

国联安德盛小盘精选证券投资基金 2009年第一季度报告

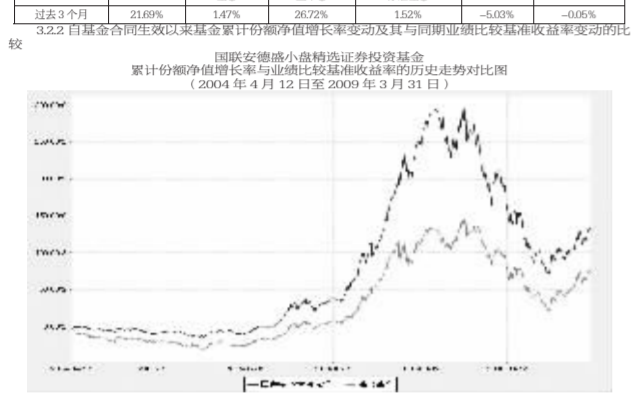
2009年3月31日
基金管理人：国联安德盛基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇〇九年四月二十日

基金名称：	国联安德盛小盘精选
代码：	257010
基金运作方式：	契约开放式
基金合同生效日：	2008年4月12日
报告期内基金合同生效日：	2,389,404,412.79
投资目标：	本基金是一类追求长期增值的基金，投资于国内A股市场上具有成长潜力的小盘股，基金管理人充分利用国内外成功的基金管理经验和，在严格的风险控制前提下，采用积极主动的投资策略，通过多策略、多品种的资产配置，充分发掘小盘股所具有的潜在成长性带来的投资机会，并谋求上述策略的长期实施以求取得较高的资本增值收益，从而实现投资者资产的长期增值。
投资策略：	本基金的投资策略主要分为两个方面：第一个方面是行业上的证券选择，总体上，对于基金的投资重点——小盘股而言，应重点投资于成长性良好的金融工程领域，其次为消费品和医药行业上具有成长潜力的医药等行业；第二个方面是个股选择，主要投资于具有良好成长性的个股，并在此基础上构建投资组合。第二个方面是资产配置策略，本基金将密切跟踪宏观经济和国内市场的变化，在充分把握市场趋势的前提下，适时调整股票资产和债券资产在投资组合中的配置比例，达到控制投资组合风险的目的。总之，本基金在投资管理的一方面是确定行业和研究个股的有机结合，从而从整体上把握投资机会和实现资产的长期增值。
业绩比较基准：	本基金的业绩比较基准=天相小盘股指数×60%+中证500指数×40%×100%+上证国债指数×40%
风险收益特征：	本基金属证券投资基金中的股票基金，由于其投资组合以小盘股为主，本基金的风险收益特征高于普通股票基金，属于证券投资基金中的高风险品种。本基金为追求基金资产的长期增值收益，在资产配置上高于普通股票基金的风险收益特征。
基金管理人：	国联安德盛基金管理有限公司
基金托管人：	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务数据和基金净值表现	
单位：人民币元	
报告期期初	报告期2009年1月1日至2009年3月31日
1.本期收益总额	64,322,572.36
2.本期基金份额持有人收益	47,211,282.23
3.期末基金份额净值	1.0285
4.期末基金资产净值	2,389,227,027.08

§3.1 国联安德盛小盘精选基金本期利润收入、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。						
上述基金业绩指标中不包括持有入交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费、计入费用后实际收益低于所列数字。						
§3.2 本基金本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	业绩比较基准②	净值增长率③	业绩比较基准④	①-③	②-④
过去3个月	21.99%	14.77%	26.76%	15.2%	-4.77%	-0.43%

注：国联安德盛小盘精选基金本期累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图(2009年1月21日至2009年3月31日)



§1 重要提示
本基金管理人、基金托管人及会计师事务所均不存在虚假记载、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责任。

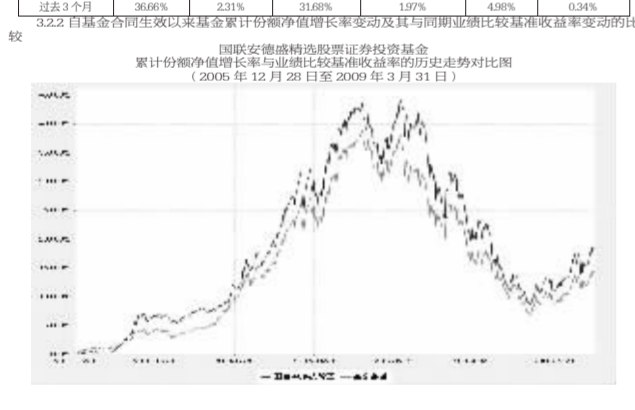
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金名称：	国联安德盛稳健
代码：	257020
基金运作方式：	契约开放式
基金合同生效日：	2008年12月29日
报告期内基金合同生效日：	2,506,282,028.50
投资目标：	本基金是一类追求长期增值的基金，投资于国内A股市场上具有成长潜力的小盘股，基金管理人充分利用国内外成功的基金管理经验和，在严格的风险控制前提下，采用积极主动的投资策略，通过多策略、多品种的资产配置，充分发掘小盘股所具有的潜在成长性带来的投资机会，并谋求上述策略的长期实施以求取得较高的资本增值收益，从而实现投资者资产的长期增值。
投资策略：	本基金的投资策略主要分为两个方面：第一个方面是行业上的证券选择，总体上，对于基金的投资重点——小盘股而言，应重点投资于成长性良好的金融工程领域，其次为消费品和医药行业上具有成长潜力的医药等行业；第二个方面是个股选择，主要投资于具有良好成长性的个股，并在此基础上构建投资组合。第二个方面是资产配置策略，本基金将密切跟踪宏观经济和国内市场的变化，在充分把握市场趋势的前提下，适时调整股票资产和债券资产在投资组合中的配置比例，达到控制投资组合风险的目的。总之，本基金在投资管理的一方面是确定行业和研究个股的有机结合，从而从整体上把握投资机会和实现资产的长期增值。
业绩比较基准：	本基金的业绩比较基准=天相小盘股指数×60%+中证500指数×40%×100%+上证国债指数×40%
风险收益特征：	本基金属证券投资基金中的股票基金，由于其投资组合以小盘股为主，本基金的风险收益特征高于普通股票基金，属于证券投资基金中的高风险品种。本基金为追求基金资产的长期增值收益，在资产配置上高于普通股票基金的风险收益特征。
基金管理人：	国联安德盛基金管理有限公司
基金托管人：	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务数据和基金净值表现	
单位：人民币元	
报告期期初	报告期2009年1月1日至2009年3月31日
1.本期收益总额	105,671,112.20
2.本期基金份额持有人收益	568,628,241.93
3.期末基金份额净值	0.9396
4.期末基金资产净值	1,897,794,074.67

§3.1 国联安德盛稳健基金本期利润收入、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。						
上述基金业绩指标中不包括持有入交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费、计入费用后实际收益低于所列数字。						
§3.2 本基金本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	业绩比较基准②	净值增长率③	业绩比较基准④	①-③	②-④
过去3个月	36.66%	23.1%	31.68%	19.7%	4.98%	0.34%

注：国联安德盛稳健基金本期累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图(2009年1月29日至2009年3月31日)



§1 重要提示
本基金管理人、基金托管人及会计师事务所均不存在虚假记载、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责任。

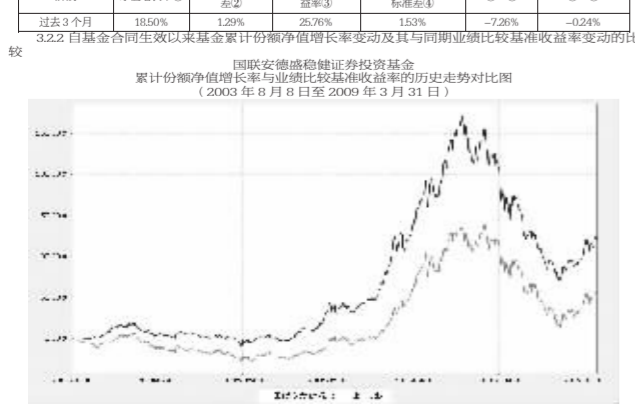
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金名称：	国联安德盛稳健
代码：	257020
基金运作方式：	契约开放式
基金合同生效日：	2008年12月29日
报告期内基金合同生效日：	143,339,363.94
投资目标：	本基金是一类追求长期增值的基金，投资于国内A股市场上具有成长潜力的小盘股，基金管理人充分利用国内外成功的基金管理经验和，在严格的风险控制前提下，采用积极主动的投资策略，通过多策略、多品种的资产配置，充分发掘小盘股所具有的潜在成长性带来的投资机会，并谋求上述策略的长期实施以求取得较高的资本增值收益，从而实现投资者资产的长期增值。
投资策略：	本基金的投资策略主要分为两个方面：第一个方面是行业上的证券选择，总体上，对于基金的投资重点——小盘股而言，应重点投资于成长性良好的金融工程领域，其次为消费品和医药行业上具有成长潜力的医药等行业；第二个方面是个股选择，主要投资于具有良好成长性的个股，并在此基础上构建投资组合。第二个方面是资产配置策略，本基金将密切跟踪宏观经济和国内市场的变化，在充分把握市场趋势的前提下，适时调整股票资产和债券资产在投资组合中的配置比例，达到控制投资组合风险的目的。总之，本基金在投资管理的一方面是确定行业和研究个股的有机结合，从而从整体上把握投资机会和实现资产的长期增值。
业绩比较基准：	本基金的业绩比较基准=天相小盘股指数×60%+中证500指数×40%×100%+上证国债指数×40%
风险收益特征：	本基金属证券投资基金中的股票基金，由于其投资组合以小盘股为主，本基金的风险收益特征高于普通股票基金，属于证券投资基金中的高风险品种。本基金为追求基金资产的长期增值收益，在资产配置上高于普通股票基金的风险收益特征。
基金管理人：	国联安德盛基金管理有限公司
基金托管人：	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务数据和基金净值表现	
单位：人民币元	
报告期期初	报告期2009年1月1日至2009年3月31日
1.本期收益总额	22,807,705.42
2.本期基金份额持有人收益	35,789,460.09
3.期末基金份额净值	0.9272
4.期末基金资产净值	225,946,729.27

§3.1 国联安德盛稳健基金本期利润收入、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。						
上述基金业绩指标中不包括持有入交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费、计入费用后实际收益低于所列数字。						
§3.2 本基金本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	业绩比较基准②	净值增长率③	业绩比较基准④	①-③	②-④
过去3个月	18.50%	1.29%	26.76%	1.53%	-7.26%	-0.24%

注：国联安德盛稳健基金本期累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图(2009年1月29日至2009年3月31日)



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
吴昊	本基金基金经理、基金经理助理	2007-9-4	9年(自2000年开)	吴昊先生，金融学硕士，吴昊先生曾任上海证券研究所、东北证券、贵州证券、国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理助理，2007年9月加入国联安德盛小盘精选证券投资基金管理公司，任基金经理助理，2007年9月起担任国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《德盛小盘精选证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、中国证监会的规定、本基金契约和基金托管协议，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同约定的各项规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况
中国证监会于2008年3月20日颁布《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人根据相关规定，及时进行了修订，并制定了相应的内部控制制度。为了管理好不同投资组合的公平对待，保护基金份额持有人的合法权益，本基金管理人参照相关法律法规和指导意见，制定并完善了《国联安德盛基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”)，用以规范包括授权审批、研究分析、投资决策、交易执行，以及投资管理过程中涉及的投资授权和业绩评估等投资管理环节的所有环节。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利。在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则进行申报，如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统中的公平交易规则；自主申报并开发交易监控系统，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析，定期向监管机构进行独立稽核等。

报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制与稽核稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人旗下共有了7只基金，分别为国联安德盛证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛成长证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)。目前本基金管理人将前六只基金按照投资风格相似分为A类和B类。成立于2009年3月份，暂无法与其他投资组合的业绩进行比较。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与投资风格相似的组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现存在可能導致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年以来A股市场呈现出反复性反弹的走势，尽管一季度市场震荡幅度较大，但整体以上涨为主。国联安德盛基金的运作，克服了以往不追求业绩的缺点，并进行了积极的行业板块切换。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利。在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则进行申报，如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统中的公平交易规则；自主申报并开发交易监控系统，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析，定期向监管机构进行独立稽核等。

报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制与稽核稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人旗下共有了7只基金，分别为国联安德盛证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛成长证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)。目前本基金管理人将前六只基金按照投资风格相似分为A类和B类。成立于2009年3月份，暂无法与其他投资组合的业绩进行比较。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与投资风格相似的组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现存在可能導致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年以来A股市场呈现出反复性反弹的走势，尽管一季度市场震荡幅度较大，但整体以上涨为主。国联安德盛基金的运作，克服了以往不追求业绩的缺点，并进行了积极的行业板块切换。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利。在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则进行申报，如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统中的公平交易规则；自主申报并开发交易监控系统，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析，定期向监管机构进行独立稽核等。

报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制与稽核稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人旗下共有了7只基金，分别为国联安德盛证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛成长证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)。目前本基金管理人将前六只基金按照投资风格相似分为A类和B类。成立于2009年3月份，暂无法与其他投资组合的业绩进行比较。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与投资风格相似的组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现存在可能導致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年以来A股市场呈现出反复性反弹的走势，尽管一季度市场震荡幅度较大，但整体以上涨为主。国联安德盛基金的运作，克服了以往不追求业绩的缺点，并进行了积极的行业板块切换。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利。在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则进行申报，如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统中的公平交易规则；自主申报并开发交易监控系统，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析，定期向监管机构进行独立稽核等。

报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制与稽核稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人旗下共有了7只基金，分别为国联安德盛证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛成长证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)。目前本基金管理人将前六只基金按照投资风格相似分为A类和B类。成立于2009年3月份，暂无法与其他投资组合的业绩进行比较。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与投资风格相似的组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现存在可能導致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年以来A股市场呈现出反复性反弹的走势，尽管一季度市场震荡幅度较大，但整体以上涨为主。国联安德盛基金的运作，克服了以往不追求业绩的缺点，并进行了积极的行业板块切换。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利。在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则进行申报，如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统中的公平交易规则；自主申报并开发交易监控系统，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析，定期向监管机构进行独立稽核等。

报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制与稽核稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人旗下共有了7只基金，分别为国联安德盛证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛成长证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)。目前本基金管理人将前六只基金按照投资风格相似分为A类和B类。成立于2009年3月份，暂无法与其他投资组合的业绩进行比较。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与投资风格相似的组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现存在可能導致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年以来A股市场呈现出反复性反弹的走势，尽管一季度市场震荡幅度较大，但整体以上涨为主。国联安德盛基金的运作，克服了以往不追求业绩的缺点，并进行了积极的行业板块切换。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利。在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则进行申报，如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统中的公平交易规则；自主申报并开发交易监控系统，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析，定期向监管机构进行独立稽核等。

报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制与稽核稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人旗下共有了7只基金，分别为国联安德盛证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛成长证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)。目前本基金管理人将前六只基金按照投资风格相似分为A类和B类。成立于2009年3月份，暂无法与其他投资组合的业绩进行比较。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与投资风格相似的组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现存在可能導致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年以来A股市场呈现出反复性反弹的走势，尽管一季度市场震荡幅度较大，但整体以上涨为主。国联安德盛基金的运作，克服了以往不追求业绩的缺点，并进行了积极的行业板块切换。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利。在交易环节严格执行时间优先、价格优先的原则进行申报，如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统中的公平交易规则；自主申报并开发交易监控系统，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析，定期向监管机构进行独立稽核等。

报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制与稽核稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人旗下共有了7只基金，分别为国联安德盛证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛成长证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)、国联安德盛红利证券投资基金(A类和B类)。目前本基金管理人将前六只基金按照投资风格相似分为A类和B类。成立于2009年3月份，暂无法与其他投资组合的业绩进行比较。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与投资风格相似的组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现存在可能導致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年以来A股市场呈现出反复性反弹的走势，尽管一季度市场震荡幅度较大，但整体以上涨为主。国联安德盛基金的运作，克服了以往不追求业绩的缺点，并进行了积极的行业板块切换。

4.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	股权投资	1,548,389,094.04	66.76
2	其中:股票	1,548,389,094.04	66.76
3	固定收益投资	530,140,088.20	22.91
4	其中:债券	530,140,088.20	22.91
5	银行存款	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	104,471,712.09	4.51
9	合计	2,319,181,104.00	100.00

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	23,494,030.50	1.02
B	采矿业	76,525,324.56	3.21
C	制造业	724,960,246.42	31.80
CO	食品饮料	56,539,319.04	2.41
C1	纺织、服装、皮毛	49,469,940.20	2.11
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	14,504,434.14	0.62
C4	石油、化学、塑胶、塑料	43,410,000.00	1.85
C5	电子	38,429,450.00	1.64
OC	金属、非金属	146,420,377.20	6.34
C7	机械、设备、仪表	302,136,247.65	13.08
C8	医药、生物制品	10,487,508.79	0.45
C9	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水和热力供应	82,829,604.94	3.59
E	信息技术业	30,395,806.26	1.31
F	交通运输、仓储业	53,127,153.56	2.30
G	信息技术业	34,272,634.00	1.48
H	批发和零售贸易	86,929,862.06	3.76
I	金融、保险业	197,071,000.00	8.53
J	房地产业	64,129,325.51	2.78
K	公共事业	24,544,428.01	1.06
L	其他行业	0.00	0.00
M	合计	138,856,130.93	6.08
合计		1,548,389,094.04	67.06

4.3 报告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组合

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	600415	小商品城	1,000,000	67,740,000.00	2.90
2	600031	三一重工	2,369,960	56,374,825.50	2.44
3	601196	兴业银行	2,000,000	45,960,000.00	1.99
4	600085	海螺水泥	3,181,089	45,566,253.22	1.97
5	600088	鲁南钨业	2,941,181	45,361,860.00	1.97
6	600159	华鲁恒升	3,000,000	43,410,000.00	1.88
7	600058	广汇能源	2,241,479	43,272,618.56	1.88
8	600663	中航地产	2,500,000	41,150,000.00	1.78
9	600276	恒顺醋业	973,882	38,832,624.16	1.68
10	600024	新钢股份	1,574,643	35,224,763.51	1.53

4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	000015	国债015	100,000	9,794,000.00	0.52
2	000016	国债016	100,000	9,794,000.00	0.52
3	000017	国债017	100,000	9,794,000.00	0.52
4	000018	国债018	100,000	9,794,000.00	0.52
5	000019	国债019	100,000	9,794,000.00	0.52
6	000020	国债020	100,000	9,794,000.00	0.52
7	000021	国债021	100,000	9,794,000.00	0.52
8	000022	国债022	100,000	9,794,000.00	0.52
9	000023	国债023	100,000	9,794,000.00	0.52
10	000024	国债024	100,000	9,794,000.00	0.52

4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

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	601196	兴业银行	4,113,283	94,523,234.34	5.01
2	601987	中国国油	3,669,941	75,365,268.31	3.39
3	601318	中国平安	1,822,000	71,885,880.00	3.30
4	000024	新钢股份	2,828,271	63,181,179.27	3.38
5	601198	兴业银行	5,074,465	59,726,326.36	3.16
6	600701	中航地产	3,554,387	59,041,271.88	3.14
7	601077	华鲁恒升	5,829,384	57,849,960.00	3.10
8	000086	东北证券	2,236,389	57,027,405.50	3.02
9	600081	鲁南钨业	4,		