

[illegible]

本招募说明书自2020年11月1日至12月31日止。	
§ 2 基金简介	
基金名称	宝盈核心优势混合
基金代码	213006
交易代码	213006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月17日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
截至期末基金份额总额	128,406,396.71
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	基金投资于沪深A股等具有良好成长性、具有良好基本面、具备较强核心竞争力、估值合理的上市公司股票，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	1. 资产配置策略 基金将根据宏观经济运行状况、政策、利率、估值、国家产业政策及证券市场投资监管政策调整、市场资金供求状况、决定股票、债券及现金的配置比例。 2. 股票投资策略 根据上市公司基本面估值、股票预期收益率估值、市场公允价值中具备性价比、具有成长性、具有良好基本面、具备较强核心竞争力、估值合理的上市公司股票，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期增值。 3. 债券投资策略 基金将采取自上而下投资策略，运用利率期限、久期管理、收益率曲线策略、相对价值评估、信用分析策略、新发债券发行以及运用固定收益证券组合等积极的投资策略，力求获得超越基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数x65%+上证国债指数x35%
风险收益特征	本基金是一只股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险及收益品种，本基金的风险收益特征高于货币型基金、债券型基金、混合型基金及保本型基金。

2.3 基金管理人基本情况		选择严格的风险管理，当风险评级范围内追求收益最大化。	
项目	基金管理人	基金托管人	
名称	华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名 联系电话 电子邮箱	0755-83276688 sunsh@hfunds.com 95566	
客户服务电话	040-8888-300 0755-83115999	cs@bank-of-china.com.cn 95566	
网址	www.hfunds.com	www.boc.cn	
2.4 信息披露方式			
载基金年度报告正文的资产管理人互联网网址		www.hfunds.com	

3.1 主要会计数据和财务指标		主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况				
		金额单位:人民币元				
3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年3月17日(基金合同生效日) 至2009年12月31日				
本期已实现收益	1,461,479.03	53,215,082.96				
本期利润	-7,872,882.03	58,589,410.63				
加权平均基金份额本期利润	-0.0480	0.1692				
本期基金份额净值增长率	-5.19%	20.44%				
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末				
期末可分配基金份额利润	-0.0518	0.0001				
期末基金资产净值	121,751,090.00	197,104,523.58				
期末基金份额净值	0.9482	1.0001				
注:1、本期已实现收益是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。						
2、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、期末基金份额净值不等于人民币1.00元的基金份额净值,计入费用后实际收益水平要高于所列数据。						
3.2 基金净值表现						
3.2.1 基金净值增长率及其与同期基金业绩比较基准的对比						
阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准差率③	业绩比较基准差率标准差④	①-③	②-④
最近三个月	3.66%	1.56%	4.33%	1.15%	-0.87%	0.41%
过去六个月	19.96%	1.34%	14.41%	1.01%	5.55%	0.42%
过去一年	-5.19%	1.34%	-6.64%	1.03%	1.45%	0.13%
自基金合同生效起至今	14.19%	1.29%	78.06%	1.14%	-13.87%	0.15%

3.2.2 自基金份额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

华夏安心优势灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图
2009年3月17日至2010年12月31日

The chart displays two data series: the cumulative net value growth rate of the fund (represented by a solid line) and the benchmark (represented by a dashed line). The x-axis represents time from March 17, 2009, to December 31, 2010, with major ticks every six months. The y-axis represents the percentage growth rate, ranging from -10% to 40% in 5% increments. Both lines show a general upward trend with significant fluctuations. The fund's performance is consistently above the benchmark, with a peak of approximately 35% in late 2009 and a low of about -5% in early 2010. By the end of 2010, the fund's growth rate is around 25%, while the benchmark is around 15%.

注：视基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起第66个月内建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

3.2.3 合同生效日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

本基金核心投资策略配置适当，投资收益率基金合同生效日以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的柱状对比图

年份	基金净值增长率 (%)	业绩比较基准收益率 (%)
2014	~5.5	~4.5
2015	~8.5	~7.5
2016	~1.5	~1.0

年度	每10份基金份额 派分红金	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009	2.000	27,489,704.62	13,185,384.58	40,675,089.20	
合计	2.000	27,489,704.62	13,185,384.58	40,675,089.20	

[illegible][illegible][illegible]

宝盈核心优势灵活配置
【2010】年

本报告书对资产负债表、净利润表、收益分配情况、财务费用、投资、财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分在资产负债表附注中，投资组合报告等项披露，准确和完整。

§ 6 审计意见

本报告期内年度财务审计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字 2011 第 2002 号无保留意见审计报告，投资者可通过该年度财务审计报告查看审计意见全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宜信诚信优势风险配置混合型证券投资私募基金
报告截止日：2010年12月31日

资产	本期末 2009年12月31日	上年度末 2009年12月31日
货币存款	28,212,145.78	13,699,297.92
银行存款	839,615.10	1,536,048.62
衍生资产	750,000.00	750,000.00
交易性金融资产	99,563,840.00	188,275,689.38
其中：股票投资	79,448,900.00	154,779,918.38
基金投资	—	—
债券投资	20,114,940.00	33,495,771.00
资产支持证券投资	—	—
衍生金融负债	—	—
买入返售金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	237,094.43	349,316.29
应收股利	—	—
应收申购款	33,104.91	1,411,847.35
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—

资产/负债	2009年12月31日	2008年12月31日
货币：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
未到期金融流动资产	-	-
应付证券清算款	6,277,301.18	5,159,651.65
应付赎回款	68,425.77	1,576,649.35
应付管理人报酬	159,374.54	238,197.22
应付托管费	26,562.45	39,699.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	482,637.05	1,117,536.09
应付税金	70,261.60	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
预提所得税负债	-	-
递延所得税负债	800,147.33	805,942.13
负债合计	7,884,709.92	8,937,675.98
所有者权益：		
实收基金	128,406,396.71	197,080,192.48
未分配收益	-6,655,406.71	24,331.10
所有者权益合计	121,751,000.00	197,104,523.58
负债和所有者权益总计	129,635,799.92	206,042,199.56

2009年12月31日资产负债表(2009年12月31日,基金余额10,948.92元,基金余额12,409,396.71元)
 2. 比较财务报表的实际编制期间为2009年1月1日至2009年12月31日
 会计主体: 嘉实核心成长灵活配置混合型证券投资基金
 比较财务报表的编制期间: 2009年1月1日至2009年12月31日

项目	2010年1月1日至2010年12月31日	单位:人民币百万元	
		上年同期可比数据	2009年3月17日(合并含生息日至)至2009年12月31日
一、收入	269,815.70	68,191,908.87	68,191,908.87
1.利息收入	854,838.90	1,585,190.12	1,585,190.12
其中:存款利息收入	168,553.56	1,318,236.42	1,318,236.42
债券利息收入	686,485.40	266,954.41	266,954.41
其中:支付证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2.其他收入(损失)以“减列”	8,620,563.86	69,487,627.73	69,487,627.73
其中:管理费投资收益	8,341,065.47	58,644,244.87	58,644,244.87
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	-180,561.87	5,257.87	5,257.87
资产支持证券投资收益	-	-	-
衍生工具收益	-	-	-
投资收益	460,060.26	1,838,125.56	1,838,125.56
3.公允价值变动收益(损失)以“减列”	-9,334,361.06	5,374,327.67	5,374,327.67
4.交易(损失)以“减列”	-	-	-
5.其他收入(损失)以“减列”	128,773.94	944,763.33	944,763.33
二、费用	8,142,697.73	9,802,498.48	9,802,498.48
1.管理费用	2,275,183.86	4,172,860.41	4,172,860.41
2.销售费用	379,137.34	665,576.67	665,576.67
3.销售服务费	-	-	-
4.交易费用	5,116,172.22	4,648,220.20	4,648,220.20
5.其他支出	-	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-	-
6.其他费用	372,144.31	285,941.47	285,941.47
三、利润总额(亏损总额)以“减列”	-7,872,882.03	58,589,410.00	58,589,410.00
减:所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损)以“减列”	-7,872,882.03	58,589,410.00	58,589,410.00

项目	2010年1月1日至2010年12月31日		2009年1月1日至2009年12月31日	
	实收基金	未分配利润	实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益(基金净值)	197,080,102.48	24,331.10	197,104,523.27	24,331.10
二、本期损益情况	-	-7,872,882.03	-	-7,872,882.03
1.本期权益法核算产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-	-
2.本期基金申购及赎回产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-68,673,795.77	1,193,244.22	-67,480,551.55	1,193,244.22
其中:基金申购款	54,082,212.19	-1,502,901.03	53,179,311.31	-1,502,901.03
3.基金赎回款	-123,356,007.96	2,606,145.22	-120,659,862.86	2,606,145.22
其中:基金赎回款	-	-	-	-
三、期末所有者权益(基金净值)	128,406,396.71	-6,645,306.71	121,751,090.00	-6,645,306.71
项目	2009年3月1日至(基金合同生效日)2009年12月31日		2009年1月1日至2009年12月31日	
	实收基金	未分配利润	实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益(基金净值)	767,687,900.00	-	767,687,900.00	-
二、本期损益情况	-	58,589,410.63	-	58,589,410.63
1.本期权益法核算产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-	-
2.本期基金申购及赎回产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-579,607,707.88	117,889,393.33	-597,497,088.33	117,889,393.33
其中:基金申购款	72,127,564.66	6,026,481.83	78,104,045.63	6,026,481.83
3.基金赎回款	-531,875,272.34	-23,916,471.63	-555,701,303.96	-23,916,471.63
其中:基金赎回款	-	-	-	-
三、期末所有者权益(基金净值)	197,080,102.48	24,331.10	197,104,523.27	24,331.10

[illegible]

宝盈基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中依信托有限责任公司	基金管理人股东
成都工业投资集团有限公司	基金管理人股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人股东

7.4.8.1 报告期内, 本基金可参与的所有关联方交易	433,496.38
7.4.8.2 关联方交易金额	433,496.38
7.4.8.3 关联方交易占基金资产净值的比例	0.25%
7.4.8.4 关联方交易占基金资产净值的比例	0.25%

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年3月17日(基金合同生效 日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,275,183.86	4,172,360.82
其中: 支付给机构客户的托管费	324,694.95	433,496.38

注: 关联方交易金额中支付给机构客户的基金托管费是指本基金托管人宝盈基金管理有限公司按照托管费1.5%的费率计提, 且计提至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 基金托管费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年3月17日(基金合同生效 日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	379,197.34	605,476.69

注: 关联方交易金额中支付给机构客户的基金托管费是指本基金托管人宝盈基金管理有限公司按照托管费1.5%的费率计提, 且计提至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 基金托管费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年3月17日(基金合同生效 日)至2009年12月31日
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额 基金买入 基金卖出 交易金额	基金正回购 基金正回购 交易金额
中国银行	-- -- --	-- -- --

项目	本期 2009年3月17日(基金合同生效日)至2009年12月31日	上年度可比期间 2009年3月17日(基金合同生效日)至2009年12月31日
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额 基金买入 基金卖出 交易金额	基金正回购 基金正回购 交易金额
中国银行	10,213,513.515 -- --	-- -- --

7.4.8.5 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.6 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.7 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.8 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.9 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.10 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.11 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.12 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.13 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.14 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.15 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.16 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.17 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.18 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.19 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.20 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.21 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.22 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.23 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.24 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.25 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.26 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.27 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.28 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.29 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.30 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.31 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.32 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.33 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.34 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.35 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.36 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.37 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.38 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.39 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.40 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.41 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.42 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.43 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.44 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.45 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.46 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.47 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.48 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.49 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.50 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.51 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.52 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.53 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.54 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.55 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.56 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.57 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.58 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.59 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.60 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.61 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.62 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.63 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.64 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.65 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.66 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.67 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.68 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.69 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.70 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.71 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.72 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.73 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.74 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.75 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.76 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.77 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.78 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.79 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.80 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.81 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.82 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.83 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.84 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.85 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.86 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.87 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.88 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.89 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.90 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.91 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.92 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.93 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.94 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.95 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.96 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.97 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.98 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.99 关联方交易金额占基金资产净值的比例

7.4.8.100 关联方交易金额占基金资产净值的比例

[illegible]

混合型基金资产净值表			
度 报 告 摘 要			
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	3,948,000.00	3.24
B	采矿业	6,670,000.00	3.84
C	制造业	37,024,600.00	30.41
C0	食品、饮料	8,655,500.00	7.11
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	918,000.00	0.75
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	6,431,000.00	5.28
C7	机械、设备、仪器	9,688,300.00	7.86
C8	医药、生物制品	2,160,200.00	1.78
C99	其他制造业	4,173,600.00	3.43
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,633,800.00	6.27
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	3,597,200.00	2.95
G	信息技术业	11,682,300.00	9.60
H	批发和零售贸易	7,132,000.00	5.86
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	3,757,000.00	3.09
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		79,448,900.00	65.26
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	600050	中国联通	1,200,000	6,420,000.00	5.27
2	600479	开平铝业	310,000	4,564,700.00	4.68
3	600178	东方动力	450,000	5,256,000.00	4.32
4	000297	宋都股份	250,000	4,140,000.00	3.44
5	002345	潮宏基	120,000	4,173,600.00	3.43
6	600108	亚星集团	620,000	3,948,000.00	3.24
7	601188	东方航空	460,000	3,938,000.00	3.12
8	601117	中国化学	650,000	3,757,000.00	3.09
9	601179	中国铝业	470,000	3,713,000.00	3.05

6. 600616 金发科技 280,000 3,640,000.00 2.99		8. 报告期内投资控股公司的大股东		http://www.jydata.com.cn/ 2020年12月31日	
8. 报告期内买入卖出回购金融资产总额		246,000.00 占期末总资产比例		2.00%	
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末总资产比例(%)	金额单位:人民币元
1	600479	千金药业	37,225,879.28	18.89	
2	600316	伟创信通	35,391,696.25	17.86	
3	000875	云铝股份	33,685,010.94	17.09	
4	600096	云天化	31,645,795.94	16.06	
5	600178	东安动力	30,821,535.85	15.64	
6	600500	中国铁建	28,188,237.25	14.30	
7	600328	哈药集团	27,256,837.26	13.83	
8	600118	中国广核	25,832,594.57	13.11	
9	000232	恒祥信息	24,989,117.11	12.68	
10	600601	铜板街有色	24,475,156.24	12.42	
11	000611	东方电机	24,340,301.58	12.35	
12	600391	成发科技	21,825,513.44	11.07	
13	600737	中航电子	21,203,921.89	10.76	
14	002336	人人生	19,368,579.56	9.83	
15	000800	一汽轿车	19,249,376.82	9.77	
16	000660	中金黄金	18,128,958.13	9.01	
17	600141	兴发集团	18,743,838.13	9.45	
18	600990	西陇药业	18,636,019.57	9.51	
19	000825	新疆广汇	18,466,636.82	9.37	
20	600028	中国石化	18,279,821.24	9.27	
21	600677	航天通信	15,451,516.25	8.85	
22	601628	中国人寿	14,632,030.69	8.84	
23	601166	兴业银行	17,414,168.12	8.83	
24	600085	同仁堂	14,933,624.63	8.60	
25	600677	山东海龙	16,321,709.54	8.53	
26	600111	包钢稀土	16,622,674.42	8.23	
27	000890	山东黄金	16,000,019.42	8.12	
28	600809	韩爱电子	14,997,989.07	7.56	
29	000432	吉雷股份	14,529,104.44	7.37	
30	600527	美都能源	14,353,501.49	7.28	
31	001958	金川股份	13,877,674.72	7.04	
32	600271	航天信息	13,871,128.44	7.04	
33	600651	格力电器	13,536,987.48	6.87	
34	600000	浦发银行	13,198,604.88	6.70	
35	000759	中航光电	13,004,185.53	6.60	
36	600362	江苏南钢	12,591,371.78	6.39	
37	601318	中国平安	12,465,662.27	6.32	
38	600166	金城医药	12,300,421.53	6.24	
39	000911	大连港集团	12,260,417.76	6.22	
40	600198	北矿集团	11,980,330.55	6.08	
41	000522	白云山A	11,954,137.91	6.01	
42	000905	厦门水务	11,852,961.97	6.06	
43	601189	北京银行	11,500,586.97	5.83	
44	000423	烟台万润	11,461,497.78	5.81	
45	601168	西部矿业	11,410,449.36	5.79	

46	601880	中国国航	11,058,040.40	5.61
47	600858	海通工程	11,035,255.17	5.60
48	601668	中国能建	10,732,782.57	5.45
49	002045	广联发展	10,689,264.60	5.42
50	600879	航天电子	10,682,908.53	5.42
51	601866	中海集运	10,503,894.94	5.31
52	000768	海南高速	10,476,215.48	5.32
53	601857	中国广核	10,471,320.92	5.33
54	000063	中兴通讯	10,443,400.94	5.30
55	600108	亚盛集团	10,409,343.23	5.28
56	600332	广州药业	10,316,821.04	5.23
57	000660	国电南自	10,227,776.36	5.19
58	600837	海通证券	10,219,700.08	5.18
59	000058	五 粮 液	10,110,989.10	5.13
60	000792	盐湖钾肥	9,881,226.79	5.01
61	000099	华彬国际	9,659,359.34	4.90
62	002251	步步高	9,645,438.74	4.89
63	600997	开滦股份	9,615,928.18	4.88
64	600900	长江电力	9,574,333.34	4.86
65	000807	云南股份	9,560,707.37	4.85
66	600036	招商银行	9,443,439.64	4.79
67	002053	中航地产	9,406,155.36	4.77
68	600790	侨拓集团	9,369,472.57	4.75
69	000612	焦作万方	9,314,316.70	4.73
70	002008	大秦铁路	9,300,535.45	4.72

71	000996	中国铝业	9,165,891.85	4.65
72	600090	华安证券	9,112,618.02	4.62
73	600090	啤酒花	8,736,443.35	4.48
74	000933	神火股份	8,667,669.69	4.39
75	600480	海康股份	8,660,305.80	4.40
76	000808	中国铁建	8,333,390.25	4.23
77	601299	中远海运	8,152,912.12	4.14
78	000002	万科A	8,147,656.93	4.13
79	600345	长江通信	8,101,113.71	4.11
80	600030	中信证券	8,098,721.40	4.11
81	000635	东方特钢	7,865,411.42	3.99
82	300002	神州泰丰	7,518,460.43	3.81
83	002387	莱牛食品	7,459,087.15	3.78
84	600188	洛阳钼业	7,383,377.31	3.75
85	600825	海螺集团	7,174,576.75	3.64
86	002261	招商局港口	6,938,560.72	3.53
87	600418	江淮汽车	6,948,346.30	3.51
88	002306	南磨房	6,914,196.77	3.53
89	002286	豫园股份	6,884,760.63	3.48
90	600184	光电股份	6,713,403.61	3.41
91	600019	宝钢股份	6,588,891.10	3.34
92	000720	ST顺山	6,566,695.57	3.32
93	600657	信达地产	6,424,557.30	3.26
94	002097	山西智能	6,352,764.34	3.22
95	000899	九芝堂	6,082,598.93	3.09
96	600408	华鲁恒升	5,084,213.24	3.04

97	002029	鹏飞光电	5,945.115,65	3.02
98	601618	中国中冶	5,651.070,01	2.87
99	601788	光大证券	5,593.660,46	2.84
100	002321	南 方	5,286.961,71	2.68
101	600859	王府井	5,278.007,20	2.68
102	600748	上海发展	5,269.673,63	2.67
103	000959	鲁商股份	5,234.432,48	2.66
104	000748	长城铝业	5,215.186,05	2.65
105	002376	航世行	5,309.065,32	2.64
106	600016	新华银行	5,125.659,00	2.60
107	300033	奥飞娱乐	5,096.763,04	2.59
108	002148	北汽通信	5,005.851,88	2.54
109	600060	海信电器	4,989.953,76	2.53
110	600054	广汇集团	4,973.310,03	2.52
111	002360	华 联	4,952.702,47	2.51
112	600122	宏图高科	4,923.018,77	2.50
113	600189	天象集团	4,897.552,52	2.48
114	000828	鞍钢股份	4,849.312,05	2.46
115	601106	华 电	4,803.593,00	2.44
116	600765	中航重机	4,770.433,05	2.43
117	300009	安纳生物	4,717.513,86	2.39
118	600475	华信新材	4,715.540,58	2.39
119	600505	神州出版	4,617.257,17	2.34
120	000547	闽闽东A	4,580.579,05	2.32
121	600183	生益科技	4,325.455,70	2.19
122	601001	宝钢股份	4,293.054,82	2.18
123	600104	上海汽车	4,258.399,79	2.16
124	002345	康芝药业	4,252.641,00	2.16
125	600166	福耀汽车	4,234.038,50	2.15
126	600448	华 北	4,229.590,40	2.15
127	000675	中华企业	4,220.433,83	2.14
128	600216	三金食品	4,211.304,32	2.14
129	600590	康美药业	4,023.492,59	2.04
130	002055	莱钢股份	3,991.384,28	2.03
131	300018	中元光电	3,950.384,82	2.00

表 8.4 某上市公司前十大股东持股量及资产净值 2% 或更多的股票明细				金额单位：人民币百 元（¥）
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占前十大金融资产净值的比例
1	600316	洪都航空	40,193,330.81	20.39
2	600050	中国联通	36,588,868.90	18.56
3	600038	哈飞股份	33,681,506.16	17.09
4	000878	云南铜业	32,610,938.12	16.44
5	603479	千金药业	32,467,983.18	16.47
6	600966	云铝股份	31,388,980.94	15.93
7	601118	中国卫星	27,992,668.74	14.20
8	601628	中国人寿	27,869,216.89	14.14
9	600028	中国石化	27,863,119.47	14.14
10	000901	航天科技	25,764,552.80	13.07
11	000792	盐湖钾肥	25,584,971.44	12.98
12	601078	东方特钢	25,423,915.45	12.90
13	002232	白云金矿	24,697,021.50	12.53
14	000630	铜陵有色	24,278,014.86	12.32
15	600391	成发科技	23,541,388.98	11.94
16	600141	兴发集团	23,087,513.55	11.71
17	600737	中航光电	21,269,326.77	10.79
18	601857	中国石油	20,596,142.31	10.45
19	000651	格力电器	20,546,681.97	10.42
20	600837	海通证券	19,414,401.05	9.85
21	000060	中金岭南	18,662,979.45	9.47
22	002336	人人乐	18,401,209.36	9.34
23	600805	同仁堂	17,535,859.60	8.90
24	000880	一汽轿车	17,478,366.60	8.87
25	600877	航宇重工	17,079,533.17	8.66
26	600660	福建铝业	16,470,265.51	8.36
27	000002	万科 A	16,340,898.72	8.29
28	601166	兴业银行	16,293,999.59	8.20
29	000677	山东海龙	16,161,889.37	8.27
30	600690	青岛海尔	15,310,576.20	7.88
31	000990	四川长虹	15,884,436.79	8.06
32	000911	邯郸钢铁	15,122,032.02	7.61
33	601111	岳阳兴化	15,015,135.75	7.62
34	000063	中兴通讯	14,909,759.88	7.56
35	000527	美的电器	14,785,584.29	7.47
36	000522	白云山A	14,717,086.29	7.40
37	600432	贵州燃气	14,216,691.35	7.21
38	600089	特变电工	14,129,439.37	7.17
39	600198	大唐电信	13,921,553.70	7.06

41	600825	新华传媒	13,218,838.16	6.71
42	600900	浦发银行	12,686,297.64	6.44
43	600862	江苏银行	12,611,653.54	6.40
44	600332	广州药业	12,371,258.29	6.28
45	600271	航天信息	12,256,506.81	6.22
46	601318	中国平安	12,233,618.25	6.21
47	300059	东方财富	12,148,389.57	6.16
48	600879	航天电子	12,017,684.94	6.10
49	000905	厦门港务	11,796,579.81	5.98
50	600790	轻纺城	11,621,768.16	5.90
51	601198	洛阳钼业	11,596,540.04	5.88
52	000423	西部矿业	11,532,450.60	5.85
53	601169	北京银行	11,203,382.47	5.73
54	601668	中国建筑	10,805,963.71	5.48
55	601866	中海集运	10,598,661.38	5.38
56	600048	保利地产	10,581,692.40	5.37
57	002045	广州国光	10,561,518.48	5.36
58	600460	士兰微	10,520,257.04	5.34
59	601808	中海油服	10,452,157.17	5.30
60	000788	宁夏银行	10,316,570.26	5.23
61	000838	兰鑫 液	10,081,148.16	5.11
62	000001	深发展A	10,045,851.18	5.10
63	600184	光电股份	9,770,560.05	4.96
64	002251	步步高	9,609,191.88	4.88
65	600900	长江电力	9,304,266.74	4.72
66	000997	开滦股份	9,195,413.93	4.67
67	002008	大亚股份	9,091,723.37	4.61
68	000960	南京高科	9,024,645.45	4.58
69	000807	积成电子	9,014,500.00	4.57
70	600036	招商银行	8,896,654.17	4.51
71	000612	鲁商置业	8,656,462.79	4.39

72	60918	国投新集	8,574,512.16	4.35
73	00016	金枫酒业	8,569,262.10	4.35
74	000951	中国重汽	8,558,979.14	4.34
75	000635	美 力 特	8,522,976.96	4.32
76	002053	云南盐化	8,470,159.45	4.30
77	000069	华侨城A	8,292,493.33	4.21
78	601599	中铝国际	8,289,830.00	4.17
79	600088	沈阳机床	8,121,514.95	4.12
80	000933	神火股份	8,092,208.40	4.11
81	600480	凌云股份	8,084,692.97	4.10
82	600030	中信证券	8,024,347.09	4.07
83	600583	海油工程	7,861,007.53	3.99
84	600188	宝钢矿业	7,439,387.43	3.77
85	600345	长江电力	7,411,819.95	3.76
86	600108	亚盛集团	7,255,961.00	3.68
87	600525	际华集团	7,211,075.08	3.66
88	600090	啤酒花	7,002,399.12	3.55
89	002387	鼎新食品	6,951,574.57	3.53
90	300002	神州泰岳	6,927,396.29	3.51
91	002261	拓维信息	6,789,926.58	3.44
92	002286	保龄宝	6,688,133.62	3.39
93	002306	耀明通信	6,641,953.84	3.37
94	000899	汇 农 置 业	6,517,548.09	3.31
95	000720	ST国海	6,438,825.78	3.27
96	600418	江淮汽车	6,392,252.19	3.24
97	600875	东方电气	6,263,496.28	3.18
98	002424	贵州百灵	6,095,437.69	3.09
99	002292	奥飞动漫	5,861,366.13	2.97
100	600498	烽火通信	5,633,775.70	2.86
101	601618	中国中冶	5,589,909.94	2.84
102	900009	安科生物	5,533,292.27	2.81
103	601788	光大证券	5,472,964.83	2.78
104	600657	信达地产	5,354,548.01	2.72
105	000859	王府井	5,348,518.81	2.71
106	002376	新北洋	5,246,919.34	2.66
107	601328	交通银行	5,240,892.45	2.66
108	002369	卓尔网络	5,132,611.84	2.60
109	300033	冠昊生物	5,106,484.26	2.59
110	600122	宏图高科	5,071,409.52	2.57
111	002148	龙讯通信	4,953,412.89	2.51
112	600016	民生银行	4,856,271.77	2.46
113	600054	黄山旅游	4,835,106.62	2.45
114	000547	国瑞城A	4,831,861.83	2.45
115	600765	中航重机	4,732,256.36	2.41
116	600960	南京医药	4,732,194.06	2.40
117	000098	兴发集团	4,666,579.26	2.37
118	600475	华光股份	4,588,957.51	2.33
119	600551	时代出版	4,557,233.44	2.31
120	600183	益盛科技	4,485,203.12	2.28
121	600104	上汽汽车	4,434,910.89	2.25
122	601001	中国铝业	4,345,164.84	2.20
123	002216	三全食品	4,120,266.99	2.09
124	600166	福明药业	4,084,611.45	2.07
125	300018	中元光电	4,039,901.68	2.05
126	002340	悠米光	3,983,537.00	2.02

注1:卖出主要指:一级市场上主要的卖出,换股、要约收购、发行人回购及行权等减少3的股票。			
注2:卖出金额按买卖成交金额 成交平均价以该支数量 期间,不考虑相关交易费用。			
注3:买入金额指买入成交金额及扣除买入费用后的净额。			
			单位:人民币元
买入股票的成本(成交)总额			1,630,774,228.91
卖出股票的收入(成交)总额			1,705,280,307.78
注:买入股票成本 成交 总额,卖出股票收入 成交 总额,均按买卖成交金额 成交平均价以该支数量 期间,不考虑相关交易费用。			
8.5 期末按投资组合品种的持仓投资组合			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	15,038,400.00	12.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
其中:政策性金融债			
4	企业债券	5,076,540.00	4.17
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	20,114,940.00	16.52
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小前五名的非货币基金投资明细			

				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	010203	02国债(3)	90,000	9,000,000.00	7.39
2	210110	21国债09	60,000	6,038,400.00	4.96
3	126012	08上港债	51,000	5,076,540.00	4.17

8.7 期末按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

本基金本报告期末没有资产支持证券。

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没有被监管部门立案调查,在报告编制前一年内没有受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币元
1	存出保证金	750,000.00	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	237,094.13	
5	应收申购款	33,104.91	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	

[illegible]

金鼎资产管理(上海)有限公司,同意将基金资产全部委托事务,由受托人担任本基金基金管理公司(以下简称“管理”),同意将哈先生辞去基金职务,上述内容经基金份额持有人大会审议通过。									
11.3 关于基金管理人、基金托管人、基金销售机构等变更									
本年度,基金管理人收购虹口区人民经济合作社,在院领导 胡朝晖女士兼任本基金会基金证券投资管理 编号: 鄂000 深证股民 776000 号, 2019 年 12 月 27 日,经总理事会审议通过,特此公告。2019 年 12 月 29 日,该院派代表参加市民政局会议并发言,本次会议内容涉及证券投资基金和资产管理,基金证券投资管理事宜。									
本年度内,本基金管理人及基金投资资源继续扩大基金 基金合同 T 中约定的投资范围,未发生显著变化。									
11.5 基金通过审计会计师事务所情况									
本年度内,基金通过立信会计师事务所(特殊普通合伙)天华会计师事务所(普通合伙)支付审计费用共计 50,000.00 元,目前事务所已出具 2019 年度基金审计报告初稿。									
11.6 人员、人才及其其他高级管理人员被调查或处罚情况									
在本报告期内,基金管理人、基金托管人及其他高级管理人员均未受到监管部门调查或处罚。									
11.7 基金因诉讼产生的交易事项对基金资产的影响									
本年度内,基金管理人无诉讼事项,基金资产未受到影响。									
金额单位:人民币元									
券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交金额的比例	应付该券商的佣金	占当期应付佣金的比例	备注			
中金公司	1	1,136,062,062.95	34.06%	965,649.63	34.65%				
长城证券	1	911,223,842.67	27.32%	774,535.59	27.79%				
招商证券	1	566,011,760.00	16.97%	459,314.15	16.56%				
增信证券	1	370,305,162.37	11.00%	300,876.19	10.80%				
渤海证券	1	351,939,488.77	10.55%	285,954.98	10.26%				
安信证券	1	-	-	-	-				
11.7.2 基金租用证券公司交易单元所支付的佣金金额单位:人民币元									
券商名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	成交金额	占当期回购成交金额的比例	成交金额	占当期权证成交金额的比例			
中金公司	30,191,225.15	100.00%	-	-	-	-			
长城证券	-	-	-	-	-	-			
兴业证券	-	-	-	-	-	-			
增信证券	-	-	-	-	-	-			
渤海证券	-	-	-	-	-	-			
安信证券	-	-	-	-	-	-			
11.8 基金管理人选择使用固定收益类证券的选择标准和程序为:									
① 流动性好; ② 合理定价; ③ 信用评级在 AAA 以上; ④ 期限匹配。									
⑤ 融资成本低; ⑥ 符合国家宏观经济政策; ⑦ 符合监管要求;									
⑧ 经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为受到中国证监会处罚;									
⑨ 内部管理规范,具备健全的内控制度,并能提供基金管理人监督审核的要求;									
⑩ 具备良好的信用记录,安全的信用状况,交易对手信用等级符合基金管理人选择的交易对手的资质,并能为本基金提供全面的增值服务。									
⑪ 研究实力强,有稳定的研究人员和研究方向,能为本基金的债券投资提供专业的咨询服务。									
基金管理人根据以上标准进行评估后选择研究机构进行合作,与被选择的券商签订证券交易主协议和补充协议。									
2、应付付券商的佣金按照前一券商的交易单元进行交易量、权重及券商的综合评分计算该券商的佣金合计,不单独按照股票交易量和回购交易量计算,本期采用加权平均交易量。									
(附) 经纪交易佣金明细表,本期未使用交易佣金。									
附: 经纪交易佣金明细表,本期未使用交易佣金。									
11.9 影响投资决策的其他重要信息									
2019 年 10 月 15 日,深圳证监局检查发现,2019 年 3 月,中国证监会深圳现场检查中期问题出具了 4 项于 2019 年 10 月 15 日整改期限届满仍未整改的问题。整改后,于 2019 年 10 月 15 日出具整改报告。在整改期间,我们针对产品品质核查对客户资产保护措施自查,我们将按照 整改方案进行整改,并及时向中国证监会及深圳证监局整改报告。									
金鼎资产管理(上海)有限公司									