

德盛安心成长混合型证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
 本基金管理人的董事会及董事保证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。
 本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年1月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本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，投资有风险，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。

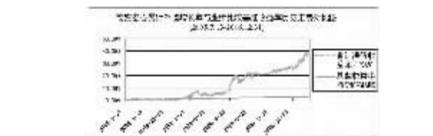
二、基金产品概况
 基金简称：德盛安心
 基金运作方式：契约型开放式
 基金合同生效日：2006年7月13日
 报告期末基金份额总额：43,226,367.46份
 投资目标：本基金为平衡型基金，基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验和深入研究中国经济发展的价值驱动因素，采用积极主动的投资策略，运用全球风险管理技术，追求长期稳定的投资回报，为基金持有人提供安全可靠的理财服务。
 投资策略：本基金严格遵守科学的投资管理流程，首先采取“自上而下”的分析方法，制定基金资产配置和资产配置策略，然后采取“自下而上”的基本面分析，挖掘出管理团队优秀、财务状况良好、增长潜力大、竞争地位独特的上市公司和预期收益较高的个股，深入进行全球经济发展的价值驱动因素，采用积极主动的投资策略，运用全球风险管理技术，追求长期稳定的投资回报，为基金持有人提供安全可靠的理财服务。
 业绩比较基准：本基金属于证券投资基金中的中低风险品种，其风险收益特征从长期平均及预期来看，介于单纯的股票型基金与单纯的债券型基金之间，也介于单纯的成长型组合与单纯的稳健型组合之间。本基金力争使基金的风险收益特征从长期平均来看高于业绩比较基准的同类基金风险收益特征。
 基金管理人名称：国联安基金管理有限公司
 基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司
三、主要财务指标和基金净值表现 (未经审计)
 (一) 各类财务指标

项目	2006年第4季度
基金本期净收益	5,088,160.96元
加权平均基金份额本期净收益	0.0906元
期末基金资产净值	47,719,713.70元
期末基金份额净值	1.104元

注：上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第1号《主要财务指标的计算及披露》。
 上述基金业绩指标不包括持有人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要低于所列数字。

(二) 与同期业绩比较基准变动的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	超额收益率⑤	②-④
过去3个月	12.46%	0.52%	0.55%	0.01%	11.90%	0.51%



注：本基金的业绩基准为“德盛安心成长线”，德盛安心成长线的确定：在基金合同生效时的收益率为0.90元，随着时间的推移每天上涨，在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。
四、管理人报告
 (一) 基金经理简介
 孙蔚女士，CPA (特许金融分析师)，CPA (注册会计师)，复旦大学博士研究生，曾任申银万国证券研究所高级研究员，行业研究部副经理及美国 FRAMLINGTON 基金管理公司基金经理助理，2003年加入本公司，2005年7月起担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2006年9月同时担任德盛稳健证券投资基金基金经理。
 夏研女士，纽约州立大学硕士研究生，历任罗兰贝格咨询集团(纽约)副总裁、华泰保险资产管理中心(上海)投资部经理。2003年加入本公司，在投资资产管理部从事固定收益投资组合工作。2006年3月起任本基金的基金经理。
 (二) 基金运作合法合规性报告
 本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制投资风险的前提下，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的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。
 (三) 基金投资策略和业绩表现说明
 1. 报告期内投资策略和业绩表现说明
 四季度沪深两市基本呈现单边上扬的走势，上证指数从三季度末的1752点直升到年底的2675点，涨幅超过50%，固然有新股上市首日的影响和年末工作中行两大银行的巨大贡献，总体收益仍十分可观。三季度表现较好的行业有金融、钢铁、石化、地产、食品等，表现落后的行业是电子元器件、日化、计算机硬件、电力设备、软件、化纤、医药等。本季度也出现了市场风格的转换，从小盘股的大幅超额收益转向大盘蓝筹股表现突出。
 四季度，德盛安心基金采用灵活的资产配置，主要集中在自下而上的个股选择。选择个股包括高成长性的成长类股，也结合基金追求低风险的特点，选择了部分下行风险较低的低风险品种。四季度重点低估值行业如钢铁、交通运输得到一定估值，基金也享受到较好投资收益，成功实现对收益的追踪。
 本季度，德盛安心基金的收益率为12.46%；业绩基准收益率为0.55%；超额收益率为11.90%。
 2. 对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 展望2007年，我们认为中国经济仍将保持良好的增长势头。从经济发展来看，丰富的劳动力资源，高储蓄率决定了较低的成本和较强的全球竞争力，内需市场在经济增长中的逐步启动，都决定中国经济具有中长期较快增长潜力。而本升值和证券市场的良好表现都将使经济获得巨大潜力的体现。结合证券市场制度建设日渐完善，我们对2007年的国内市场充满信心。
 基于对市场的看好，2007年安心成长基金希望相对侧重对成长股的追求。在灵活资产配置下，采取自下而上的行业布局与自下而上的个股选择相结合的投资方式，看好长期增长的行业如消费品、医药、通信、计算机、金融、钢铁、石化、能源、有色金属、先进制造业等；关注技术创新领域如航空航、信息设备、生物制药等。对于供需和成本变动的周期性行业如航空航、钢铁、有色金属，关注其阶段性机会。

五、基金投资组合
 (一) 基金资产组合情况

项目	期末市值(元)	占基金总资产的比例
银行存款和清算备付金合计	16,150,009.84	32.69%
股票	14,661,080.64	29.67%
债券	17,388,483.50	35.21%
权证	236,935.50	0.48%
其他资产	961,875.90	1.95%
合计	49,408,385.38	100.00%

(二) 按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	1,023,192.00	2.14%
C 制造业	7,874,108.04	16.50%
CO 食品、饮料	1,369,534.84	2.87%
C1 纺织、服装、皮毛	954,360.00	2.00%
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	983,178.00	2.06%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	2,357,951.16	4.94%
C7 机械、设备、仪表	2,209,084.04	4.63%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C9 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	1,335,215.56	2.80%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易业	803,160.00	1.68%
I 金融、保险业	1,472,400.00	3.09%
J 房地产业	1,971,000.00	4.13%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	181,106.10	0.38%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	14,661,080.64	30.72%

(三) 按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	期末数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	90,000	1,472,400.00	3.09%
2	600082	天地地	57,416	1,431,956.04	3.00%
3	600056	武钢股份	210,000	1,335,215.56	2.80%
4	000024	山东黄金	45,000	1,277,100.00	2.68%
5	600547	山东黄金	32,400	1,023,192.00	2.14%
6	600009	上海机场	52,000	983,320.00	2.06%
7	600096	云天化	71,400	983,178.00	2.06%
8	002029	七匹服装	48,200	954,360.00	2.00%
9	600019	宝钢股份	110,000	952,600.00	2.00%
10	000668	泸州老窖	36,000	912,240.00	1.91%

(四) 按券种分类的债券投资组合

德盛稳健证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
 本基金管理人的董事会及董事保证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。
 本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年1月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本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，投资有风险，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。

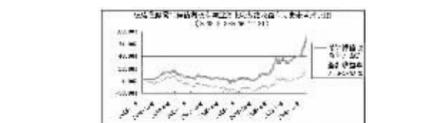
二、基金产品概况
 基金简称：德盛稳健
 基金运作方式：契约型开放式
 基金合同生效日：2003年8月8日
 报告期末基金份额总额：231,481,957.27份
 投资目标：本基金为平衡型基金，基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验和深入研究中国经济发展的价值驱动因素，采用积极主动的投资策略，运用全球风险管理技术，追求长期稳定的投资回报，为基金持有人提供安全可靠的理财服务。
 投资策略：本基金严格遵守科学的投资管理流程，首先采取“自上而下”的分析方法，制定基金资产配置和资产配置策略，然后采取“自下而上”的基本面分析，挖掘出管理团队优秀、财务状况良好、增长潜力大、竞争地位独特的上市公司和预期收益较高的个股，深入进行全球经济发展的价值驱动因素，采用积极主动的投资策略，运用全球风险管理技术，追求长期稳定的投资回报，为基金持有人提供安全可靠的理财服务。
 业绩比较基准：本基金整体业绩比较基准 = 国泰君安指数 × 65% + 上证国债指数 × 35%。
 风险收益特征：本基金属于证券投资基金中的中低风险品种，其风险收益特征从长期平均及预期来看，介于单纯的股票型基金与单纯的债券型基金之间，也介于单纯的成长型组合与单纯的稳健型组合之间。本基金力争使基金的风险收益特征从长期平均来看高于业绩比较基准的同类基金风险收益特征。
 基金管理人名称：国联安基金管理有限公司
 基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司
三、主要财务指标和基金净值表现 (未经审计)
 (一) 各类财务指标

项目	2006年第4季度
基金本期净收益	91,711,012.56元
加权平均基金份额本期净收益	0.2454元
期末基金资产净值	393,314,306.56元
期末基金份额净值	1.689元

注：上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第1号《主要财务指标的计算及披露》。
 上述基金业绩指标不包括持有人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要低于所列数字。

(二) 与同期业绩比较基准变动的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	超额收益率⑤	②-④
过去3个月	29.30%	1.20%	16.97%	0.87%	12.33%	0.33%



注：德盛稳健业绩基准 = 国泰君安指数 X 65% + 上证国债指数 X 35%。
四、管理人报告
 (一) 基金经理简介
 孙蔚女士，CPA (特许金融分析师)，CPA (注册会计师)，复旦大学博士研究生，曾任申银万国证券研究所高级研究员，行业研究部副经理及美国 FRAMLINGTON 基金管理公司基金经理助理，2003年加入本公司，2005年7月起担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2006年9月同时担任德盛稳健证券投资基金基金经理。
 (二) 基金运作合法合规性报告
 本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《德盛稳健证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制投资风险的前提下，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的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。
 (三) 基金投资策略和业绩表现说明
 1. 报告期内投资策略和业绩表现说明
 四季度沪深两市基本呈现单边上扬的走势，上证指数从三季度末的1752点直升到年底的2675点，涨幅超过50%，其中固然有新股上市首日的影响和年末工作中行两大银行的巨大贡献，总体收益仍十分可观。三季度表现较好的行业有金融、钢铁、石化、地产、食品等，表现落后的行业是电子元器件、日化、计算机硬件、电力设备、软件、化纤、医药等。本季度也出现了市场风格的转换，从小盘股的大幅超额收益转向大盘蓝筹股表现突出。
 四季度，德盛稳健基金保持灵活的资产配置，坚持自下而上的行业布局与自下而上的个股选择相结合、看好长期增长的行业如消费品、医药、通信、金融、钢铁、石化、能源、有色金属、先进制造业等；关注技术创新领域如航空航、信息设备、生物制药等。对于供需和成本变动的周期性行业如航空航、钢铁、有色金属，关注其阶段性机会。在个股选择上重点关注资产注入、奥运等各项主题。
 2. 对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 展望2007年，我们认为中国经济仍将保持良好的增长势头。从经济发展来看，丰富的劳动力资源，高储蓄率决定了较低的成本和较强的全球竞争力，内需市场在经济增长中的逐步启动，都决定中国经济具有中长期较快增长潜力。而本升值和证券市场的良好表现都将使经济获得巨大潜力的体现。结合证券市场制度建设日渐完善，我们对2007年的国内市场充满信心。
 2007年稳健基金将继续保持灵活的资产配置，继续自下而上的行业布局与自下而上的个股选择相结合、看好长期增长的行业如消费品、医药、通信、金融、钢铁、石化、能源、有色金属、先进制造业等；关注技术创新领域如航空航、信息设备、生物制药等。对于供需和成本变动的周期性行业如航空航、钢铁、有色金属，关注其阶段性机会。在个股选择上重点关注资产注入、奥运等各项主题。

(三) 按市值占基金总资产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	市值	市值占净值比
1	600036	招商银行	1,200,000	19,632,000.00	4.99%
2	600000	浦发银行	730,000	16,621,300.00	4.23%
3	002007	华兰生物	720,000	16,560,000.00	4.21%
4	600019	宝钢股份	1,000,000	15,588,000.00	3.96%
5	600056	武钢股份	2,414,808	15,358,178.88	3.90%
6	600582	天地地	6,000,000	14,964,000.00	3.80%
7	600037	歌华有线	555,561	13,811,246.46	3.51%
8	600030	中信证券	500,000	13,690,000.00	3.48%
9	600859	王府井	550,000	13,365,000.00	3.40%
10	600028	中国石化	1,410,000	12,859,200.00	3.27%

(四) 按券种分类的债券投资组合

德盛小盘精选证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
 本基金管理人的董事会及董事保证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。
 本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年1月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本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，投资有风险，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。

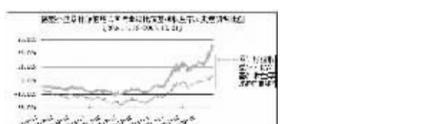
二、基金产品概况
 基金简称：德盛小盘
 基金运作方式：契约型开放式
 基金合同生效日：2004年4月12日
 报告期末基金份额总额：866,050,688.15份
 投资目标：本基金是一只积极成长型股票基金，专注于中国 A 股市场具有成长潜力的中小盘股。基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验和，在严格的风险控制机制下，采用积极主动的投资策略，通过多角度、多层次的基本面研究，充分发掘小盘股所具有的成长性带来的投资机会，并通过波段操作的择时策略追求较高的资本利得收益，从而实现投资者资产的长期增值。
 投资策略：本基金的投资管理主要分为两个层次：第一个层次是自下而上的证券选择。总体上说，对于本基金的投资重点——小盘股而言，将采取自下而上的方式，综合运用数量化的金融工程模型、科学严谨的财务分析深入上市公司研究与独特的草根研究等多种手段精选个股，并在此基础上构建股票投资组合。第二个层次是资产配置层面的投资管理，即对基金资产在股票、债券和现金三大资产类别间的配置进行实时监控，并根据当时的宏观经济形势和证券市场情绪调整资产配置比例，达到控制基金风险的目的。总之，本基金投资管理的一个层次都特定性研究和量化分析有机地结合起来，从而保证投资决策的科学性与风险收益结构的最佳性。
 业绩比较基准：本基金的整体业绩基准 = (天相小盘 x60% + 天相中盘 x40%) x 60% + 上证国债指数 x 40%。
 风险收益特征：本基金是一只积极成长型的股票基金，由于其股票投资组合以小盘股为主，本基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争使基金的风险收益特征从长期平均来看高于业绩比较基准的同类基金风险收益特征。
 基金管理人名称：国联安基金管理有限公司
 基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司
三、主要财务指标和基金净值表现 (未经审计)
 (一) 各类财务指标

项目	2006年第4季度
基金本期净收益	296,344,563.16元
加权平均基金份额本期净收益	0.2322元
期末基金资产净值	1,299,426,102.39元
期末基金份额净值	1.500元

注：上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第1号《主要财务指标的计算及披露》。
 上述基金业绩指标不包括持有人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要低于所列数字。

(二) 与同期业绩比较基准变动的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	超额收益率⑤	②-④
过去3个月	22.71%	0.98%	11.51%	1.00%	11.20%	-0.02%



注：德盛小盘业绩基准 = (天相小盘 x60% + 天相中盘 x40%) x 60% + 上证国债指数 x 40%。
四、管理人报告
 (一) 基金经理简介
 王铁先生，上海财经大学国际金融专业，学士学位。从1997年起，历任申银万国证券研究所助理，2004年加入本公司，在投资组合管理部从事研究、投资工作。2006年3月起担任德盛小盘精选基金基金经理。
 吴任先生，北京大学中国经济研究中心金融学专业，硕士学位。2001年进入国泰君安证券股份有限公司工作，任资产管理部基金经理助理；2003年加入本公司，历任总经理助理、投资组合管理部副总监，投资决策委员会成员。2006年12月起任本基金的基金经理。
 (二) 基金运作的合法合规性报告
 本报告期内，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、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制投资风险的前提下，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的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。
 (三) 基金投资策略和业绩表现说明
 1. 报告期内投资策略和业绩表现说明
 四季度，股市市场的整体表现非常稳健：单边上涨，市场内在强大的做多动力令我们意识到了市场的力量在经历过去两年的压抑之后是多么猛烈。在四季度，本基金资产配置上总体全力作多股票，在行业配置上在向均衡的方向转化，最终还是试图在个股选择上取得持续性的行情。
 四季度，本基金的整体业绩基准为 11.51%，业绩基准的累计收益率为 11.51%，超额收益率为 11.20%。
 四季度的市场不属于小盘股的，在短期来看，在类别资产层面，市场对于大盘股的狂热追捧达到了几乎登峰造极的程度。在短期中，中小、中大盘股涨幅超过中小盘股指数达到 50 个百分点左右。在群象狂热的情况下，虽然本基金相对业绩基准的超额收益指数在四季度尚可，但是和投资者的没有预期的普通基金相比，本基金在相对排名上正应受到投资者的质疑。
 2. 对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 本次全球流动性导致的流动性泛滥所引发的巨大资产泡沫，如果要求提高资金成本抑制泡沫的产生，一个具有全球约束力的统一行动的中央银行系统是必不可少，但可惜的是唯一具备这个能力的美国联储承担了这一责任。美国庞大的贸易赤字，失去支撑性的制造业产能提前收缩带来的后果是联储对信贷货币总量的控制力下降。另一方面，对经济体的巨大规模和特殊模式，即不承担亏损，按比例分享账面收益导致了较高的风险承受能力。通常来说，泡沫破灭有两个必要特征：流动性枯竭和投资者恐慌。目前看中央银行造成的充足流动性和对冲基金不恐慌的特性使得这次资产泡沫的规模和持续性可能是史无前例的。
 在全球一体化的背景下，中国股市市场也不可避免地被波及，就目前我们掌握的情况，还不能下结论说大的资产泡沫一定会在中国出现，但是确实有越来越多的迹象，这值得我们警惕。当然，我们远不是选择择机的中国，而宏观经济的变化又是那么复杂，我们无法尽量避免泡沫破裂造成的损失，但很可能永远也做不到。所以，选择结构合理的行业稳健而有确定性的公司，并以吸引人的价格买入他们的股票长期持有是我们的基本策略。我们希望通过这些公司的长期发展来规避择时这种高风险度的动作。世界上证券资产增值的规律何止千万，但是以低于合理价格买入并且长期持有优质公司，是我们认为最为稳妥的一种，在这条道路上，我们希望能够比别人走得稳而远。
 由于欠利率相对稳定性和有关生息的各项要素价格急剧上升，我们估计，实际的利率情况将得到严重而持续的缓解。对于资产泡沫的形成来说，没什么可比实际的利率和过高的流动性更好的流动性了。唯一能够减弱泡沫的措施是迅速扩大供应，用海量的证券来填补资金的胃口。
 所以，我们仍以合理的估计，2007年将是中国大型公司快速上市的一年，大型国有企

业的整体上市和增发 A 股将是贯穿 2007 年的主旋律。从长期来看，这些中国经济的主导公司上市对我们来说值得期待的事情，这代表着更多的选择。
 但要指出的是，证券市场是起伏不定的，货币价格在某种程度上是虚空的。我们更关注的是组合中的实际资产是否存在低估，这包括每只股票对标的的利润特别是分红是否日益增长，以及我们是否拥有有足够多的优秀公司的股份。我们将致力为投资者构建一个真正具有投资价值、经得起历史考验的资产组合。
 我们认定目前主要的投资机会来源于：
 a) 估值合理的持续成长性
 b) 持续增长的持续成长性
 c) 整体上市和资产注入
 d) IPO 中会有一些没有被市场充分认知的投资机会。

五、基金投资组合
 (一) 基金资产组合情况

项目	期末市值(元)	占基金总资产的比例
银行存款和清算备付金合计	98,087,883.61	7.50%
股票	817,598,233.30	63.46%
债券	273,090,409.56	20.67%
权证	24,334,907.45	1.84%
其他资产	6,970,973.21	0.53%
合计	1,321,082,407.13	100.00%

(二) 按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	9,360,828.80	0.72%
B 采掘业	54,720,000.00	4.21%
C 制造业	532,024,423.86	40.94%
CO 食品、饮料	60,563,841.26	4.66%
C1 纺织、服装、皮毛	8,820,000.00	0.68%
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	64,146,976.70	4.94%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	135,135,392.62	10.40%
C7 机械、设备、仪表	206,041,712.92	15.46%
C8 医药、生物制品	62,316,500.00	4.80%
C9 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	38,999,986.62	3.00%
E 建筑业	40,399,310.00	3.11%
F 交通运输、仓储业	25,927,861.84	2.00%
G 信息技术业	30,366,644.44	2.34%
H 批发和零售贸易业	16,572,058.88	1.28%
I 金融、保险业	4,229,571.40	0.33%
J 房地产业	89,932,571.40	6.92%
K 社会服务业	8,739,597.96	0.67%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	62,000,000.00	4.77%
合计	917,598,233.30	70.62%

(三) 按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	期末数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	600415	小商品城	800,000	62,000,000.00	4.77%
2	600082	天地地	2,202,812.00	54,938,131.28	4.23%
3	600028	中国石化	6,000,000.00	54,720,000.00	4.21%
4	600519	招商地产	550,000.00	48,306,500.00	3.72%
5	000024	山东黄金	1,494,030.00	42,400,571.40	3.26%

债券类别