

信诚四季红混合型证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人:信诚基金管理有限公司 基金托管人:中国农业银行

重要提示

基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2006年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告财务资料未经审计。

一、基金简介

(一)基金基本情况
基金名称:信诚四季红混合型证券投资基金
基金简称:信诚四季红
交易代码:650001
深交所行情代码:165501
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年4月29日
报告期末基金份额总额:3,225,781,935.27份
基金合同存续期:不定期

(二)基金产品说明
基金投资目标:在有效配置资产的基础上,精选投资标的,追求在稳定分红的基础上,实现基金资产的长期稳定增长。

基金投资策略:本基金在充分借鉴英国保诚集团的资产配置理念和方法的基础上,建立了适合国内市场的资产配置体系。本基金的资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA)。战略性资产配置(SAA)即决定投资组合中股票、债券和现金各自的长期均衡比重,按照本基金的风险偏好以及对资本市场各大类资产在长期均衡状态下的预期回报率测定而得出。战术性资产配置(TAA)是本基金资产配置的核心,是指依据特定市场情况,对在一定时期持有某类资产的预期回报作出预测,并围绕基金资产的战略性资产配置基准,进行相应的中期资产配置的过程。

业绩比较基准:62.5%×新华富时全A指数收益率+32.5%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率。

风险收益特征:作为一只混合型基金,本基金的资产配置中股票(权重62.5%,债券32.5%)确立了本基金在平衡型基金中的中等风险定位,因此本基金在证券投资基金中属于中等风险。同时,通过严谨的研究和稳健的操作,本基金力争在严格控制风险的前提下谋求基金资产的中长期稳定增值。

(三)基金管理人:信诚基金管理有限公司
信息披露负责人:李峰
联系电话:021-68949788
传真:021-58826756

电子邮箱:christina.li@citicfund.com
(四)基金托管人:中国农业银行
信息披露负责人:李芳菲
联系电话:010-68424199
传真:010-68424181

电子邮箱:lifangfei@abchina.com
(五)半年度报告的披露
载半年度报告正文的基金管理人网址:www.citicfund.com.cn
基金半年度报告置备地点:基金管理人及基金托管人的办公场所

二、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标

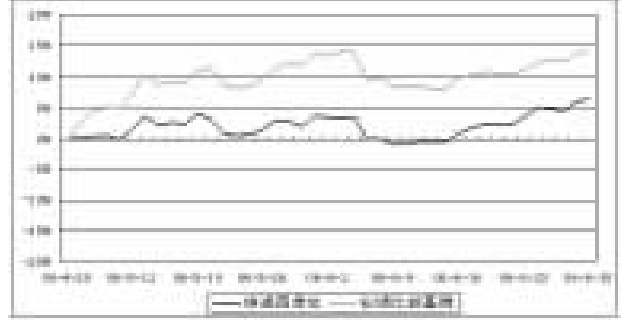
主要财务指标	2006年4月29日至6月30日
基金本期净收益	47,393,416.20
基金份额本期净收益	0.0150
期末可供分配基金收益	47,397,135.26
期末可供分配基金份额收益	0.0149
期末基金资产净值	3,428,398,743.67
期末基金份额净值	1.0628
基金加权平均净值收益率	1.47%
本期基金份额净值增长率	6.28%
基金份额累计净值增长率	6.28%

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二)基金净值表现
1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率(1)	净值增长率(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去一个月	4.27%	1.06%	2.00%	1.12%	2.27%	-0.06%
自基金合同生效至今	6.28%	1.09%	13.96%	1.26%	-7.67%	-0.17%

2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的走势对比图



注:自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未滿一年。

三、管理人报告
(一)基金管理人及基金经理情况:
1.本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于2005年9月30日正式成立,注册资本1亿元,注册地为上海。公司由中信集团旗下中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司、中新苏州工业园区创业投资有限公司、苏州高新区经济发展集团总公司四家股东共同出资发起设立,各股东出资比例分别为33%、33%、18%、16%。本基金是管理人旗下第一只基金。

2.基金经理简介:本基金实行双基金经理制,由岳茂庭先生和孙志洪先生共同管理。
岳茂庭先生,CFA,经济学硕士,MBA,历任美国大联资产管理(伦敦)公司研究员/基金经理(新加坡)发展证券(香港)公司副总裁、中国国际金融(香港)公司副总经理。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

孙志洪先生,文学学士,历任海南航空股份有限公司计划财务部经理、富岛资产管理有限公司(原高岛基金)研究部经理、南方基金管理有限公司研究员/基金经理。现任信诚基金管理有限公司股票投资总监。

(二)报告期内基金运作的遵规守信情况说明:
本基金管理人在报告期内,严格遵守《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

(三)报告期内基金的投资策略和业绩表现说明:
本基金于2006年5月8日正式开始投资运作,时逢大盘振荡上探,中期建仓比较积极。在股市接近1700点时停止了建仓,又在市场回调到1500点附近,加仓了股票中看好的行业和个股集中。6月末,本基金股票仓位控制在中等水平,略低于同业水平。因通胀压力存在,宏观政策紧缩,债券存在下跌风险,基金多采用现金主要集中在银行和做回购,后期积极参与了新股申购。股票资产配置主要集中在机械设备、食品饮料、交通运输、基础设施、通讯和电子元器件等行业。

在本基金初始建仓期,市场迅速上涨,基金手里有较多现金造成典型的现金拖累,导致本基金在5月份落后业绩比较基准。到6月份本基金初始建仓完毕,当月净值增长超越基准,排在134只偏股型基金前五分之一(数据来源:天相)。基金6月份业绩优异原因分析显示,资产配置、行业配置和选股三方面均对投资组合提供了正贡献。基金在消费及服务、交通运输、机械设备等行业的配置有明显的超额贡献。

(四)2006年下半年宏观经济、证券市场及行业走势展望及下一阶段操作策略
从大的层面看,宏观经济整体运行趋势良好,股改确定的股市长期价值基础基本确立。但由于经济总需求旺盛,部分行业出现泡沫抬头,宏观调控措施将有所加强,金融体系流动性充裕,在企业层面方面,企业利润预期良好,上游价格集中有降,价格传导开始向中下游转移。股权激励、整体上市、行业整合等因素会长期提升上市公司盈利,当前,新股、定向增发和部分非流通股流通对市场资金压力逐步加大。估值方面,目前全市场市盈率21倍(扣除亏损股),信诚TAA模型显示股市风险溢价率为2.5%,已从有较大投资价值吸引转入中性范围,股市生态呈现多样化,短线投资者追求成长甚至概念,稳健投资者追求价值和防御。中长期看,宏观经济运行良好,上市公司盈利增长可期,股改带来市场和上市公司微观层面的正面变化,都会让股市市场充满生机和机会。

本基金的投资分析体系显示,在目前的估值水平和市场及宏观环境下,稳健的投资布局是风险最小的选择,本基金将保持稳健的风格,保持中性仓位,密切关注市场变化,适当区间操作,非股票投资以现金工具和债券申购为主。

下一阶段基金将重点关注四大方面的投资机会:自主创新 and 产业升级;股权分置改革带来的个股层面的积极变化;国企改革、并购、资产注入、整体上市等,新股和定向增发;以及人民币升值的相关板块。在行业配置方面,本基金将重点配置装备制造等周期高增长、盈利动态良好的行业,逐步投资受益于30、电网投资的金属和配网实力科技股,优化配置医药、医药、农业产业化龙头、消费服务等行业等,适当配置受益于人民币升值的股票,稳健配置具有实质意义的新兴产业股票。

四、托管人报告
本基金托管人—中国农业银行根据《信诚四季红混合型证券投资基金合同》和《信诚四季红混合型证券投资基金托管协议》,在托管信诚四季红混合型证券投资基金的过程中,严格遵守《证券投资基金法》及相关法律法规,对信诚四季红混合型证券投资基金管理人—信诚基金管理有限公司2006年4月29日至2006年6月30日的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为,信诚基金管理有限公司在信诚四季红混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净

值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

本托管人认为,信诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的信诚四季红混合型证券投资基金2006年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

五、财务会计报告(未经审计)
(一)半年度资产负债表

项目	附注	2006.6.30
资产:		
银行存款		1,056,246,116.58
清算备付金		47,024,809.92
交易保证金		750,000.00
应收股利		812,704.60
应收利息	(1)	2,205,611.38
应收申购款		1,706,738.40
其他应收款		136,000.00
股票投资市值		2,096,512,388.97
其中:股票投资成本		1,949,425,001.24
债券投资市值	(2)	301,695,756.87
其中:债券投资成本		297,825,686.64
权证投资市值		0.00
其中:权证投资成本		0.00
资产合计:		3,506,090,105.72
负债:		
应付证券清算款		67,757,888.83
应付赎回款		0.00
应付管理费		0.00
应付托管费		0.00
应付管理人报酬		4,031,036.11
应付托管费		671,839.37
应付利息	(3)	3,350,741.80
其他应付款	(4)	801,840.00
预提费用	(5)	78,036.94
负债合计:		76,691,362.05
持有人权益:		
实收基金	(6)	3,225,781,935.27
未实现利得	(7)	154,679,673.14
未分配收益		47,937,135.26
持有人权益合计:		3,428,398,743.67
负债及持有人权益合计:		3,506,090,105.72

信诚四季红混合型证券投资基金经营业绩表及收益分配表
(单位:人民币元)

项目	附注	2006.4.29—2006.6.30
一、收入		
1.股票差价收入	(8)	30,007,210.27
2.债券差价收入	(9)	1,130,330.52
3.权证差价收入	(10)	5,667,138.07
3.债券利息收入		749,174.65
4.存款利息收入		3,318,650.18
5.股利收入		15,393,906.56
6.收入退还证券收入		701,991.00
7.其他收入	(11)	0.00
收入合计		56,968,401.25
二、费用		
1.基金管理人报酬		8,126,613.89
2.基金托管费		1,354,435.66
3.卖出回购证券支出		0.00
4.其他费用	(12)	93,596.50
其中:信息披露费		54,212.22
审计费用		23,823.72
费用合计		9,574,985.05
三、基金净收益		47,393,416.20
加:未实现利得		149,957,437.96
四、基金经营业绩		197,350,854.16
本期基金净值		47,393,416.20
加:期初基金净值		0.00
加:本期损益平衡		543,719.06
可供分配基金净收益		47,937,135.26
减:本期已分配基金净收益	(13)	0.00
期末未分配基金净收益		47,937,135.26

信诚四季红混合型证券投资基金基金净值变动表
(单位:人民币元)

项目	2006.4.29—2006.6.30
一、期初基金净值	3,006,323,520.62
二、本期投资活动:	
基金净收益	47,393,416.20
加:未实现利得	149,957,437.96
经营活动产生的基金净值变动数	197,350,854.16
三、本期基金份额变动:	
基金申购款	224,724,368.89
基金赎回款	0.00
基金份额交易产生的基金净值变动数	224,724,368.89
四、本期向持有人分配基金净收益	0.00
五、期末基金净值	3,428,398,743.67

(二)半年度会计报表附注
1.半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计说明
1.1编制基金会计报表遵循的主要会计制度及其他有关规定
本基金的会计报表按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则》、《金融企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号》(半年度报告的内容与格式)、《证券投资基金信息披露编报规则》及中国证券监督管理委员会允许的主要会计政策所述的基金行业的实务操作约定而编制。

1.2会计年度
为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2006年4月29日基金合同生效日至2006年6月30日。
1.3记账本位币
本基金的记账本位币为人民币。

1.4估值基础和计价原则
本基金的会计核算以权责发生制为记账基础,除股票投资和交易所上市债券投资按市价计价外,所有报表项目均以历史成本计价。
1.5基金资产的估值原则
——上市股票按估值日其在证券交易所的收盘价计算;估值日无交易的,以最近一个交易日的收盘价计算;
——上市债券的计价:送股、转股、配股和增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价计算;首次发行的股票,按成本价计算。
——配股权证,从配股权证日起到配股确认日止,若收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值;若配股价等于或低于配股价,则估值为零。
——权证投资,从获赠权证日起到配股确认日止,未上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的市场交易收盘价估值;未上市交易的权证按公允价值估值。
——证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,按接近交易日的收盘价估值;
——证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值,估值日没有交易的,按最近交易日债券收盘价减去债券应收利息得到的净价进行估值;
——上市债券和不在银行间同业市场的交易所上市债券按成本价估值。
1.6证券交易所的成本计价方法
——股票投资
买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应付的全部价款入账。因股权分置改革获得非流通股股东支付的现金对价冲减股票投资成本。
——买入债券于成交日确认股票差价收入,出售债券的成本按移动加权平均法于成交结转。
——债券投资
买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场的债券于实际支付价款日确认为债券投资。债券投资按成交日应付的全部价款入账,其中所包含债券起息日至上次付息日应支付的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。
——买入央行票据和零息债券时向同一性还本付息的债券投资,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率和票,按上述会计处理方法核算。
——卖出债券于成交日确认债券差价收入,卖出债券的成本按移动加权平均法于成交结转。
——权证投资
获赠权证在确认日(如果目标股票在确认日停牌,则在目标股票复牌日确认),按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。
1.7待摊费用的摊销方法和摊销期限
本基金待摊费用核算已经发生的、影响基金份额净值小数点后第五位的项目,采用直线法分摊计入本期和以后各期。
1.8收入的确认和计量
——股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。
——债券差价收入于卖出债券成交日确认;银行间同业市场的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。
——权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其相关费用的差额确认。
——债券利息收入按债券票面价值和票面利率与内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期间逐日计提。
——存款利息收入按存入的本金与适用利率逐日计提。
——买入返售金融资产按融出资金金额及约定利率,在返售期限内采用直线法逐日计提。
——其他收入于实际收到款项时确认。
1.9费用的确认和计量
1.9.1基金管理人报酬:根据《信诚四季红混合型证券投资基金合同》的规定,基金管理人报酬按前一基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。
1.9.2基金托管费:根据《信诚四季红混合型证券投资基金合同》的规定,基金托管费按前一日

基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。
1.9.3卖出回购证券支出:卖出回购证券支出按融入资金金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。
1.9.4证券交易费用
1.9.5基金信息披露费用
1.9.6基金持有人大会费用
1.9.7与基金相关的会计师事务所费
1.9.8按照国家有关规定可以列入的其他费用
上述1.9.4至1.9.8项费用由基金管理人根据其他有关法规和相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用,如果影响基金份额净值小数点后第五位的,则采用待摊或预提的方法。根据《信诚四季红混合型证券投资基金合同生效公告》的约定,本基金发行中所发生的律师费、会计师费和法定信息披露费等费用从基金发行费用中列支,即由本基金管理人信诚基金管理有限公司承担,而不从基金资产支付。

1.10实收基金
实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元,由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

1.11未实现利得
未实现利得包括投资估值而产生的投资估值增值和未实现利得平衡。
未实现利得平衡指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未实现利得占基金净值比例计算的金额。未实现利得平衡于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

1.12损益平衡
损益平衡指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的未分配基金净收益/累计基金净损失/基金净值比例计算的金额。损益平衡于基金申购确认日或基金赎回确认日确认,并于期末全额转入未分配基金净收益/累计基金净损失。

1.13基金的收益分配政策
①基金收益分配应采用现金方式;
②每一基金份额享有同等分配权;
③基金当期收益先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;
④基金当期出现亏损,则不进行收益分配;
⑤基金收益分配后每基金份额净值不得低于面值;
⑥本基金采用季结算的收益分配机制;

(1)分红结算日:每季最后一个工作日作为每季分红结算日;
(2)分红前提:分红结算日基金份额净值超过1.00元,且基金资产已实现收益;
(3)分红比例:本基金进行收益分配,至少分配基金份额净值超过1.00部分的25%;但分红金额不得超过已实现收益,且分配后基金份额净值不低于1.00元;

(4)以发行基金日与除权日:基金管理人于每季末分红结算日(T日)决定是否分红,若确定分红,经基金托管人核实后,则T+1日为权益登记日并进入除权日,T+7日实现派现。
若基金已实现收益不足基金份额净值超过1.00元部分的25%,在满足法律法规的前提下,基金将全部或部分已实现收益(每份基金份额的最小分配单位为0.1分)。
⑦本基金实行每年定期结转收益,但不保证每季实现分红。在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年不得超过4次,基金合同生效后下一个季度开始分红结算;
⑧基金年度收益分配比例不得低于基金年度已实现收益的90%;
⑨法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2.纳税
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券投资基金交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要纳税列示如下:
①以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。
②基金买卖股票、债券的差价收入,自2004年1月1日起继续免征营业税和企业所得税。
③金融债、国债利息收入,自2004年1月1日起,对基金企业、发行债券的企业在向基金支付上述收入时,代扣代缴20%的个人所得税。从2005年6月13日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,暂按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计征个人所得税。
④从2005年1月24日起,股票买卖按照1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。
⑤对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

3.关联方关系及关联方交易
3.1关联方关系

关联方名称	与本基金关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、销售机构
中国农业银行	基金托管人、代销机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
英国保诚集团投资有限公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
苏州高新区经济发展集团总公司	基金管理人的股东

3.2关联方交易
下述关联方交易均在正常业务范围并按一般商业条款订立。
3.2.1本基金在会计期间未通过关联方席位进行交易。
3.2.2基金管理人报酬
基金管理人报酬按前一基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下:
H= E×1.5%×当年天数;
H为每日应计提的基金管理费;
E为前一基金资产净值
本基金在会计期间需支付基金托管费1,354,435.66元,每日计提并于下月的5个工作日内支付,至2006年6月30日已支付4,095,577.78元,尚有余额4,031,038.11元未付。

3.2.3基金托管费
基金托管费按前一基金资产净值的0.25%年费率计算。计算方法如下:
H= E×0.25%×当年天数;
H为每日应计提的基金托管费;
E为前一基金资产净值
本基金在会计期间需支付基金托管费1,354,435.66元,每日计提并于下月的5个工作日内支付,至2006年6月30日已支付682,698.29元,尚有余额671,839.37元未付。

3.2.4本基金在会计期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
3.2.5存款余额及由此产生的利息收入
本基金在本报告期内未与存在关联关系的存款余额为1,056,246,116.58元,在本报告期内获得的利息收入为3,250,571.57元。
4.报告期内流转受限的基金资产
本基金截至2006年6月30日止无受限的未上市新股情况如下(流通受限期限为三个月或六个月,具体流通日期以公司公告为准):

资产名称	数量	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限期间	流通日期
铜铝锌	34,423	560,788.00	1,404,114.17	市价	网下申购锁定未上市	2006-09-27
大阳股份	886,469	5,722,130.44	8,960,919.31	市价	网下申购锁定未上市	2006-09-25
中国国航	6,130,416	18,981,681.28	18,981,681.28	成本价	网下申购锁定未上市	2006-10-09
中国银行	6,130,416	18,981,681.28	18,981,681.28	成本价	网下申购锁定未上市	2007-01-06
中国国航	5,029,000	15,520,120.00	15,520,120.00	成本价	网下申购未上市	2006-07-06

(2)本基金期末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:

股票代码	股票名称	数量(股)	期末估值总额(元)	期末公允价值(元)	停牌日期	复牌日期	
600827	友邦股份	3,397,223	38,295,439.21	11,337	9/8	2006-5-22	2006-07-02

估值方法:估值日无交易的,以最近交易日(停牌前日)的市场交易收盘价估值。
六、投资组合报告
(一)报告期末基金资产组合:

资产项目	市值(元)	占总资产比例
股票	2,096,512,388.97	60.78%
债券	301,695,756.87	8.61%
银行存款和清算备付金	1,102,270,926.50	31.46%
其他资产	5,611,064.38	0.16%
合计	3,506,090,105.72	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合:

行业分类	市值(元)	市值占净值比例
A 农林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采矿业	140,656,688.13	4.10%
C 制造业	1,172,776,593.73	34.21%
CO 食品、饮料	264,860,100.02	7.43%
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	39,482,074.90	1.15%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	94,493,909.44	2.76%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	178,346,630.57	5.20%
C7 机械、设备、仪表	639,138,188.70	15.73%
C8 医药、生物制品	66,465,690.10	1.94%
C9 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	57,446,011.14	1.68%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	199,552,989.74	5.82%
G 信息技术业	106,756,872.94	3.08%
H 批发和零售业	121,137,102.45	3.63%
I 金融、保险业	223,607,638.29	6.62%
J 房地产业	40,018,636.00	1.17%
K 社会服务业	32,302,306.55	0.94%
L 传播与文化业	0.00	0.00%
M 综合类	2,257,360.00	0.07%
合计	2,096,512,388.97	61.12%

(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:

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占净值比例
1	600668	G 鲁 青	7,910,593	115,771,975.50	3.38%
2	000009	G 广 电	7,694,420	113,114,662.40	3.30%
3	600028	G 中国石化	6,162,467	101,075,418.75	2.95%
4	600009	G 广 矿	6,494,463	96,223,111.83	2.81%
5	60				