

基金管理人：诺德基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于2010年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务数据未经审计。

本报告自2009年10月1日起至2010年12月31日止。

| § 2 基金产品概况 | |
|------------|---|
| 基金简称 | 诺德主题灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 571002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 89,886,755.65份 |
| 投资目标 | 本基金重点关注中国经济崛起过程中带来的结构性变化，及时把握宏观投资趋势，通过准确的主题配置和精选个股，追求资产长期稳定的增值，在有效控制风险的前提下为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的长期稳定回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过分析影响国家经济发展和行业发展的关键和趋势性因素，及时把握中国经济崛起过程中主题需求带来的投资机会，强调对上市公司基本面的深入研究，精心挑选主题演变中的优势企业。充分挖掘企业的投资价值基础上，确保一定的安全边际，进行中长期投资。 |
| 业绩比较基准 | 60%沪深300指数+40%中证主题指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为偏股型主题混合基金，风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。 |
| 基金管理人 | 诺德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2009年10月1日—2009年12月31日) |
|----------------|-----------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 2,612,302.93 |
| 2.本期利润 | 8,022,631.96 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1469 |
| 4.期末基金资产净值 | 112,210,246.25 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2484 |

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

2.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。

3.2 基金净值表现

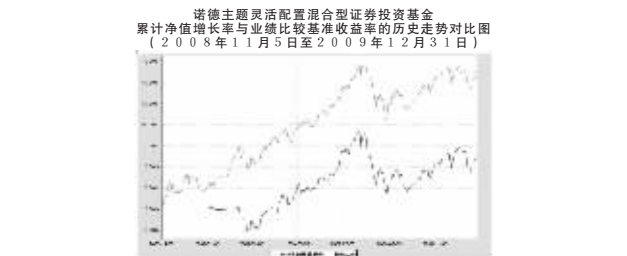
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 率① | 净值增长率 率标准差 ② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较 基准标准 差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------------------|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|-------|-------|
| 2009年10月1日至2009年12月31日 | 13.98% | 1.48% | 11.49% | 1.05% | 2.49% | 0.43% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

诺德主题灵活配置混合型证券投资基金

2009 第四季度报告



注：诺德主题灵活配置型证券投资基金成立于2008年11月5日，公示时间为2008年11月5日至2009年12月31日
 本基金建仓期间自2008年1月5日至2009年5月4日，报告期结束后资产配置符合本基金合同规定。

| § 4 管理人报告 | | | | |
|-----------------------------|-----------------------------|-------------|--------|--|
| 4.1 基金经理(或基金经理人)简介 | | | | |
| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理任期 | 证券从业年限 | 说明 |
| 戴富雷 | 本基金基金经理、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理 | 2008-11-5 | 7年 | 华中理工大学理学硕士，中欧国际工商学院 MBA，曾先后担任上海融昌资产管理公司研究部总经理、广州合盈资产管理公司研究总监等职。2006年6月加入诺德基金管理有限公司，先后担任研究员、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理助理、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺德基金管理有限公司投资部助理经理等职。戴富雷具有证券基金分析从业资格(CFA)资格。 |
| 张华东 | 本基金基金经理、诺德成长价值股票型证券投资基金基金经理 | 2009-2-22 | 12年 | 北京第二外国语学院经济学学士，1998年4月至2007年6月在华夏基金管理有限公司工作，先后担任研究员、基金经理助理等职务。2007年7月加入诺德基金管理有限公司，先后担任诺德成长价值股票型证券投资基金基金经理助理、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺德成长价值股票型证券投资基金基金经理等职。 |
| 4.2 基金经理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | | | | |

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，恪尽职守，勤勉尽责，安全高效的原理管理和运用基金资产，在风险可控的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

本公司已经建立了投资交易及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的权益。此外，本基金管理人还建立了公平交易制度，确保不同基金在某类同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司交易系统使用公用交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，不存在与诺德主题灵活配置基金风格类似的投资组合。公司旗下另三只基金产品分别为价值领先基金、成长型股票基金、债券型基金，四只基金的业绩不具有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

不存在不同投资组合之间的不公平交易情况。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

四季度以来国内经济复苏态势继续得到巩固和加强，但随着政策微调的再次出现，以及12月份货值的IPO，市场预期出现转变，整体上市股市场走势呈现前段逐步走高，后段高位震荡的态势，从行业来看，12月份市场热点主要集中在医药、食品饮料、机械、电气设备等行业，而政策扶持明确的周期性行业如汽车、家电、消费电子、餐饮旅游等行业表现偏弱。

基于对行情发展的基本判断，四季度首周本基金保持了高仓位运作，同时保持了较高的转债仓位，在四季度行情波动中及时调整仓位，较好地把握了行情发展的节奏；在行业方面，对能源、化工、消费、钢铁等行业进行重点投资。

景顺长城公司治理股票型证券投资基金

2009 第四季度报告



| 4 管理人报告 | | | | |
|---------|---------|-------------|--------|----|
| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理任期 | 证券从业年限 | 说明 |
| 邓春鸣 | 本基金基金经理 | 2008-10-22 | - | 7 |

复旦大学金融学硕士,CFA,曾任职于招商证券,2005年6月加入宝盈基金管理有限公司,历任行业研究员,基金助理助理,2007年5月加入本公司,任研究员,2007年9月至今任基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日期计算,“离任日期”为根据公司决定确定其不再担任该基金基金经理的“任职日期”和“离任日期”中较晚的日期;分别根据公司决定确定的聘任日期和离任日期计算。

2.基金经理的上述信息通过行业协会从业从业人员资格管理办发布的相关规定。

3.基金经理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则和有关规定,恪尽职守,依法诚实信用、勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.公平交易专项说明

4.1 公平交易专项制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应控制及流程,通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金投资组合。

4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,本基金管理人管理的其他基金的投资风格与本基金的投资风格不相似。

4.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度本基金根据宏观判断,减持了金融地产以及周期类资产,增持了稳定增长、估值合理的行业

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城公司治理股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体符合法规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人管理的其他基金的投资风格与本基金的投资风格不相似。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度市场在政策利好刺激下，减持了金融地产以及周期类资产，增持了稳定增长、估值合理的行业及个股。随着中国经济逐步减轻经济刺激力度，企业经济逐步显示出复苏迹象，我们认为，包括中国在内的全球市场将逐步走出两年前的巨大波动，企业和居民的投资及消费活动将在较为稳定的宏观背景下展开，同时发达国家的稳步复苏将给中国的出口相关行业带来稳定逐步复苏的外部环境。在此背景下，本基金将逐步集中投资于管理优秀、行业前景广阔、业绩增长空间较为明确、估值合理的个股。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末，本基金资产净值为1.487元，本报告期份额净值增长率为19.34%，同期业绩比较基准增长率为315.20%，超出业绩基准4.14个百分点。

| 姓名 | 职务 | 任职日期 | | | 限 | 说明 |
|-----|---------------------------------|----------|--------|----|---|----|
| | | 任期起始日期 | 任期终止日期 | 任期 | | |
| 毛从蓉 | 本基金基金经理 | 2005—4—6 | - | 10 | 毕业于华中理工大学经济学硕士,10年证券基金从业经历。曾任任职于交通银行、长城证券基金研究所、财信证券基金、金融研究所债券业务小组组长,2003年3月加入本公司,现任高级基金经理。 | |
| 张维荣 | 本基金基金经理, 跟踪长城创业板股票指数基金(LOF)基金经理 | 2009—7—2 | - | 10 | 清华大学工学工程博士。曾任鹏华证券研究所分析师,融通基金行业研究员,研究策划惠德基金基金经理,银华基金投资管理部策略分析员及基金经理等职务。具有9年证券、基金行业从业经历。2009年3月加入本公司。 | |

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 | 941,985.00 | 0.86 |
| B | 采掘业 | 5,462,940.00 | 4.99 |
| C | 制造业 | 39,608,344.48 | 36.15 |
| D | 食品、饮料 | 6,295,090.00 | 5.74 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,159,687.65 | 1.06 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 620,100.00 | 0.57 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 10,347,833.41 | 9.44 |
| C5 | 电子 | 2,656,512.00 | 2.42 |
| C6 | 金属、非金属 | 453,439.92 | 0.41 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 10,866,461.50 | 9.92 |
| C8 | 医药、生物制品 | 7,209,220.00 | 6.58 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,890,700.00 | 5.38 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 1,909,440.00 | 1.74 |
| H | 批发和零售贸易 | 13,603,493.01 | 12.41 |
| I | 金融、保险业 | 14,594,910.00 | 13.32 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 1,254,001.46 | 1.14 |
| L | 传播与文化业 | - | - |
| M | 综合类 | 2,985,673.56 | 2.72 |
| 合计 | | 86,251,487.51 | 78.71 |

5.3 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.6 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债券投资明细

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.7 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债券投资明细

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.8 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债券投资明细

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.9 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债券投资明细

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.10 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债券投资明细

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 3,499,911 | 136,636,525.44 | 2.00 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 7,500,000 | 135,375,000.00 | 1.98 |
| 8 | 000051 | 格力电器 | 4,396,708 | 127,240,729.52 | 1.86 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 3,500,000 | 121,870,000.00 | 1.78 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 3,000,000 | 119,670,000.00 | 1.75 |

5.11 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债券投资明细

| 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 | 601166 | 兴业银行 | 4,509,847 | 221,698,832.57 | 3.24 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 5,000,000 | 220,360,000.00 | 3.22 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100,000 | 186,802,000.00 | 2.73 |
| 4 | 002024 | 苏宁电器 | 3,89,345 | 173,509,883.00 | 2.54 |
| 5 | 000987 | 广州友谊 | 5,000,000 | 138,750,000.00 | 2.03 |