

12	000568	泸州老窖	127,030,222.78	6.85
13	601168	北京银行	121,501,082.76	6.58
14	200045	华力创通	129,906,732.28	6.50
15	603899	晨光文具	120,074,327.60	6.15

16	000660	海南医药	120,020,911.08	6.00
17	600158	中体产业	113,776,763.71	5.69
18	300244	迪安诊断	111,968,834.60	5.60
19	000625	长安汽车	110,717,345.26	5.54
20	900083	荣科科技	506,360,672.00	6.43

21	300047	泰格医药	507,051,015,009	6.40
22	600271	航天信息	109,767,002,798	5.34
23	600426	鲁商发展	101,012,000,000	5.04
24	300270	华兰生物	86,407,000,000	4.94
25	000001	平安银行	86,297,501,000	4.90
26	601055	中信证券	84,129,000,000	4.87
27	600785	新华百货	82,007,000,113	4.81
28	300027	华谊兄弟	81,499,213,124	4.69
29	600686	金龙汽车	81,061,284,177	6.17
30	300309	荣科科技	80,000,000,000	4.17
31	602601	拓尔思	79,258,121,274	3.98
32	600022	白云山	79,212,266,600	3.98
33	603019	华兰生物	76,160,000,000	3.79

36	600128	工商银行	74,798,000.00	3.74
37	600118	中国国旅	75,768,000.00	3.76
38	600050	中国联通	75,179,500.00	3.69
39	601528	交通银行	71,860,000.00	3.60
40	300140	白银股份	71,213,500.04	3.54
41	601688	华泰证券	70,676,606.67	3.51
42	600767	中国股份	70,513,076.41	3.51
43	600030	中信证券	69,284,347.58	3.45
44	600778	友邦保险	67,983,193.20	3.41
45	600000	浦发银行	67,677,000.00	3.38
46	601261	合众思壮	66,861,204.40	3.35
47	600773	恒顺股份	66,207,927.52	3.31
48	600066	招商银行	66,471,112.22	3.27
49	600488	烽火通信	66,439,507.93	3.26
50	600084	上海电科	63,165,265.51	3.10
51	600843	中航地产	62,849,366.61	3.09
52	600997	禾川科技	61,649,550.55	3.02

53	000023	德盛资管	69,491,279.64	2.04
54	600028	中国石化	109,398,899.79	3.00
55	000029	招商局A	120,310,112.04	3.33
56	000035	中国国旅	128,398,395.97	3.57
57	600037	东方明珠	128,619,100.47	3.58
58	300036	华映光电	130,366,562.07	3.63
59	000050	中国联通	147,476,334.82	4.08
60	600060	东方证券	149,007,100.63	4.23
61	000030	中信证券	164,627,430.00	4.77
62	000002	万科A	172,524,667.74	4.80
63	000009	金城医药	181,000,000.00	5.06

62	000218	嘉善药业	67,296,199.97	2.30
63	000484	华海药业	67,076,759.00	2.30
64	200274	光大证券	67,007,690.00	2.28
65	600027	海通证券	66,321,434.84	2.27
66	300224	爱康信息	66,226,367.47	2.26
67	600027	华海药业	62,611,475.00	2.19
68	300069	东方财智	63,816,796.72	2.10
69	600066	锦江投资	63,432,026.69	2.17
70	002228	新日铁	62,665,307.36	2.13
71	300103	爱康信息	61,079,779.21	2.10
6.4.3 买入返售的资产总额及卖出回购的资产总额				
序号				7,202,318,294.20
卖出回购资产人(成交)				8,526,222,146.00
6.5 期末按金融资产种类分类的理财产品投资组合				
序号	理财产品	公允价值	占基金资产净值比例（%）	金额单位：人民币元
1	国联安债券	206,147,203.70	10.12	
2	兴行理财	-	-	
3	金鹰债券	210,396,000.00	10.26	
	其中：政策性金融债	215,396,000.00	10.56	
4	国联安债券	25,484,899.30	1.23	
期末按公允价值列示的理财产品投资组合				

6	短期借款							
7	应付账款							
8	预收账款							
9	应付职工薪酬							
10	应交税费							
11	应付利息							
12	应付股利							
13	其他应付款							
14	预收账款							
15	其他应付款							
16	应付账款							
17	应付利息							
18	应付股利							
19	其他应付款							
20	预收账款							
21	其他应付款							
22	应付账款							
23	应付利息							
24	应付股利							
25	其他应付款							
26	预收账款							
27	其他应付款							
28	应付账款							
29	应付利息							
30	应付股利							
31	其他应付款							
32	预收账款							
33	其他应付款							
34	应付账款							
35	应付利息							
36	应付股利							
37	其他应付款							
38	预收账款							
39	其他应付款							
40	应付账款							
41	应付利息							
42	应付股利							
43	其他应付款							
44	预收账款							
45	其他应付款							
46	应付账款							
47	应付利息							
48	应付股利							
49	其他应付款							
50	预收账款							
51	其他应付款							
52	应付账款							
53	应付利息							
54	应付股利							
55	其他应付款							
56	预收账款							
57	其他应付款							
58	应付账款							
59	应付利息							
60	应付股利							
61	其他应付款							
62	预收账款							
63	其他应付款							
64	应付账款							
65	应付利息							
66	应付股利							
67	其他应付款							
68	预收账款							
69	其他应付款							
70	应付账款							
71	应付利息							
72	应付股利							
73	其他应付款							
74	预收账款							
75	其他应付款							

[illegible]

基金管理人持有本基金“高级管理人员持有基金份额”		持有人结构				单位：份
持有人名称	均持有的基金份额	机构投资者		个人投资者		
		持有份额	占份额比例	持有份额	占份额比例	
4.6.6.6.	28,352,038	7,471,226.29	0.07%	1,101,360,227.68	99.93%	
9.2.2 基金管理人持有本基金持有基金份额的情况	持有份额(股数) (份)			占基金份额比例		
基金管理人持有本基金持有基金份额的情况	121,146,813			0.0059%		
9.2.3 基金管理人持有本基金持有基金份额占基金份额比例的情况	项目			持有基金份额占基金份额比例(%) (份)		
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门“负责人”持有本基金基金份额的情况				0		
本基金基金经理持有本基金基金份额				10-50		
5 开放式基金净值变动						
基金合同生效日：2004年9月31日 基金初始规模						6,013,223,027.96
基金当期期初基金总份额						1,713,262,007.28
本期基金份额总申购额						898,776,483.03
减：本期基金份额总赎回额						1,160,250,114.28
本期基金份额净申购额(和赎回减少)——“赎回”						—
本报告期末基金总份额						1,509,461,423.03
§ 11 重大事件披露						
11.1 基金的投资情况	基金的投资情况有重大变化					
11.1.1 报告期内基金的投资策略和重大变动	报告期内本基金的投资策略有重大变动 基金管理人、基金托管人等“基金托管人”的“重大变动” ——报告期内基金管理人人事变动。 报告期内基金管理人人事变动：为履行《证券投资基金法》和《证券投资基金管理条例》等法律法规的有关规定，基金管理人于2004年12月10日召开了基金份额持有人大会，审议通过了《基金管理人变更的议案》，基金管理人变更的议案已经基金份额持有人大会审议通过，基金管理人变更的议案已经基金份额持有人大会审议通过。 基金管理人、基金托管人、基金托管人变更的议案 报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.2 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.3 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.4 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.5 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.6 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.7 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.8 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.9 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.10 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.11 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.12 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.13 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.14 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.15 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.16 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.17 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.18 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.19 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.20 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.21 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.22 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.23 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.24 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.25 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.26 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.27 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.28 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.29 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.30 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.31 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.32 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.33 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.34 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.35 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.36 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.37 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.38 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.39 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.40 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.41 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.42 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.43 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.44 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.45 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.46 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.47 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.48 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.49 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.50 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.51 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.52 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.53 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.54 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.55 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.56 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.57 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.58 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.59 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.60 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.61 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.62 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.63 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.64 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.65 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.66 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.67 基金的投资策略	报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人变更的议案					
11.1.68 基金的投资策略						

券商名称	交易数量	成交金额	占股票总成交金额的比重	佣金	占股票佣金总额的比重	备注
长江证券	1	4,742,397.66	28.15%	4,247,355.99	87.17%	—
中金公司	2	2,607,873,546.40	55.65%	2,381,426.06	50.69%	—
海通证券	1	1,418,293,361.50	85.06%	1,269,354.17	8.93%	—
国海证券	1	1,352,912,031.25	83.64%	1,279,273.23	8.53%	—
国金证券	1	1,056,100,860.83	66.65%	1,238,062.69	8.63%	—
中国银河	1	689,246,512.27	52.14%	915,415.12	5.26%	新增
招商证券	1	743,009,277.34	47.27%	656,756.90	4.11%	—
光大证券	1	606,182,486.00	38.6%	561,434.45	3.65%	—
安信证券	1	440,056,196.25	3.47%	468,161.25	2.65%	—
国信证券	1	365,538,234.64	21.8%	442,803.77	3.15%	—
平安证券	2	209,713,221.88	1.97%	268,493.28	2.21%	—
国联证券	6	301,200,796.74	1.91%	272,146.12	1.91%	—
东方证券	1	214,466,006.48	1.26%	196,260.48	1.27%	新增
国联证券	1	129,033,755.23	0.65%	119,046.05	0.63%	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
长城证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
广州证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—

说明证券公司可出售证券的种类

(1) 固定收益类

(2) 货币市场工具

(3) 具有良好流动性的股票、债券、资产支持证券、衍生品及基金等金融产品的组合；

(4) 具有良好流动性的权证、基金、金融衍生品等证券，又或者是符合合理基金进行证券交易的需要，并能够及时变现的证券或服务；

(5) 其他具有良好流动性的证券或金融工具，且其出售不会对基金资产净值造成重大不利影响，并符合法律法规、证券行业规范及基金合同的要求，按照有关规定执行。

说明证券公司可出售证券的范围

(1) 国债、央行票据

(2) 中期票据

(3) 货币市场工具

11.7.2 基金管理人证券公司与交易对手进行其他证券经纪的情况

	债券交易		债券非约定交易		权证交易		金融衍生品	证券出借
证券名称	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例		
长江证券	--	--	--	--	--	--	--	--
中金公司	62,196,022.50	86.56%	2,262,000,000.00	77.52%	--	--	--	--
海通证券	--	--	--	--	--	--	--	--
华泰证券	--	--	3,350,000,000.00	26.28%	--	--	--	--
国金证券	--	--	2,095,000,000.00	16.73%	--	--	--	--
中国银河	--	--	--	--	--	--	--	--
新财富证券	--	--	--	--	--	--	--	--
光大证券	--	--	1,723,000,000.00	13.54%	--	--	--	--
宏信证券	--	--	385,000,000.00	5.01%	--	--	--	--
招商证券	--	--	560,000,000.00	2.08%	--	--	--	--

[illegible]