

2013 年度報告摘要

21	601006	大秦铁路	6,283,711.00	5.57
22	002167	东方电气	6,151,736.74	5.45
23	600519	贵州茅台	6,122,616.58	5.43
24	600279	太阳纸业	5,930,000.00	5.23
25	002005	德展集团	5,901,484.55	5.23
26	600318	巢东股份	5,867,977.76	5.20
27	000401	南玻集团	5,860,292.92	5.20
28	600279	太阳纸业	5,653,560.56	5.09
29	000887	伊泰股份	5,629,162.40	4.99
30	000406	昆明燃气	5,547,544.29	4.92
31	600506	中国铝业	5,507,766.57	4.88
32	600505	海南橡胶	5,489,296.03	4.86
33	000538	云南白药	5,457,531.08	4.84
34	600837	海南高速	5,435,977.76	4.83
35	601988	中国银行	5,396,798.63	4.74
36	002297	博林科技	5,235,949.93	4.64
37	000698	际华三彭	5,176,466.58	4.59
38	000963	汇川技术	5,176,332.00	4.58
39	000282	浙江东方	5,089,960.63	4.51
40	600429	三友集团	5,061,919.00	4.49
41	000629	攀钢钒钛	4,920,012.72	4.36
42	602352	中航光电	4,906,363.80	4.35
43	600549	厦工股份	4,882,972.13	4.34
44	000061	海信股份	4,825,850.00	4.28
45	601678	南京股份	4,806,307.94	4.26
46	000626	上海贝岭	4,813,281.12	4.24
47	002375	南方精工	4,809,015.24	4.07
48	601231	拓日新能	4,388,798.70	3.89
49	002033	恒信东方	4,382,019.26	3.88
50	000666	中国黄金	4,381,267.34	3.88
51	002049	国统股份	4,266,377.34	3.78
52	001088	中国神华	4,209,406.08	3.73
53	002022	科华数据	4,178,203.46	3.70
54	002008	百花集团	4,125,038.50	3.69
55	002288	富春电力	4,125,018.00	3.66
56	600801	华鲁能源	3,998,804.00	3.54
57	600754	锦江股份	3,934,720.16	3.48
58	600430	华鲁能源	3,884,281.32	3.47
59	001086	江齐科技	3,862,620.00	3.07
60	600104	上汽集团	3,439,483.15	3.05

62	002005	新华软件	3,338,011.40	2.98
63	000423	东南网报	3,305,324.00	2.93
64	002051	中广国际	3,296,553.44	2.92
65	000123	三花集团	3,232,567.74	2.88
66	002078	太阳纸业	3,199,915.55	2.84
67	000135	东软股份	3,161,280.60	2.81
68	000100	TCL集团	3,099,000.00	2.75
69	000400	宁波海运	3,063,001.76	2.74
70	300088	长信科技	3,031,888.36	2.69
71	002236	荣事达股份	2,979,370.81	2.57
72	000682	天津发展	2,875,420.00	2.55
73	000872	中航高化	2,851,227.00	2.53
74	000422	湖北宏信	2,841,427.00	2.52
75	000695	国兴证券	2,820,037.00	2.50
76	002511	中鼎股份	2,785,479.30	2.46
77	300016	南京药业	2,750,808.52	2.45
78	002069	锦州市港	2,750,102.00	2.44
79	002031	巨源股份	2,736,553.00	2.42
80	002091	金丰投资	2,730,668.17	2.41
81	002703	恒信金融	2,700,115.41	2.39
82	002061	朗信照明	2,688,075.56	2.38
83	001126	西昌电力	2,666,012.38	2.37
84	000038	龙净环保	2,613,196.75	2.32
85	002378	新荣股份	2,605,976.03	2.31
86	000876	新希望	2,596,445.00	2.30
87	000352	浙江东日	2,581,154.97	2.29
88	001238	广力集团	2,580,461.22	2.29
89	002447	康得新材	2,572,681.58	2.28
90	000012	南玻集团	2,547,123.00	2.27
91	000051	格力电器	2,543,131.00	2.26
92	002111	杭钢股份	2,526,773.73	2.24
93	000548	华联集团	2,525,161.95	2.24
94	000029	招商局	2,517,817.30	2.23

95	000203	海特高新	2,567,439.64	2.32
96	000739	辽宁成大	2,479,097.66	2.19
97	000835	浙江机电	2,447,444.46	2.18
98	000858	广 东 传 世	2,435,456.62	2.17
99	601717	明媒机	2,434,132.28	2.16
100	300030	阳普医疗	2,431,536.81	2.15
101	002438	永和股份	2,420,981.09	2.15
102	002294	信立泰	2,403,094.92	2.13
103	600317	西药转债	2,376,966.40	2.11
104	601699	景林转债	2,370,798.15	2.10
105	000702	华昌科技	2,366,553.14	2.10
106	000748	长信科技	2,361,158.00	2.09
107	000778	神州转债	2,352,264.02	2.08
108	000928	华 明 照 耀	2,297,549.36	2.03
109	601107	四川成渝	2,284,796.01	2.02

注：上述未清偿到期或应兑付金额（或发行时票面成交数），不包括相关交易费用。

注：上述未清偿到期或应兑付金额及应兑付的资产总额，单位：人民币元

买入股票成本（或）总额	593,173,322.48
卖出股票成本（或）总额	593,983,633.37

注：买入股票成本，是指买入股票所支付的对价（包括购买价款以及交易费用），不包括相关交易费用。

注：卖出股票成本是指卖出股票所取得的对价（包括卖出价款以及交易费用），单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	5,330,125.00	7.63
2	银行定期存款	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业债券	5,023,704.26	7.19
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
7	可转债	3,325,571.26	4.76
8	其他	-	-

8.6 基金资产净值				基金资产净值(人民币)	13,679,400.52	19.59
8.7 基金份额净值				基金份额净值(人民币)	1.00	19.59
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)	
1	019807	13国债07	25,000	2,487,750.00	3.56	
2	122126	11国债12	18,960	1,912,305.60	2.74	
3	126015	08国债15	15,000	1,409,100.00	2.08	
4	101308	国债1308	15,000	1,381,650.00	1.90	
5	019402	13国债02	10,000	1,000,300.00	1.43	
8.8 前十大重仓资产公允价值占基金资产净值比例大于前十大重仓资产公允价值支持证券投资明细 本基金本报告期末未持有支持证券。						
8.9 前十大重仓资产公允价值占基金资产净值比例大于前五大重仓资产公允价值支持证券投资明细 本基金本报告期末未持有支持证券。						
8.10 前十大重仓资产公允价值占基金资产净值比例大于前五大重仓资产公允价值支持证券投资明细 本基金本报告期末未持有支持证券。						
8.11 前十大重仓资产公允价值占基金资产净值比例大于前五大重仓资产公允价值支持证券投资明细 本基金本报告期末未持有支持证券。						
8.12 投资组合报告附注						
8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中,未被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况						
8.12.2 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中,未有被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况						
8.12.3 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中,未有被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况						
8.13 基金资产组合前十大重仓资产超出基金合同规定的备选股票列表						
序号	金额	单位(人民币)				
1 存出保证金	82,418.60					
2 应收证券清算款	-					
3 应收股利	-					
4 应收利息	273,631.02					

6	其他应收款			5,062,788.22
7	预收账款			-
8	其他			-
9	合计			3,985,820.84

8.1.2 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	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	965,300.00	1.38
2	110018	国电转债	843,767.00	1.21
3	113003	重钢转债	582,620.00	0.83
4	110015	石化转债	476,800.00	0.66
5	110020	南钢转债	453,630.00	0.65

8.1.2.2 期末前十名股票持仓存在流通受限情况的说明

8.1.2.2.1 报告期内所有股票持仓于报告期末不存在流通受限情况。

8.1.2.2.2 报告期内股票持仓的其他文字描述说明

-

§9 基金份额持有人信息

8.1.3 期末基金业绩持有人户数及持有人结构

		持有人结构		份额单位：	
持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者	个人投资者		
		持有份额	占份额比例	持有份额	占份额比例
6,452	11,290.20	13,625,918.39	18.98%	59,018,431.59	81.02%

9.2 期末基金资产净值的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总额(股)	占基金资产净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,142,104.80	2.94%

9.4 按投资组合类别披露基金份额持有人情况

项目	持有份额总额	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额户数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	1,539,117.00	2.11	1,400,342.78	1.92	3

[illegible][illegible]