

3. 个人所得税  
根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站 [www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn) 的半年度报告正文。

7.3.2 积极投资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

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

序号	股票代码	股票名称	公允价值变动损益(元)	公允价值变动损益占净利润比例(%)
1	600016	民生银行	61,940,522.65	3.27
2	601166	兴业银行	40,853,613.00	2.16
3	601318	中国平安	33,338,721.90	1.76
4	600000	浦发银行	32,866,594.89	1.73
5	601228	交通银行	26,328,920.95	1.39
6	000002	万科A	25,876,774.00	1.37
7	600030	中信证券	21,386,109.99	1.13
8	800837	海通证券	21,338,631.02	1.13
9	600519	贵州茅台	19,657,637.85	1.04
10	601169	北京银行	17,861,176.81	0.94
11	601088	中国神华	17,163,912.87	0.91
12	601398	工商银行	16,867,932.28	0.89
13	601288	农业银行	16,436,778.00	0.87
14	000651	格力电器	15,960,103.84	0.84
15	000001	平安银行	14,625,794.66	0.77
16	601601	中国太保	14,086,002.10	0.74
17	601818	光大银行	13,488,662.00	0.71
18	601668	中国建筑	13,141,779.39	0.69
19	600048	保利地产	12,464,525.43	0.66
20	600104	上汽集团	12,317,910.55	0.65

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601328	交通银行	12,323,485.73	0.65
2	600016	民生银行	11,080,479.23	0.58
3	600000	浦发银行	6,215,128.22	0.33
4	600837	海通证券	4,591,076.44	0.24
5	000825	太钢不锈	4,053,027.12	0.21

6	600030	中信证券	3,811,638.39	0.20
7	002405	四维图新	3,643,355.92	0.19
8	601169	北京银行	2,456,852.66	0.18

9	002073	众邦股份	3,449,956.66	0.18
10	601318	中国平安	3,136,166.90	0.17
11	000559	万润科技	3,101,738.07	0.16
12	600770	东方金钰	2,875,039.40	0.15
13	600027	华电国际	2,684,809.20	0.14
14	601179	中国西电	2,640,683.42	0.14
15	000898	*ST铜钢	2,567,978.53	0.14
16	600887	伊利股份	2,486,259.50	0.13
17	600519	贵州茅台	2,059,413.38	0.11
18	600331	安邦股份	2,024,287.37	0.11
19	600036	招商银行	1,904,654.08	0.10
20	601558	华能风电	1,878,924.01	0.10

注:卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

买入股票成本(成交)总额		1,340,864,295.90
卖出股票收入(成交)总额		137,410,383.81
注:买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额 成交单价乘以成交数量 填列,不考虑相关交易费用		
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合		
注:本基金本报告期末未持有债券		
7.6 期末按权益类资产公允价值占净值比例大小排名的前五名债券投资明细		
注:本基金本报告期末未持有债券		
7.7 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		
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券		
7.8 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		
注:本基金本报告期末未持有权证		

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未投资股指期货，如期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金本报告期未投资国债期货。

7.10.3 本基金本报告期未投资商品期货。

7.10.4 本基金本报告期未参与股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1  
本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

7.10.2  
本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.10.3  
本基金本报告期未投资资产支持证券。

单位:人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	333,553.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	9,381,731.76
4	应收利息	41,286.85
5	应收申购款	461,282.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,411.43
8	其他	-

9	合计	10,268,265.10
---	----	---------------

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于锁定期可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在受流通受限情况的说明

7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在受流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在受流通受限情况。

7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在受流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
83,059	37,799.70	1,672,441,543.94	53.27%	1,467,163,986.42	46.73%

8.2 期末基金托管人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	375,376.70	0.0120%
------------------	------------	---------

注：①本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0

②本基金基金经理持有本基金份额总数的数量区间为：		单位：份
基金合同生效日(2004年5月21日)基金份额总额		1,512,020,891.32
本报告期初基金份额总额		1,895,275,936.88
本报告期基金总申购份额		1,415,773,315.65
减：本报告期基金总赎回份额		171,443,722.17
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期末基金份额总额		3,139,605,530.36

10.1 基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	<p>1. 基金管理人重大人事变动</p> <p>本报告期，基金管理人无重大人事变动。</p> <p>2. 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动</p> <p>本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。</p> <p>10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼</p> <p>本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。</p>
----------------------------------	---

本基金本报告期投资策略无改变。

报告期内为基金进行审计的会计师事务所发生变更	
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受奖惩或处罚等情况
本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。	
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1	基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况
金额单位：人民币元	

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金	

			例	总账的比例		
长城证券	2	573,110,714.50	38.81%	519,229.32	38.70%	-
东方证券	2	502,189,376.80	34.01%	457,155.87	34.07%	-
华西证券	1	401,315,317.87	27.18%	365,356.46	27.23%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注1:报告期内租用证券公司席位的变更情况;  
本报告期内新增东方证券一个交易单元,截止本报告期末共计六个交易单元。  
2. 采用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构, 使用其席位作为基金的专用交易席位, 选择的标准是:

④ 除力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币;

⑤ 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定;

⑥ 经营行为规范, 最近两年末发生重大违规行为并受中国证监会处罚;

⑦ 内部控制完善, 具有健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求;

⑧ 具备基金业务所需的高、中、低级的通讯设备, 交易设施符合代理买卖基金证券及证券投资基金交易的需要, 并能为基金提供全面的信息服务;

⑨ 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为基金提供高质量的投资服务;

⑩ 包括基金管理人、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他所有报告。

基金管理人应根据有关规定,在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构可获得的证券的名单、支付的佣金等情况予以披露。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况						金额单位:人民币元
券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	9,402,812.30	100.00%	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---