央行票据	32,153,000.00	1.13
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	51,855,013.70	1.88
8	其他	-	-
9	合计	619,462,705.80	22.48

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	010308	03国债08	1,846,890	185,464,693.80	6.73
2	100137	10央行票据37	1,000,000	99,360,000.00	3.61
3	110108	11央行票据88	1,000,000	96,730,000.00	3.51
4	010203	02国债03	699,830	69,989,990.30	2.54
5	110104	11央行票据94	700,000	67,718,000.00	2.46

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明细  
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
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明细  
注：本基金本报告期末未持有权证。  
8.投资组合报告附注  
8.1 报告期内前十名股票中包括五粮液 股票代码：000858），根据五粮液股票发行主体宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月27日发布的公告，由于该公司存在信息披露不及时、不完整行为，中国证监会上市公司以及公司相关责任人员依法实施了警告和罚款的处罚。  
8.2 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.3 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.4 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.5 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.6 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.7 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.8 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.9 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.10 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.11 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.12 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.13 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.14 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.15 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.16 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.17 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.18 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.19 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.20 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.21 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.22 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.23 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.24 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.25 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.26 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.27 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.28 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.29 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.30 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.31 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.32 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.33 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.34 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.35 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.36 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.37 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.38 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.39 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.40 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.41 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.42 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.43 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.44 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.45 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.46 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.47 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.48 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.49 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.50 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.51 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.52 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.53 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.54 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.55 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.56 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.57 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.58 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.59 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.60 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.61 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.62 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.63 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.64 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.65 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.66 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.67 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.68 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.69 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.70 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.71 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.72 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.73 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.74 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.75 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.76 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.77 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.78 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.79 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.80 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.81 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.82 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.83 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.84 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.85 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.86 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.87 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.88 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.89 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.90 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.91 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.92 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.93 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.94 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.95 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.96 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.97 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.98 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
8.99 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.00 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.01 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.02 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.03 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.04 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.05 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.06 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.07 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.08 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.09 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.10 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.11 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.12 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.13 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.14 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.15 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.16 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.17 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.18 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.19 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.20 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.21 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.22 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.23 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.24 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.25 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.26 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.27 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.28 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.29 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.30 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.31 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.32 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.33 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.34 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.35 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.36 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.37 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.38 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.39 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.40 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.41 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.42 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.43 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.44 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.45 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.46 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.47 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.48 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.49 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.50 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.51 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.52 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.53 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.54 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.55 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.56 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.57 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.58 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.59 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.60 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.61 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.62 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.63 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.64 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.65 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.66 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.67 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.68 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.69 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.70 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.71 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.72 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.73 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.74 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.75 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.76 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.77 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.78 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.79 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.80 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.81 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.82 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.83 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.84 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.85 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.86 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.87 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.88 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.89 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.90 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.91 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.92 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.93 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.94 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.95 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.96 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.97 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.98 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
9.99 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。  
10.00 报告期内，本基金管理人未持有五粮液股票。

序号	名称	金额(元)
1	卖出资产证券	1,730,875.88
2	收回证券清算款	35,847,264.61
3	应收利息	-
4	应收股利	10,005,415.61
5	应收申购款	221,149.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,804,705.19

8.4.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	113002	工行转债	31,141,700.10	1.13
2	110015	石化转债	20,713,313.60	0.75

8.5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
8.6.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股票投资明细  
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
8.7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细  
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
8.8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细  
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
8.9.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细  
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
8.10.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细  
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
8