

中信现金优势货币市场基金

【2011】第二季度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均已对基金本报告不存在虚假记载、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法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年7月18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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，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。

基金资产净值未发生波动。

本报告自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信现金优势货币
基金代码	288101
交易代码	288101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月20日
报告期末基金份额总额	1,404,092,472.11份
投资目标	结合货币市场利率的波动与资金需求安排，采取现金管理策略进行货币市场工具投资，以便在保证基金资产的安全性、流动性的基础上，获得较高的收益。
投资策略	本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款的税后收益率为业绩比较基准。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金投资于货币市场工具，属于低风险品种。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2011年4月1日—2011年6月30日)
1.本期已实现收益	11,697,653.31
2.本期利润	11,697,653.31
3.期末基金资产净值	1,404,092,472.11

注：(1)本基金无持有认购或交易基金的基金资产。

(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)本基金报告期末基金份额净值为1.0000元。

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①	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	0.9115%	0.0036%	0.8068%	0.0027%	0.1047%	0.0034%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.3 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.4 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.5 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.6 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.7 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.8 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.9 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.10 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.11 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.12 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.13 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.14 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.15 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.16 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2005年4月20日成立至2011年6月30日止。

中信稳定双利债券型证券投资基金

【2011】第二季度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均已对基金本报告不存在虚假记载、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法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年7月18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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，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。

基金资产净值未发生波动。

本报告自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信稳定双利债券
基金代码	288102
交易代码	288102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月20日
报告期末基金份额总额	1,366,850,723.69份
投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、货币政策及利率走势的综合判断，在严格控制风险、防范流动性及信用风险等基础上，采取稳健策略控制组合久期波动范围，充分运用各种套利策略进行组合的持有期收益，实现基金资产的增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：80%×中信全债指数收益率+20%×税后一年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于混合型基金，高于货币型基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2011年4月1日—2011年6月30日)
1.本期已实现收益	15,046,061.59
2.本期利润	-14,966,937.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0108
4.期末基金资产净值	1,378,189,910.84
5.期末基金份额净值	1.0083

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①	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	-1.05%	0.12%	0.59%	0.03%	-1.64%	0.09%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.3 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.4 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.5 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.6 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.7 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.8 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.9 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.10 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.11 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.12 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.13 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.14 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.15 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

3.2.16 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金自2006年7月20日成立至2011年6月30日止。

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	60,640,111.92	4.40
C0	食品、饮料	-	-
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	38,268,111.92	2.78
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	22,372,000.00	1.62
C8	医药、生物制品	-	-
C9	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	-	-
H	批发和零售业	14,158,932.83	1.03
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		74,799,044.75	5.43

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	300216	千山药行	680,000	22,372,000.00	1.62
2	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	1.09
3	300230	永利带业	800,000	14,184,000.00	1.03
4	600859	王府井	354,239	14,158,932.83	1.03
5	601208	东材科技	419,672	9,069,111.92	0.66
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-
合计				74,799,044.75	5.43

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	78,814,087.40	5.72
2	央行票据	-	-
3	金融债	109,015,000.00	7.92
4	企业债	863,653,260.10	63.03
5	企业短期融资券	370,144,000.00	26.86
6	中期票据	-	-
7	可转债	249,001,563.54	18.07
8	其他	-	-
9	合计	1,735,627,911.04	125.94

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	110230	11国债30	1,000,000	98,910,000.00	7.18
2	126017	08华洲债	1,098,270	95,560,472.00	6.93
3	113002	工行转债	618,000	65,248,440.00	4.73
4	122020	09复地债	600,000	63,120,000.00	4.58
5	122996	08常城债	592,350	60,301,230.00	4.38

本基金本报告期末无持有资产证券化产品。

7.5 本基金本报告期末无持有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。

8 本基金本报告期末无持有权证。

8.1 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.2 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.3 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.4 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.5 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.6 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.7 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.8 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.9 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.10 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.11 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.12 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.13 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.14 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.15 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.16 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.17 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.18 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.19 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.20 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.21 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.22 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.23 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.24 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.25 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.26 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.27 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.28 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.29 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.30 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.31 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.32 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.33 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.34 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.35 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.36 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.37 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.38 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.39 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.40 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.41 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.42 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.43 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.44 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.45 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.46 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.47 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.48 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.49 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.50 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.51 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.52 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.53 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.54 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.55 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.56 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.57 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.58 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.59 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.60 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.61 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.62 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.63 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.64 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.65 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.66 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.67 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.68 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.69 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.70 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.71 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.72 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.73 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.74 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.75 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.76 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.77 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.78 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.79 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.80 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.81 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.82 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.83 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.84 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.85 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.86 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.87 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.88 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.89 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.90 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.91 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.92 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.93 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.94 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.95 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.96 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.97 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.98 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.99 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.100 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.101 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.102 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.103 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.104 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.105 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.106 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.107 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.108 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.109 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.110 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.111 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.112 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.113 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.114 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.115 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.116 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.117 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.118 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.119 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.120 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.121 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.122 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.123 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.124 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.125 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.126 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.127 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.128 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.129 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.130 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.131 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.132 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.133 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.134 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.135 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.136 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.137 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.138 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.139 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.140 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.141 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.142 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.143 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.144 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.145 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.146 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.147 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.148 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.149 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.150 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.151 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.152 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.153 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.154 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.155 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.156 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.157 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.158 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.159 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.160 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.161 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.162 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.163 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.164 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.165 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.166 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.167 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.168 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.169 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.170 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.171 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.172 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.173 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.174 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.175 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.176 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.177 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.178 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.179 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.180 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.181 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.182 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.183 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.184 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.185 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.186 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.187 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.188 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.189 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.190 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.191 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.192 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.193 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.194 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.195 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.196 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.197 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.198 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.199 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.200 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.201 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.202 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.203 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.204 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.205 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.206 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.207 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.208 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.209 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.210 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.211 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.212 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.213 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.214 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.215 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.216 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.217 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.218 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.219 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.220 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.221 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.222 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.223 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.224 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.225 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.226 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.227 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.228 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.229 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.230 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.231 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.232 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.233 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.234 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.235 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.236 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.237 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.238 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.239 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.240 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.241 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.242 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.243 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.244 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.245 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.246 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.247 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.248 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.249 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.250 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.251 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.252 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.253 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.254 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.255 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.256 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.257 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.258 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.259 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.260 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.261 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.262 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.263 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.264 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.265 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.266 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.267 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.268 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.269 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.270 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.271 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.272 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.273 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.274 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.275 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.276 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.277 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.278 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.279 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.280 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.281 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.282 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.283 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.284 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.285 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.286 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.287 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.288 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.289 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.290 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.291 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.292 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.293 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.294 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.295 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.296 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.297 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.298 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.299 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.300 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.301 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.302 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.303 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.304 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.305 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.306 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.307 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.308 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.309 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.310 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.311 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.312 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.313 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.314 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.315 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.316 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.317 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.318 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.319 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.320 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.321 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.322 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.323 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.324 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.325 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.326 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.327 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.328 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.329 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.330 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.331 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.332 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.333 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.334 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.335 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.336 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.337 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.338 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.339 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.340 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.341 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.342 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.343 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.344 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.345 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.346 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.347 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.348 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.349 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.350 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.351 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.352 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.353 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.354 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.355 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.356 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.357 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.358 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.359 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.360 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.361 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.362 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.363 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.364 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.365 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.366 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.367 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.368 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.369 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.370 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.371 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.372 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.373 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.374 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.375 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.376 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.377 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.378 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.379 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.380 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.381 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.382 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.383 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.384 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.385 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.386 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.387 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.388 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.389 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.390 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.391 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.392 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.393 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.394 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.395 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.396 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.397 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.398 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.399 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.400 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.401 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.402 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.403 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.404 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.405 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.406 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.407 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.408 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.409 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.410 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.411 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.412 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.413 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.414 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属于同一发行人且属于同一品种的证券。

8.415 报告期内本基金投资的前十名

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	300216	千山药行	680,000	22,372,000.00	1.62
2	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	1.09
3	300230	永利带业	800,000	14,184,000.00	1.03
4	600859	王府井	354,239	14,158,932.83	1.03
5	601208	东材科技	419,672	9,069,111.92	0.66

4		125709	国债转债	2,262,200.32	0.16
5.8.5 投资组合报告期末本基金持有的公允价值低于成本的投资品种情况					
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	300216	千鹤药业	23,372,000.00	6.62	债券违约情况说明
2	300214	世纪华通	15,015,000.00	1.69	新实发债受限
3	300240	华海药业	14,184,000.00	1.63	新实发债受限
4	601380	上海钢联	9,066,000.00	1.63	新实发债受限
5.8.6 投资组合报告期末持有的其他文字期限类资产					
由于持仓久远的原由,部分持仓资产可能无法变现存在展期					
§ 6 开放式基金份额变动					
本报告期基金份额总额				1,412,598,334.03	单位(份)

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	300216	千山药行	680,000	22,372,000.00	1.62
2	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	1.09
3	300230	永利带业	800,000	14,184,000.00	1.03
4	600859	王府井	354,239	14,158,932.83	1.03
5	601208	东材科技	419,672	9,069,111.92	0.66

7. 华基基金于2011年6月23日召开基金份额持有人大会关于调整部分开放式基金在部分申购机构开办定期定额投资业务事宜。

7.2 其他相关信息

7.2.1 华基基金管理有限公司成立于1998年6月10日,是经中国证监会批准设立的国内首家基金管理公司之一,总部设在北京,上海、深圳、杭州、南京、杭州和广州设有分公司,在港设有子公司。华基基金首批全部社保基金投资管理单位,首批也是首家社保基金投资管理单位,QDII基金管理人,首批社保基金境外投资管理人,首批社保基金境外投资管理人,首批社保基金境外投资管理人,首批社保基金境外投资管理人。

7.2.2 华基基金管理人

7.2.2.1 华基基金管理人

7.2.2.2 华基基金管理人

7.2.2.3 华基基金管理人

7.2.2.4 华基基金管理人

7.2.2.5 华基基金管理人

7.2.2.6 华基基金管理人

7.2.2.7 华基基金管理人

7.2.2.8 华基基金管理人

7.2.2.9 华基基金管理人

7.2.2.10 华基基金管理人

7.2.2.11 华基基金管理人

7.2.2.12 华基基金管理人

7.2.2.13 华基基金管理人

7.2.2.14 华基基金管理人

7.2.2.15 华基基金管理人

7.2.2.16 华基基金管理人

7.2.2.17 华基基金管理人

7.2.2.18 华基基金管理人

7.2.2.19 华基基金管理人

7.2.2.20 华基基金管理人

7.2.2.21 华基基金管理人

7.2.2.22 华基基金管理人

7.2.2.23 华基基金管理人

7.2.2.24 华基基金管理人

7.2.2.25 华基基金管理人

7.2.2.26 华基基金管理人

7.2.2.27 华基基金管理人

7.2.2.28 华基基金管理人

7.2.2.29 华基基金管理人

7.2.2.30 华基基金管理人

7.2.2.31 华基基金管理人

7.2.2.32 华基基金管理人

7.2.2.33 华基基金管理人

7.2.2.34 华基基金管理人

7.2.2.35 华基基金管理人

7.2.2.36 华基基金管理人

7.2.2.37 华基基金管理人

7.2.2.38 华基基金管理人

7.2.2.39 华基基金管理人

7.2.2.40 华基基金管理人

7.2.2.41 华基基金管理人

7.2.2.42 华基基金管理人

7.2.2.43 华基基金管理人

7.2.2.44 华基基金管理人

7.2.2.45 华基基金管理人

7.2.2.46 华基基金管理人

7.2.2.47 华基基金管理人

7.2.2.48 华基基金管理人

7.2.2.49 华基基金管理人

7.2.2.50 华基基金管理人

7.2.2.51 华基基金管理人

7.2.2.52 华基基金管理人

7.2.2.53 华基基金管理人

7.2.2.54 华基基金管理人

7.2.2.55 华基基金管理人

7.2.2.56 华基基金管理人

7.2.2.57 华基基金管理人

7.2.2.58 华基基金管理人

7.2.2.59 华基基金管理人

7.2.2.60 华基基金管理人

7.2.2.61 华基基金管理人

7.2.2.62 华基基金管理人

7.2.2.63 华基基金管理人

7.2.2.64 华基基金管理人

7.2.2.65 华基基金管理人

7.2.2.66 华基基金管理人

7.2.2.67 华基基金管理人

7.2.2.68 华基基金管理人

7.2.2.69 华基基金管理人

7.2.2.70 华基基金管理人

7.2.2.71 华基基金管理人

7.2.2.72 华基基金管理人

7.2.2.73 华基基金管理人

7.2.2.74 华基基金管理人

7.2.2.75 华基基金管理人

7.2.2.76 华基基金管理人

7.2.2.77 华基基金管理人

7.2.2.78 华基基金管理人

7.2.2.79 华基基金管理人

7.2.2.80 华基基金管理人

7.2.2.81 华基基金管理人

7.2.2.82 华基基金管理人

7.2.2.83 华基基金管理人

7.2.2.84 华基基金管理人

7.2.2.85 华基基金管理人

7.2.2.86 华基基金管理人

7.2.2.87 华基基金管理人

7.2.2.88 华基基金管理人

7.2.2.89 华基基金管理人

7.2.2.90 华基基金管理人

7.2.2.91 华基基金管理人

7.2.2.92 华基基金管理人

7.2.2.93 华基基金管理人

7.2.2.94 华基基金管理人

7.2.2.95 华基基金管理人

7.2.2.96 华基基金管理人

7.2.2.97 华基基金管理人

7.2.2.98 华基基金管理人

7.2.2.99 华基基金管理人

7.2.2.100 华基基金管理人

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	300216	千山药行	680,000	22,372,000.00	1.62
2	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	1.09
3	300230	永利带业	800,000	14,184,000.00	1.03
4	600859	王府井	354,239	14,158,932.83	1.03
5	601208	东材科技	419,672	9,069,111.92	0.66

备查文件存放于基金管理人或基金托管人的住所。
 4. 查阅方式
 投资者可以到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一一年七月二十日

5. 报告期内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

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	1110230	11国开30	3,000,000	296,730,000.00	9.56

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	300216	千山药行	680,000	22,372,000.00	1.62
2	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	1.09
3	300230	永利带业	800,000	14,184,000.00	1.03
4	600859	王府井	354,239	14,158,932.83	1.03
5	601208	东材科技	419,672	9,069,111.92	0.66

5.3.3其他资产和负债		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,097,635.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,713,110.94
4	应收利息	4,698,446.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	5,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-

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	300216	千山药行	680,000	22,372,000.00	1.62
2	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	1.09
3	300230	永利带业	800,000	14,184,000.00	1.03
4	600859	王府井	354,239	14,158,932.83	1.03
5	601208	东材科技	419,672	9,069,111.92	0.66

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况		单位:份
报告期末前管理人持有的封闭式基金份额	165,089,737	
报告期期间买入总份额	—	
报告期期间卖出总份额	—	
报告期末前管理人持有的封闭式基金份额	165,089,737	
报告期末未持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	5.50	
§ 7 影响投资决策的其他重要信息		
7.1 报告期内投资的主要事项		
本基金报告期内无已披露的重大事项。		

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	300216	千山药行	680,000	22,372,000.00	1.62
2	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	1.09
3	300230	永利带业	800,000	14,184,000.00	1.03
4	600859	王府井	354,239	14,158,932.83	1.03
5	601208	东材科技	419,672	9,069,111.92	0.66

||
||
||