（上接 B53 版）

第三节 动力平衡基金财务会计报告

（一）动力平衡基金会计报表

1、资产负债表

单位：人民币元

	2006年6月30日	2005年12月31日
资产		
银行存款	5,471,565.87	18,073,768.94
清算备付金	248,545.86	141,537.65
交易保证金	388,549.12	185,707.76
应收证券清算款	584,166.06	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收利息	481,450.02	745,377.98
应收申购款	1,464,281.60	62,885.52
其他应收款	842,521.40	2,635.95
股票投资市值	193,629,236.35	158,954,147.52
其中：股票投资成本	113,931,214.27	146,364,779.76
债券投资市值	50,206,260.00	78,141,320.00
其中：债券投资成本	50,239,850.04	78,009,178.30
权证投资市值	0.00	0.00
其中：权证投资成本	0.00	0.00
待摊费用	0.00	0.00
资产总计	253,316,576.28	256,307,381.32
负债及持有人权益		
负债		
应付证券清算款	2,744,354.99	417,526.93
应付赎回款	460,440.23	137,651.49
应付赎回费	279.02	339.11
应付管理人报酬	295,245.60	316,975.26
应付托管费	49,207.61	52,829.19
应付佣金	108,562.65	65,738.63
其他应付款	250,000.00	250,000.00
预提费用	87,075.14	44,535.64
负债合计	3,995,165.24	1,285,596.25
持有人权益		
实收基金	160,070,005.58	251,029,561.09
未实现利得	59,982,259.72	943,571.15
未分配基金净收益 /(累计基金净损失)	29,269,145.74	3,048,652.83
持有人权益合计	249,321,411.04	255,021,785.07
(2006 年 6 月 30 日每份基金份额净值:1.5576 元)		
(2005 年 12 月 31 日每份基金份额净值:1.0159 元)		
负债及持有人权益总计	253,316,576.28	256,307,381.32

2、动力平衡基金经营业绩及收益分配表

单位：人民币元

	2006年1月1日至2006年6月30日止期间	2005年1月1日至2005年6月30日止期间
收入		
股票差价收入	32,499,705.43	2,427,189.85
债券差价收入	82,384.26	93,657.53
权证差价收入	5,672,364.74	0.00
债券利息收入	688,340.92	1,699,257.25
存款利息收入	52,326.90	110,271.44
股利收入	1,165,628.59	1,236,147.00
买入返售证券收入	0.00	0.00
其他收入	46,048.02	41,566.14
收入合计	40,206,798.86	5,608,089.21
费用		
基金管理人报酬	1,685,655.23	1,989,209.19
基金托管费	280,942.54	331,534.79
卖出回购证券支出	9,967.81	14,216.31
其他费用	93,319.36	80,606.95
其中：信息披露费	57,853.03	49,636.62
审计费用	24,795.19	19,835.79
费用合计	2,069,884.94	2,415,567.24
基金净收益 /(损失)	38,136,913.92	3,192,521.97
加:未实现估值增值 /(减值)变动数	66,942,922.58	−3,627,929.36
基金经营业绩	105,079,836.50	−435,407.39
基金净收益 /(损失)	38,136,913.92	3,192,521.97
加:期初累计基金净收益	3,048,652.83	7,076,743.58
本期申购基金份额的损益平准金	1,220,043.29	2,006,307.78
本期赎回基金份额的损益平准金	−3,639,933.92	−1,174,277.57
可供分配基金净收益 /(累计基金净损失)	38,765,676.12	11,101,295.76
减:本期已分配基金净收益	9,496,530.38	0.00
未分配基金净收益 /(累计基金净损失)	29,269,145.74	11,101,295.76

3、动力平衡基金净值变动表

单位：人民币元

	2006年1月1日至2006年6月30日止期间	2005年1月1日至2005年6月30日止期间
期初基金净值	255,021,785.07	258,922,776.15
本期经营活动		
基金净收益 /(损失)	38,136,913.92	3,192,521.97
未实现估值增值 /(减值)变动数	66,942,922.58	−3,627,929.36
经营活动产生的基金净值变动数	105,079,836.50	−435,407.39
本期基金份额交易		
基金申购款	28,952,338.26	47,496,673.25
其中：分红再投资	1,727,292.95	0.00
基金赎回款	−130,236,018.41	−30,702,351.67
基金份额交易产生的基金净值变动数	−101,283,680.15	16,794,321.58
本期向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	−9,496,530.38	0.00
期末基金净值	249,321,411.04	275,281,690.34

（二）动力平衡基金会计报表附注

1、动力平衡基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

2、本报告期无重大会计差错和更正金额。

3、本报告期间的关联方交易

（1）关联方（本报告期内关联方关系未发生变化）

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司	基金管理人的股东
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2006年1月1日至2006年6月30日止期间	
	成交量	占本期成交量的比例
长城证券：		
买卖股票	121,780,522.63	37.95%
买卖债券	0.00	0.00%
回购交易	0.00	0.00%
买卖权证	2,592,970.91	45.71%
	佣金	占本期佣金总量的比例
长城证券：		
交易佣金	95,294.97	36.92%

	2005年1月1日至2005年6月30日止期间	
	成交量	占本期成交量的比例
长城证券：		
买卖股票	36,552,228.66	39.84%
买卖债券	0.00	0.00%
回购交易	0.00	0.00%
买卖权证	0.00	0.00%
	佣金	占本期佣金总量的比例
长城证券：		
交易佣金	28,602.39	38.75%

上述佣金按市场佣金率计算，并以扣除由中国证券登记结算有限责 任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类交易的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

（3）基金管理人报酬

支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 1,685,655.23 元，在 2005 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间需支付基金管理人报酬 1,989,209.19 元。

(4) 基金托管费

支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 280,942.54 元，在 2005 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间需支付基金托管费 331,534.79 元。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 5,471,565.87 元，2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 49,099.45 元。

基金托管人于 2005 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 19,114,921.41 元，2005 年 1 月 1 日至 2005 年 6 月 30 日止期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 109,001.50 元。

（6）与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金与托管人中国银行股份有限公司进行的债券（含回购）交易如下：（单位：元）

	2006年1月1日至2006年6月30日	2005年1月1日至2005年6月30日
债券交易	8,065,388.97	100,281,579.42
回购交易	29,700,000.00	53,900,000.00
交易合计	37,765,388.97	154,181,579.42
回购利息收入	0.00	0.00
回购利息支出	9,967.81	14,216.31

本基金在本年度与基金管理人的股东长城证券有限责任公司通过银行间同业市场进行的债券交易如下：（单位：元）

	2006年1月1日至2006年6月30日	2005年1月1日至2005年6月30日
债券交易	0.00	19,522,000.00

(7) 关联方持有本基金份额

本基金基金管理人自 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间及 2005 年 1 月 1 至 2005 年 6 月 30 日止期间未持有本基金份额。

本基金基金管理人主要股东及其控制的机构在 2006 年 6 月 30 日及 2005 年 12 月 31 日均未持有本基金份额。

4、流通受限制不能自由转让的基金资产

（1）截至 2006 年 6 月 30 日止，本基金持有因非公开发行而流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数	成本	市值
002024	苏宁电器	2006.06.22	2007.06.22	48.00	51.20	100000	4,800,000.00	5,120,000.00

（2）本基金截至 2006 年 6 月 30 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌，其年末估值单价是根据最近一个交易日的收盘价确定。

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	投资成本	期末估值总额
600033	福建高速	2006-6-29	8.12	2006-7-14	6.15	400,000	3,437,862.46	3,248,000.00
合 计							3,437,862.46	3,248,000.00

第六章 投资组合报告

第一节 优选股票基金投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	24,673,046.66	2.21%
股票	858,016,110.07	76.77%
债券	224,695,674.00	20.10%
权证	0.00	0.00%
其它资产	10,259,983.28	0.92%
资产总计	1,117,644,814.01	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	数量（股）	市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业		0.00	0.00%
B 采掘业	2,693,992	61,692,416.80	5.54%
C 制造业	25,211,111	530,933,656.54	47.68%
C0 食品、饮料	5,189,646	184,099,608.67	16.53%
C1 纺织、服装、皮毛		0.00	0.00%
C2 木材、家具		0.00	0.00%
C3 造纸、印刷		0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	2,545,147	51,666,484.10	4.64%
C5 电子	432,713	11,047,162.89	0.99%
C6 金属、非金属	3,009,876	72,155,290.04	6.48%
C7 机械、设备、仪表	12,471,144	166,728,275.09	14.97%
C8 医药、生物制品	1,562,585	45,236,835.75	4.06%
C99 其他制造业		0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		0.00	0.00%
E 建筑业		0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	3,446,659	25,354,597.88	2.28%
G 信息技术业	750,008	21,457,728.88	1.93%
H 批发和零售贸易	3,358,090	117,756,524.30	10.58%
I 金融、保险业	4,778,550	46,406,585.10	4.17%
J 房地产业	7,173,121	50,434,800.57	4.53%
K 社会服务业		0.00	0.00%
L 传播与文化产业	270,000	3,979,800.00	0.36%
M 综合类		0.00	0.00%
合计	47,681,531	858,016,110.07	77.06%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数 量（股）	市 值（元）	市值占基金资产净值比例
600519	G 茅 台	1,760,783	83,531,545.52	7.50%
600320	G 振 华	3,150,099	62,182,954.26	5.58%
600583	G 海 工	2,693,992	61,692,416.80	5.54%
000869	G 张 裕	1,513,109	56,908,029.49	5.11%
600694	大商股份	1,329,410	54,971,103.50	4.94%
000792	G 钾 肥	2,545,147	51,666,484.10	4.64%
000538	G 云白药	1,562,585	45,236,835.75	4.06%
600887	G 伊 利	1,915,754	43,660,033.66	3.92%
002024	苏宁电器	789,000	40,396,800.00	3.63%
600456	G 宝 钛	771,096	36,773,568.24	3.30%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于景顺长城基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

（一）报告期内累计买入金额占期初基金资产净值前 20 名的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比
600688	上海石化	41,199,570.06	3.64%
000792	G 钾 肥	35,480,346.40	3.13%
002024	苏宁电器	27,641,292.34	2.44%
600320	G 振 华	27,169,636.90	2.40%
600694	大商股份	26,414,984.14	2.33%
600331	G 宏 达	25,101,077.89	2.21%
600685	G 广 船	24,752,802.70	2.18%
000002	G 万科 A	23,170,897.90	2.04%
600456	G 宝 钛	22,461,961.76	1.98%
000852	江钻股份	21,773,993.44	1.92%
000063	G 中 兴	21,565,506.39	1.90%
000932	G 华 菱	21,315,855.11	1.88%
000060	G 中 金	21,038,041.62	1.86%
000630	G 铜 都	20,421,902.91	1.80%
000617	石油济柴	19,475,523.56	1.72%
000024	G 招商局	19,075,536.93	1.68%
000039	G 中 集	18,320,723.54	1.62%
600362	G 江 铜	16,106,644.46	1.42%
600879	G 火 箭	14,995,996.30	1.32%
600030	G 中 信	13,967,436.43	1.23%

（二）报告期内累计卖出金额占期初基金资产净值前 20 名股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占净值比
600009	G 沪机场	60,984,042.04	5.38%
600900	G 长 电	58,238,462.67	5.14%
600019	G 宝 钢	55,614,706.99	4.91%
600028	中国石化	52,336,558.65	4.62%
000002	G 万科 A	50,471,852.30	4.45%
600688	上海石化	48,878,358.47	4.31%
600033	福建高速	39,707,528.94	3.50%
600050	G 联 通	36,217,231.09	3.20%
600331	G 宏 达	31,955,171.06	2.82%
600012	G 皖 通	31,572,029.53	2.79%
000060	G 中 金	29,372,337.74	2.59%
000423	东阿阿胶	28,571,665.78	2.52%
600519	G 茅 台	26,885,355.84	2.37%
000858	G 五粮液	26,628,296.57	2.35%
600269	G 赣 粤	26,542,609.29	2.34%
600808	G 马 钢	25,958,265.69	2.29%
600583	G 海 工	25,105,632.40	2.22%
600320	G 振 华	24,705,549.59	2.18%
000022	G 深赤湾	23,000,095.24	2.03%
000630	G 铜 都	21,699,265.70	1.91%

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票收入总额

	金额（元）
报告期内买入股票总成本:	649,366,046.91
报告期内卖出股票收入总额:	1,069,546,198.26

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值（元）	市值占基金资产净值比例
国家债券投资	224,695,674.00	20.18%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	0.00	0.00%
可转换债投资	0.00	0.00%
债券投资合计	224,695,674.00	20.18%

六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券名称	数量（张）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
06农发 04	700,000	71,578,000.00	6.43%
02国债(4)	453,600	45,518,760.00	4.09%
21国债(3)	296,680	29,979,514.00	2.69%
03国开 18	200,000	20,328,000.00	1.83%
04国开 01	200,000	20,151,000.00	1.81%

七、投资组合报告附注

1、报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、基金的其他资产构成

单位：元

项目	金额
交易保证金	888,549.12
应收证券清算款	6,079,535.16
应收股利	207,900.00
应收利息	2,152,075.90
应收申购款	928,917.13
其他应收款	3,005.97
合计	10,259,983.28

4、报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、本基金于本报告期末未持有权证，报告期内因股权分置改革被动持有的权证数量为 13,936,637 股，成本总额为 0.00 元，无主动投资的权证。明细如下：

序号	权证代码	权证种类	权证名称	权证数量（股）	市值	市值占基金净资产比例%	获得方式
1	030002	认购权证	五粮液 YGC1	939,027	–	–	被动获得
2	038004	认沽权证	五粮液 YGP1	987,182	–	–	被动获得
3	580996	认沽权证	沪场 JTP1	1,214,519	–	–	被动获得
4	580997	认沽权证	招行 CMP1	2,190,000	–	–	被动获得
5	038003	认沽权证	华菱 JTP1	3,051,117	–	–	被动获得
6	580994	认沽权证	原水 CTP1	446,121	–	–	被动获得
7	038006	认沽权证	中集 ZYP1	1,120,000	–	–	被动获得
8	580990	认沽权证	茅台 JCP1	3,079,690	–	–	被动获得
9	038008	认沽权证	钾肥 JTP1	908,981	–	–	被动获得
合计			合计	13,936,637	–	–	

6、本报告期未投资资产支持证券。

7、基金投资流通受限证券的情况：

序号	流通受限证券名称	类型	流通受限截止日期	数量（股）	报告期末市值（元）	占基金净值比例
1	苏宁电器	非公开发行	2007-6-22	200,000	10,240,000.00	0.92%
2	金地集团	股权分置改革	2006-7-11	1,076,600	9,226,462.00	0.83%
合计				1,276,600	19,466,462.00	1.75%

8、本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

第二节 货币市场基金投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额（元）	占基金资产总值比例
债券投资	368,949,696.61	78.04%
买入返售证券	90,000,000.00	19.04%
其中:买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	11,725,353.25	2.48%
其他资产	2,076,894.63	0.44%
资产总计	472,751,944.49	100.00%

二、报告期债券回购融资情况

序号	项 目	金额(元)	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00%

1、上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

2、本基金在本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20％的情况。

三、基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项 目	天 数
报告期末投资组合平均剩余期限	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	152
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未发生违规超过 180 天的情况。

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例	各期限负债占基金资产净值的比例
1	30天内	25.87%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.31%	0.00%
2	30天(含)–60 天	16.92%	0.00%
3	60天(含)–90 天	29.59%	0.00%
4	90天(含)–180 天	16.91%	0.00%
5	180天(含)–397 天(含)	10.47%	0.00%
	合 计	99.75%	0.00%

四、报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	90,033,645.44	19.08%
	其中:政策性金融债	90,033,645.44	19.08%
3	央行票据	209,249,700.43	44.35%
4	企业债券	69,666,350.74	14.76%
合 计		368,949,696.61	78.19%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		20,358,950.26	4.31%

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量（张） 自有投资	债券数量（张） 买断式回购	成本（元）	占基金资产净值的比例
1	06央行票据 29	800,000		79,816,871.25	16.92%
2	06央行票据 36	600,000		59,787,428.53	12.67%
3	06央行票据 15	500,000		49,786,250.00	10.55%
4	06农发 17	400,000		39,894,658.39	8.45%
5	03进出 02	300,000		30,051,783.43	6.37%
6	05首都机场	200,000		20,358,950.26	4.31%
7	04国开 01	200,000		20,087,203.62	4.26%
8	06深高速 CP01	200,000		20,014,945.08	4.24%
9	05央行票据 111	200,000		19,859,150.65	4.21%
10	06中海运 CP01	200,000		19,475,274.40	4.13%

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

五、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)–0.5%间的次数	59
报告期内偏离度的最高值	0.4856%
报告期内偏离度的最低值	0.1380%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值简单平均值	0.2760%

六、投资组合报告附注

1、基金计价方法说明：本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金采用固定单位净值，基金账面份额净值为 1.00 元。

2、本报告期内，本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值 20％的情况。

3、本报告期内无需要说明的证券投资决策程序。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	1,858,576.16
4	应收申购款	218,318.47
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合计		2,076,894.63

5、本报告期内未投资资产支持证券。

6、本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

第三节 动力平衡基金投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额（元）	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	5,720,111.73	2.26%
股票	193,629,236.35	76.44%
债券	50,206,260.00	19.82%
权证	0.00	0.00%
其它资产	3,760,968.20	1.48%
资产总计	253,316,576.28	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比
A 农、林、牧、渔业		0.00	0.00%
B 采掘业	570,000	13,053,000.00	5.24%
C 制造业	4,353,645	102,236,684.65	41.01%
C0 食品、饮料	1,100,781	38,736,778.99	15.54%
C1 纺织、服装、皮毛		0.00	0.00%
C2 木材、家具		0.00	0.00%
C3 造纸、印刷		0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	522,570	10,608,171.00	4.25%
C5 电子	136,955	3,496,461.15	1.40%
C6 金属、非金属	320,006	8,943,086.14	3.59%
C7 机械、设备、仪表	1,623,333	27,857,687.37	11.17%
C8 医药、生物制品	650,000	12,594,500.00	5.05%
C99 其他制造业		0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		0.00	0.00%
E 建筑业		0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	1,341,885	12,497,310.70	5.01%
G 信息技术业	206,072	5,895,719.92	2.36%
H 批发和零售贸易	1,452,000	34,516,360.00	13.84%
I 金融、保险业	1,207,648	11,657,411.08	4.68%
J 房地产业	2,095,000	13,772,750.00	5.52%
K 社会服务业		0.00	0.00%
L 传播与文化产业		0.00	0.00%
M 综合类		0.00	0.00%
合计	11,226,250	193,629,236.35	77.66%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数 量（股）	市 值（元）	市值占基金资产净值比
600519	G 茅 台	380,000	18,027,200.00	7.23%
600320	G 振 华	760,000	15,002,400.00	6.02%
600583	G 海 工	570,000	13,053,000.00	5.24%
002024	苏宁电器	220,000	11,264,000.00	4.52%
000869	G 张 裕	289,000	10,869,290.00	4.36%
000792	G 钾 肥	522,570	10,608,171.00	4.25%
600694	大商股份	240,000	9,924,000.00	3.98%
600887	G 伊 利	431,781	9,840,288.99	3.95%
000002	G 万科 A	1,695,000	9,576,750.00	3.84%
600269	G 赣 粤	941,885	9,249,310.70	3.71%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于景顺长城基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

（一）报告期内累计买入金额占期初基金资产净值前 20 名的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比
002024	苏宁电器	8,948,269.97	3.51%
600456	G 宝 钛	6,516,822.92	2.56%
000792	G 钾 肥	6,441,690.93	2.53%
000063	G 中 兴	6,114,941.15	2.40%
600879	G 火 箭	6,061,251.98	2.38%
000024	G 招商局	5,455,400.65	2.14%
600694	大商股份	5,356,073.02	2.10%
000932	G 华 菱	4,956,059.39	1.94%
000002	G 万科 A	4,923,485.16	1.93%
600036	G 招 行	4,600,904.38	1.80%
000630	G 铜 都	4,342,167.03	1.70%
600362	G 江 铜	4,087,595.31	1.60%
000987	G 穗友谊	3,964,139.71	1.55%
002025	航天电器	3,568,713.67	1.40%
600320	G 振 华	3,502,891.33	1.37%
600688	上海石化	3,390,929.43	1.33%
600050	G 联 通	3,149,273.40	1.23%
600555	G 茉织华	2,963,058.76	1.16%
000767	G 漳 电	2,718,281.48	1.07%
600030	G 中 信	2,710,980.99	1.06%

（二）报告期内累计卖出金额占期初基金资产净值前 20 名股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比
600900	G 长 电	12,445,773.90	4.88%
600362	G 江 铜	9,741,035.41	3.82%
600050	G 联 通	9,739,279.73	3.82%
600583	G 海 工	8,980,745.75	3.52%
600028	中国石化	8,747,267.76	3.43%
600009	G 沪机场	8,637,153.79	3.39%
600519	G 茅 台	7,721,193.19	3.03%
600012	G 皖 通	7,402,704.01	2.90%
600019	G 宝 钢	7,005,330.15	2.75%
000858	G 五粮液	6,626,210.04	2.60%
600066	G 宇 通	6,293,945.30	2.47%
600808	G 马 钢	5,908,519.09	2.32%
600015	G 华 夏	5,109,352.32	2.00%
000423	东阿阿胶	4,800,096.60	1.88%
600630	G 铜 都	4,794,642.99	1.88%
600688	上海石化	4,426,949.83	1.74%
000960	G 锡 业	4,409,306.99	1.73%
000538	G 云白药	4,246,820.34	1.67%
600033	福建高速	4,051,059.79	1.59%
000932	G 华 菱	3,694,623.50	1.45%

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票收入总额

	金额（元）
报告期内买入股票总成本	131,346,081.88
报告期内卖出股票收入总额	194,410,720.23

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值（元）	市值占基金资产净值比
国家债券投资	50,206,260.00	20.14%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	0.00	0.00%
可转换债投资	0.00	0.00%
债券投资合计	50,206,260.00	20.14%

六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券名称	数 量（张）	市 值（元）	市值占基金资产净值比
03国开 18	300,000	30,348,000.00	12.17%
02国债(4)	82,600	8,288,910.00	3.32%
05国开 07	50,000	5,033,500.00	2.02%
21国债(3)	35,000	3,536,750.00	1.42%
06农发 17	30,000	2,999,100.00	1.20%

七、投资组合报告附注

1、报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中，没