基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2011年3月30日

信诚增强收益债券型证券投资基金

[2010] 年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 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2011年3月29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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年9月29日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚增强收益债券封闭
基金主代码	165509
基金运作方式	契约型封闭式，本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期
基金合同生效日	2010年9月29日
基金管理人	信诚基金管理有限公司
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	2,266,065,663.27份
基金合同存续期	不定期，本基金合同生效后封闭期为三年(含三年)，基金合同生效三年以后，根据届时基金份额持有人大会的决议情况，本基金将进入下一个封闭期或转为上市开放式基金(LOF)。
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年11月8日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过主动管理，追求超越业绩比较基准的投资收益，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中债券、股票、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其战略性资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内作战术性资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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		信诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐世春	尹东
	联系电话	021-68649788	010-67595003
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年09月29日至2010年12月31日
本期已实现收益	8,260,872.20
本期利润	-3,363,868.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0015
本期基金份额净值增长率	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0015
期末基金资产净值	2,262,701,794.35
期末基金份额净值	0.999
3.1.3 累计期末指标	2010年末
基金份额累计净值增长率	-0.10%

注：1、已经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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同自2010年9月29日起生效，报告期为2010年9月29日至2010年12月31日。

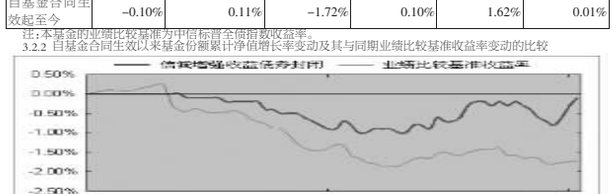
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-0.10%	0.11%	-1.77%	0.10%	1.67%	0.01%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.11%	-1.72%	0.10%	1.62%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准为中信标普全债指数收益率。

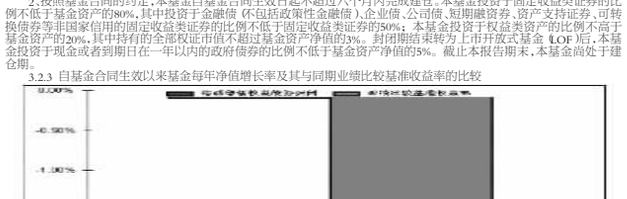
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、基金合同生效起至披露时点不满一年（本基金合同生效日为2010年9月29日）。

2、按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%，其中投资于金融债（不包括政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券等非国家信用的固定收益类证券的比例不低于固定收益类证券的50%；本基金投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%。封闭期结束转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金合同自2010年9月29日起生效。截至2010年12月31日，未进行过利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于2005年9月30日正式成立，注册资本2亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为49%、49%、2%。截至2010年底，本基金管理人共管理10只基金，分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚四季红债券型证券投资基金、信诚优胜优选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金和信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王旭巍	本基金基金经理、信诚经典优债债券型证券投资基金基金经理、固定收益总监	2010年9月29日	-	17	硕士。历任中国（深圳）物资工贸集团有限公司大连期货部经理，宏达期货经纪有限公司大连营业部经理、中信证券资产管理部投资经理、华宝兴业基金管理有限公司基金经理。曾在2003年7月15日至2009年3月30日期间担任华宝兴业宝康债券型基金基金经理，2005年3月31日至2007年2月28日担任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理。2010年3月加入信诚基金管理有限公司，担任固定收益总监。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同和招募说明书的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

针对中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司采取了一系列行动来落实指导意见中的各项要求。明确了各部门在公平交易执行中的具体责任，在日常交易中，严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的有关规定对本基金的日常交易行为进行监控。对于交易所公开竞价交易，在相生交易系统中执行公平交易程序，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。对于场外交易，通过业务流程的人为控制执行公平交易程序。

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

本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年4季度国内通胀水平超预期，引发市场恐慌，股市、债市踏之波动。央行频繁紧缩，动用的货币政策工具包括三次提高存款准备金率、二次加息等。央行于10月20日年内首次加息25个基点后债市收益率水平未能稳定下来，而是持续爬升。市场预支了接近4次加息的调整幅度，直至12月26日央行二度加息、年内最后一只货币紧缩的“靴子”落地才有所修复。

本基金2010年9月29日成立，10月份开始构建债券组合。起初建仓速度较快，10月20日前已构建超过20%债券仓位。此后成效缓了节奏，同时配置了20%以上短期融资券，该头寸因期限短，在升温期间中具有一定的御动能。权益类资产配置在5%左右，集中在大消费和新兴经济方面；可转债配置重点在银行、有色。11月下旬本基金增持基金最低跌至0.99元，主要是加息后债券组合资本利得投先所致，但截止2010年底净值恢复到0.999 水平，已弥补绝大部分损失，信用债仓位已达70%以上，业绩表现优于比较基准。由于进入加息周期、市场普遍看淡债市以及基金持有人结构等方面原因，本基金在二级市场交易价始其交易价格就有较大折价。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本基金自成立以来净值份额增长-0.10%，超越业绩基准1.62个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年，我们判断通胀水平高位运行在1季度仍然可控，宏观经济整体健康。相信央行会慎用加息手段，侧重使用汇率手段来应对输入型通胀，侧重运用提高存款准备金率或差别存款准备金率来对冲流动性，信贷规模管制则更加严厉，总体上2011年流动性较2010年更紧。鉴于以上判断，2011年我们的投资思路包含以下几方面。信用产品配置比例80%以上，债券投资以持有到期、获取票息收入为主，不刻意博取资本利得收益；债券组合久期控制在3左右，基本与本基金封闭期相匹配；适当运用资金杆杠进行放大操作。可转债将是重点投资项目，2011年我们将加强研究和跟踪，积极配置、波段操作，谋求获得超额收益。股市2011年难有单边行情，权益类投资仍以绝对收益为主。中小板、创业板新股发行办法自2010年11月实施改革以来，其风险收益特征发生重大改变，不再是稳定收益来源，并且此番改革未见新股发行“三高”热度减退，隐含的风险较大，因此不将其作为投资重点，但仍将积极参与主板新股申购。

2011年我们将恪尽职守，勤奋工作，在控制风险、保障本金安全前提下提高基金收益率，达到或超过通胀水平，努力实现基金持有人资产保值增值的投资目标。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过建立估值决策委员来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员：首席运营官（会议主席）、副首席运营官、风险控制总监/专员、数量研究员、交易总监、运营总监、基金会计主管。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、估值风险、估值工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见，确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值决策委员会。

在每个估值日，本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法，确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，基金托管人按照托管协议中《基金资产净值计算和会计核算》确定的规则复核，复核无误后，由基金管理人对外公布。

2.基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗，所有业务操作需经复核方可生效。

基金份额净值公告需经处理估值的操作人员、复核估值的复核人员和基金运营总监三人确认后，方可对外发布。

3.基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有会计上岗证和基金从业人员资格。

本基金管理人的估值人员平均拥有6年金融从业经验和3年本基金管理公司的基金从业和基金估值经验。

4.基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离，基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注，在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时，将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议，通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

1.本基金每份基金份额享有同等分配权；

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。在开放期内，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额（具体日期以本基金分红公告为准）；

3.在符合有关基金分红条件的前提下，封闭期间，本基金收益每年至少分配一次，每年基金收益分配比例不低于该年度已实现收益的90%；转为上市开放式基金（LOF）后，本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于该收益分配基准日可供分配利润的25%；

4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5. 基金合同生效满6个月后，若基金在每季度最后一个交易日收盘后每10份基金份额的可供分配利润高于0.04元（含），则基金须依据以下第7项原则确定的时间要求进行收益分配，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的25%（每份基金份额的最小分配单位为0.1分）；

6.封闭期间，基金收益分配采用现金分红方式；开放期间，登记在注册登记系统的基金份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（具体日期以本基金分红公告为准）；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金红利方式，不能选择红利再投资；具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

7.基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；

8.基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

9.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计的变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.6 税项

根据财税字〔1998〕55号文、财税〔2001〕61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字〔2005〕11号文《关于调整证券〔股票〕交易印花税税率的通知》、财税〔2005〕102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税〔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》、财税〔2005〕107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税〔2007〕84号文《财政部国家税务总局关于调整证券〔股票〕交易印花税税率的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2）基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

（3）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

（4）对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，自2005年6月13日起，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计算个人所得税。

（5）自2005年1月24日起，基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.1%的税率征收证券〔股票〕交易印花税。自2007年5月30日起，该税率上调至0.3%。自2008年4月24日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，调整证券〔股票〕交易印花税税率，由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，证券交易印花税改为单边征收，即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收。（6）对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注：下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期内没有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月29日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,025,425.64
其中：支付销售机构的客户维护费	404,258.63

注：支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值0.7%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月29日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,150,121.65

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值0.2%/当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本期间未与其他关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。本基金的基金管理人在本期间未投资过本基金。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信信托有限责任公司	8,650,145.00	0.38%

注：1.除上表所示外，本基金其它关联方在本期末未持有本基金。

2.除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

7.4.8.5 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9月29日（基金合同生效日）至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	4,908,944.08	496,294.68

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2010年12月31日的相关余额为人民币15,705,550.23元，结算备付金当期的利息收入为人民币53,138.62元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.9 期末2010年12月31日本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至2010年12月31日，本基金期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药业	2010-12-28	配股期间停牌	19.71	2011-01-06	17.29	300,000	6,747,320.40	5,913,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至2010年12月31日，本基金不存在未到期的银行间市场正回购交易。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额285,000,000.00元，于2011年1月4日、6日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§8 投资组合报告

8.1 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	115,438,203.00	4.50
	其中：股票	115,438,203.00	4.50
2	固定收益投资	1,616,641,929.80	63.08
	其中：债券	1,616,641,929.80	63.08
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	790,001,545.00	-
	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	20,614,494.31	0.80
6	买入返售金融资产	790,001,545.00	30.82
7	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	其他各项资产	20,172,187.93	0.79
9	合计	2,562,868,360.04	100.00

8.2 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	100,513,448.00	4.44
C0	食品、饮料	11,200,000.00	0.49
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	7,948,800.00	0.35
C5	电子	36,001,625.00	1.59
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	12,396,023.00	0.55
C8	医药、生物制品	32,967,000.00	1.46
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	14,924,755.00	0.66
H	批发和零售贸易	-	-
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	115,438,203.00	5.10

8.3 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

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	002129	中环股份	700,000	19,551,000.00	0.86
2	000538	云南白药	300,000	18,120,000.00	0.80
3	000669	领先科技	391,100	12,534,755.00	0.55
4	002304	洋河股份	50,000	11,200,000.00	0.50
5	600276	恒瑞医药	150,000	8,934,000.00	0.39
6	002236	大华股份	100,000	8,388,000.00	0.37
7	002106	莱宝高科	121,700	8,062,625.00	0.36
8	000792	盐湖钾肥	120,000	7,948,800.00	0.35
9	600580	卧龙电气	353,700	5,938,623.00	0.26
10	600518	康美药业	300,000	5,913,000.00	0.26

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.citicprufunds.com.cn网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002129	中环股份	20,111,738.05	0.89
2	000538	云南白药	19,410,323.73	0.86
3	000669	领先科技	12,839,946.62	0.57
4	002304	洋河股份	10,987,655.93	0.49
5	002236	大华股份	9,329,916.00	0.41
6	600079	人福医药	8,661,656.50	0.38
7	000792	盐湖钾肥	8,054,695.20	0.36
8	600276	恒瑞医药	8,045,375.00	0.36
9	002106	莱宝高科	7,341,153.00	0.32
10	600050	中国联通	6,928,230.00	0.31
11	600518	康美药业	6,747,320.40	0.30
12	600580	卧龙电气	6,382,279.00	0.28
13	000536	闽闽东	4,451,255.56	0.20
14	000707	双环科技	3,610,593.47	0.16
15	600998	九州通	3,494,423.55	0.15
16	600525	长园集团	3,098,249.70	0.14
17	300150	世纪瑞尔	2,910,000.00	0.13
18	002123	荣信股份	1,974,605.00	0.09
19	000858	五 粮 液	1,894,000.00	0.08
20	000568	泸州老窖	1,349,583.80	0.06

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600079	人福医药	8,828,431.80	0.39
2	600050	中国联通	7,067,787.00	0.31
3	000707	双环科技	3,721,438.97	0.16
4	600998	九州通	3,541,079.20	0.16
5	600525	长园集团	3,277,274.74	0.14
6	002129	中环股份	3,052,536.00	0.13
7	000858	五 粮 液	1,900,033.00	0.08
8	000568	泸州老窖	1,260,025.00	0.06
9	000650	仁和药业	747,500.00	0.03
10	000785	武汉中商	625,856.00	0.03
11	000669	领先科技	431,993.00	0.02
12	002493	荣盛石化	58,300.00	-
13	601777	力帆股份	36,800.00	-
14	300134	大富科技	28,800.00	-
15	002500	山西证券	26,500.00	-
16	601098	中南传媒	24,960.00	-
17	300138	晨光生物	18,850.00	-
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	149,096,804.51
卖出股票收入（成交）总额	34,648,164.71

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：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	949,193,229.80	41.95
5	企业短期融资券	478,341,000.00	21.14
6	可转债	189,107,700.00	8.36
7	其他	-	-
8	合计	1,616,641,929.80	71.45

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08石化债	1,821,500	162,149,930.00	7.17
2	126016	08宝钢债	1,670,100	146,417,667.00	6.47
3	113002	工行转债	950,000	112,233,000.00	4.96
4	122871	10镇交投	1,000,000	100,000,000.00	4.42
5	1080115	10招黄酒债	900,000	88,227,000.00	3.90

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，没有被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.9.2 本基金本报告期末未持有股票投资，没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	9,685,000.08
3	应收股利	-
4	应收利息	10,487,187.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,172,187.93

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	10,436,700.00	0.46
2	125731	美丰转债	2,532,600.00	0.11

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600518	康美药业	5,913,000.00	0.26	配股期间停牌

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,181	366,618.45	1,735,141,794.27	76.57%	530,922,869.00	23.43%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国出口信用保险公司	200,028,000.00	35.62%
2	东航集团财务有限责任公司	50,007,000.00	8.90%
3	光大永明人寿保险有限公司	35,004,900.00	6.23%
4	国泰君安-建行-国泰君安君得惠债券集合资产管理计划	30,004,200.00	5.34%
5	海康人寿保险有限公司	28,907,476.00	5.15%
6	中信证券-中信-中信理财2号集合资产管理计划	20,001,600.00	3.56%
7	长江金色晚晴（集合型）企业年金计划-浦发银行	15,122,700.00	2.69%
8	东证资管-工行-东方红现金宝集合资产管理计划	12,943,129.00	2.30%
9	光大永明人寿保险有限公司	10,001,400.00	1.78%
10	光大永明人寿保险有限公司	10,001,400.00	1.78%
11	中信证券-中信-中信证券债券优化集合资产管理计划	10,001,400.00	1.78%

注：持有人为场内持有