

(上接D027版)

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	000063	中兴通讯	4,864,688	79,926,823.84	5.49
2	600066	宇通客车	3,072,210	74,623,980.90	5.12
3	000527	美的电器	5,588,517	73,321,343.04	5.04
4	000651	格力电器	3,241,675	65,903,252.75	4.53
5	000998	隆平高科	2,588,554	60,727,476.84	4.17
6	600498	烽火通信	2,155,572	57,596,883.84	3.96
7	600126	平高电气	6,785,143	56,316,686.90	3.87
8	600866	金龙汽车	5,794,614	43,517,551.14	2.99
9	002273	水晶光电	1,301,685	39,141,667.95	2.69
10	002429	兆驰股份	3,419,206	35,422,974.16	2.43

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	58,987,168.00	4.05
2	央行票据	9,674,000.00	0.66
3	金融债券	241,743,000.00	16.60
其中:政策性金融债		241,743,000.00	16.60
4	企业债券	19,506,000.00	1.34
5	企业短期融资券	10,028,000.00	0.69
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	339,938,168.00	23.35

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	110235	11国债35	500,000	50,720,000.00	3.48
2	110410	11农发10	500,000	50,645,000.00	3.48
3	020049	11国债04	500,000	48,905,000.00	3.36
4	110240	11国债40	400,000	40,572,000.00	2.79
5	110238	11国债38	300,000	30,393,000.00	2.12

- 4、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。
- 5、基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,916,321.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,496,521.86
5	应收申购款	410,545.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,823,388.11

4. 报告期末本基金持有处于转股期的可转换债券。
5. 报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。
6. 报告期末本基金未持有权证。
7. 报告期末本基金未持有资产支持证券。

8. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计数之间可能存在尾差。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	442,201,439.09	66.89
其中:股票		442,201,439.09	66.89
2	固定收益投资	139,780,600.00	21.14
其中:债券		139,780,600.00	21.14
资产支持证券		-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
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	56,540,851.76	8.55
6	其他资产	22,561,207.14	3.41
7	合计	661,084,097.99	100.00

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	20,975,227.82	3.19
C	制造业	273,826,232.34	41.65
C1	食品、饮料	27,616,695.31	4.20
C2	纺织、服装、皮毛	3,165,112.61	0.48
C3	木材、家具	-	-
C4	造纸、印刷	-	-
C5	石油、化学、塑胶、塑料	18,093,342.43	2.75
C6	电子	-	-
C5	金属、非金属	62,241,771.10	9.47
C7	机械、设备、仪表	162,709,310.89	24.75
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,440,314.73	3.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	6,768,644.58	1.03
H	批发和零售贸易	21,860,572.50	3.33
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	74,464,432.61	11.33
K	社会服务业	23,866,014.51	3.63
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		442,201,439.09	67.27

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	000041	冀东水泥	1,916,053	32,017,245.63	4.87
2	600066	宇通客车	1,163,233	28,254,929.47	4.30
3	600138	中钨高新	1,481,441	23,866,014.51	3.63
4	000224	苏宁电器	2,242,110	21,860,572.50	3.33
5	600048	保利地产	1,897,867	21,426,918.43	3.26
6	002146	荣盛发展	1,987,176	20,547,399.84	3.13
7	600970	中材国际	1,022,527	20,440,314.73	3.11
8	600312	平高电气	2,384,510	19,791,433.00	3.01
9	600104	上汽集团	1,210,628	17,953,613.24	2.73
10	002250	联化科技	795,529	15,234,380.35	2.32

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	59,568,600.00	9.06
2	央行票据	19,382,000.00	3.02
3	金融债券	60,330,000.00	9.18
其中:政策性金融债		60,330,000.00	9.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	139,780,600.00	21.26

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	110216	11国债16	400,000	40,264,000.00	6.12
2	020049	11国债04	340,000	33,255,400.00	5.06
3	110305	11进债05	200,000	20,066,000.00	3.05
4	030002	03国债02	200,000	19,992,000.00	3.04
5	1001032	10债票02	200,000	19,882,000.00	3.02

- 4、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
- 5、基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,250,000.00
2	应收证券清算款	18,454,331.26
3	应收股利	-
4	应收利息	2,743,478.12
5	应收申购款	113,397.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,561,207.14

4. 报告期末本基金没有处于转股期的可转换债券。
5. 报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。
6. 报告期末本基金未持有权证。
7. 报告期末本基金未持有资产支持证券。

8. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计数之间可能存在尾差。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	117,394,101.76	67.29
其中:股票		117,394,101.76	67.29
2	固定收益投资	39,162,962.40	22.45
其中:债券		39,162,962.40	22.45
资产支持证券		-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
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	14,788,610.57	8.48
6	其他资产	3,110,761.64	1.78
7	合计	174,456,436.37	100.00

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	15,538,051.46	9.04
B	采掘业	-	-
C	制造业	53,996,349.85	31.43
C1	食品、饮料	34,993,076.21	20.37
C2	纺织、服装、皮毛	3,995,961.06	2.33
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C5	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,169,710.44	2.43
C8	医药、生物制品	10,837,602.20	6.31
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,797,101.00	1.05
F	交通运输、仓储业	4,846,925.08	2.82
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	9,194,774.36	5.35
I	金融、保险业	25,075,871.85	14.60
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,978,120.16	2.90
L	传播与文化产业	1,966,918.00	1.14
M	综合类	-	-
合计		117,394,101.76	68.33

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	000998	隆平高科	379,997	8,914,729.63	5.19
2	600887	伊利股份	314,354	6,928,362.16	4.03
3	601628	中国人寿	420,458	6,874,488.30	4.00
4	000895	双汇发展	85,840	5,914,376.00	3.44
5	002024	苏宁电器	545,472	5,318,352.00	3.10
6	600000	浦发银行	577,800	5,159,754.00	3.00
7	000568	泸州老窖	124,100	4,851,060.00	2.82
8	600009	上海机场	375,149	4,846,925.08	2.82
9	601788	光大证券	355,430	4,254,497.10	2.48
10	600559	老白干酒	153,260	4,233,041.20	2.46

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,802,900.00	5.12
2	央行票据	29,823,000.00	17.36
3	金融债券	-	-
其中:政策性金融债		-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	537,062.40	0.31
8	其他	-	-
9	合计	39,162,962.40	22.80

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	1001032	10债票32	300,000	29,823,000.00	17.36
2	020049	11国债04	90,000	8,802,900.00	5.12
3	1131001	中行转债	5,670	537,062.40	0.31

- 注:上述债券均为本基金本报告期末持有的全部债券。
- 4、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
- 5、基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	1,293,428.42
3	应收股利	-
4	应收利息	999,568.61
5	应收申购款	67,764.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,110,761.64

4. 报告期末本基金持有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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	537,062.40	0.31

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	5,914,376.00	3.44	重大资产重组

6. 报告期末本基金未持有权证。
7. 报告期末本基金未持有资产支持证券。
8. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计数之间可能有尾差。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。

本基金合同生效以来为2003年4月25日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

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
2003年4月25日-12月31日	-1.41%	0.56%	-7.34%	0.78%	5.93%	-0.22%
2004年1月1日-12月31日	17.09%	0.95%	-8.54%	1.02%	25.63%	-0.07%
2005年1月1日-12月31日	11.42%	0.97%	-7.13%	0.98%	18.55%	-0.01%
2006年1月1日-12月31日	81.74%	1.26%	54.13%	1.06%	27.61%	0.20%
2007年1月1日-12月31日	110.40%	1.64%	81.63%	1.54%	28.77%	0.10%
2008年1月1日-12月31日	-31.61%	1.83%	-34.32%	1.92%	2.71%	-0.09%
2009年1月1日-12月31日	52.12%	1.30%	51.26%	1.21%	0.86%	0.09%
2010年1月1日-12月31日	22.32%	1.33%	9.02%	1.12%	13.30%	0.21%
2011年1月1日-12月31日	-27.17%	1.07%	-22.51%	0.90%	-4.66%	0.17%
2012年1月1日-3月31日	-6.95%	1.31%	-0.38%	1.18%	-6.57%	0.13%
基金合同生效以来至2012年3月31日	324.33%	1.30%	84.21%	1.24%	240.02%	0.06%

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
2003年4月25日-12月31日	11.98%	0.69%	-1.36%	0.64%	13.84%	0.05%
2004年1月1日-12月31日	3.12%	1.08%	-14.31%	0.90%	17.43%	0.18%
2005年1月1日-12月31日	3.87%	1.07%	-4.37%	0.99%	8.24%	0.08%
2006年1月1日-12月31日	137.80%	1.29%	70.60%	1.37%	67.20%	-0.08%
2007年1月1日-12月31日	81.77%	1.82%	105.32%	1.63%	-23.55%	0.19%
2008年1月1日-12月31日	-40.52%	1.80%	-49.54%	2.01%	9.02%	-0.21%
2009年1月1日-12月31日	71.49%	1.80%	66.62%	1.52%	4.87%	0.28%
2010年1月1日-12月31日	9.51%	1.30%	1.50%	1.15%	8.01%	0.15%
2011年1月1日-12月31日	-28.59%	1.18%	-21.52%	0.97%	-7.07%	0.21%
2012年1月1日至3月31日	3.10%	1.27%	4.35%	1.20%	-1.25%	0.07%
基金合同成立以來至2012年3月31日	326.36%	1.42%	96.86%	1.33%	229.50%	0.09%