长盛动态精选证券投资基金 2006年年度报告摘要

重要提示

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的董事会及董事保证长盛动态精选证券投资基金（以下简称“本基金”）2006年年度报告（以下简称“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2007年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告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。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告会计期间：2006年1月1日至2006年12月31日。

第一章 基金简介

一、基金基本资料

（一）基金名称：长盛动态精选证券投资基金

（二）基金简称：长盛动态精选基金

（三）基金交易代码：510081（前端收费）、511081（后端收费）

（四）基金运作方式：契约型开放式

（五）基金合同生效日：2004年5月21日

（六）报告期末基金份额总额：479,068,561.67份

（七）基金合同存续期：不定期

（八）基金份额上市的证券交易所：无

（九）上市日期：无

二、基金产品说明

（一）投资目标

本基金为开放式股票型基金。将通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。

（二）投资策略

本基金为主动管理的股票型基金，投资策略上偏重选股能力的发挥，时机的选择放在次要位置。

（三）业绩比较基准

中信综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%

（四）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的适度风险品种，在承担适度风险的前提下，获取长期稳定的收益。

三、基金管理人

（一）名称：长盛基金管理有限公司

（二）信息披露负责人：叶金松

（三）联系电话：010-82255818

（四）传真：010-82255988

（五）电子邮箱：yejs@csfunds.com.cn

四、基金托管人

（一）名称：中国农业银行

（二）信息披露负责人：李芳菲

（三）联系电话：010-68424199

（四）传真：010-68424181

（五）电子邮箱：lifangfei@abchina.com

五、信息披露

（一）登载本报告正文的管理人互联网网址：http://www.csfunds.com.cn

（二）基金年度报告置备地点：本报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公地址，供公众查阅、复制。

第二章 主要财务指标、基金净值表现和收益分配情况

所述基金业绩指标不包括基金份额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。

一、主要财务指标

序号	主要财务指标	2006年	2005年	2004年
1	基金本期净收益（元）	561,613,667.11	-168,991,524.74	1,788,209.95
2	基金份额本期净收益（元/份）	0.7940	-0.0629	0.0005
3	期末可供分配基金份额收益（元/份）	0.3798	-0.0602	-0.0371
4	期末基金资产净值（元）	847,049,438.69	2,340,967,870.05	2,913,869,622.11
5	期末基金份额净值（元/份）	1.7681	0.9955	0.9629
6	本期基金份额净值增长率	130.03%	3.39%	-3.71%

注：本基金合同生效日为2004年5月21日，2004年度主要财务指标的计算期间为2004年5月21日至2004年12月31日。

二、基金净值表现

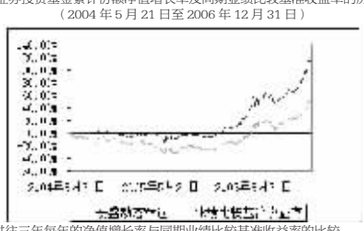
（一）本基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

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）	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	38.27%	0.0139	29.23%	0.0129	9.04%	0.0010
过去六个月	42.35%	0.0128	32.08%	0.0133	10.27%	-0.0005
过去一年	130.03%	0.0135	103.69%	0.0134	26.34%	0.0001
自基金成立起至今	129.00%	0.0105	55.77%	0.0129	73.23%	-0.0024

（二）本基金合同生效以来基金份额净值变动情况，及与同期业绩比较基准的变动比较

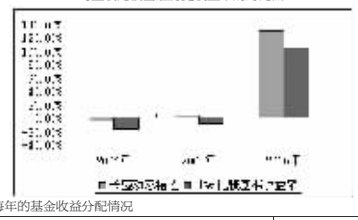
长盛动态精选证券投资基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004年5月21日至2006年12月31日）



（三）本基金过往三年每年的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛动态精选证券投资基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



三、过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数（至少保留三位小数）	备注
2004	0.000元	
2005	0.000元	
2006	0.200元	除息日：2006年2月14日
	3.500元	除息日：2006年10月30日
合计	3.700元	

第三章 管理人报告

第一节 基金管理人及基金经理情况

一、基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币10000万元。目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券有限责任公司49%、安徽省创新投资有限公司26%、安徽省投资集团有限责任公司25%。截止2006年12月31日，基金管理人共管理四支封闭式基金、五支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。

二、基金经理介绍

王宁，现任本基金基金经理。EMBA。历任华夏基金管理有限公司兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司。

裴愔愔，现长盛动态精选基金基金经理助理。女，1979年12月出生，2001年7月获经济学学士学位，2003年7月获法学硕士学位，现任长盛成长价值基金基金经理助理。2003年7月加入长盛基金，担任行业研究员。

第二节 对报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《基金法》及其各项实施准则、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

第三节 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

一、2006年市场回顾

2006年国内A股市场涨势如虹，上海综合指数创历史新高！中国工商银行发行创全球股票筹资金额最高记录，在财富效应带动下，共同基金发行连续创新记录。

人民币升值继续保持加速度，金融、房地、消费、制造等行业主流优势股票连续大幅上涨。

动态精选基金认为，股权分置制度性改革，标志着经过5年调整的国内资本市场已经转入升势。股权分置改革以后，全流通将加快国内主流优势公司和社会产业资本优化资源配置的速度和力度，长期趋势继续向好，保持积极进取投资风格。

二、2006年本基金运作总结

本基金采取积极进取的主动方式管理基金。首先将债券固定收益类资产降低到零，全面提高股票权益类资产比例，股票资产提高到80%-95%。其次调整股票风格资产比例，降低共用事业类等防守型股票资产比例，全面提高金融服务消费等成长性和进攻性股票资产比例。最后坚持长期重点投资国内主流优势公司，集中分享股市的丰厚回报。

第四节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

综观中国20多年政府主导的市场化改革道路，任何行业的制度性的变革，都带来了行业的大发展时期。证券市场股权分置改革拉开了证券市场制度性变革的序幕。

中国经济持续稳定地增长，人民币升值、流动性充裕、蓝筹公司不断发行上市等因素为股市长期上涨提供强大的持久动力。

“股权分置改革基本完成，解决了长期影响我国证券市场健康发展的重大历史问题”，目前市场进入全流通、股票、资金大扩容、金融产品创新时代：

一、股权分置改革、全流通实现资产优化配置，股改业绩等承诺、股权激励、市值考核“清理违规占用上市公司资金工作取得显著成效”等改革措施使不同股东之间利益趋于一致，利益机制变化导致A股市场由套现市场转变成资产利润注入市场，提高市场整体投资价值。

二、“小非”、“大非”借助全流通减持股票给社会流通股东，将逐渐改变上市公司的股东格局，上市公司逐渐成为真正的公众公司的可能性增加，有利于形成流通股东文化，监督上市公司合规经营，保护股东合法利益。

三、大扩容继续改变国内市场结构，类似于中国工商银行这样的全面代表中国经济的股票不断上市，有利于提高市场投资性，降低投机性。

四、“扩大直接融资规模和比重”，有利改变居民财富结构，提高国内居民股权财富比重，央行发布的2006年金融运行数据显示，2006全年，居民存款增加2.09万亿元，同比少增1125亿元。2006年底“股民”开户人数达到8000万户。大型股票型共同基金成为吸纳流动性过剩的重要载体。

五、“多元化机构投资者队伍逐步壮大，市场影响力明显增强”汇金、国资委、社保、保险、QFII、产业资本、共同基金、股权投资基金等成为市场的主导力量，有利于市场投资者结构稳定。

六、“建立多层次金融市场体系的基础工作有序进行”，为产业资本调整资产结构、创业资本退出等提供场所，多元化机构投资者队伍和多层次金融市场体系之间形成良性循环的金融资本产业链条。

七、“全面开展金融期货筹备工作”权证、期货等金融创新产品有利于优化定价效率。

未来的风险和机遇：

一、大股东通过市场化手段实现资源配置，调整产业政策的方向和变化，预示市场投资重点品种的转换。

二、“国际收支不平衡加剧”人民币升值和贸易流通性过剩的矛盾引起国内资产价格和产业格局的变化带来的投资机会。

基金操作策略：

坚持投资主流优势公司，跟随市场趋势和主流品种。

坚持通过基本面和市场面相结合的方法调整品种结构，实现组合的优化配置，为投资者提供长期稳定持续回报。

最后提醒投资者的是：下阶段我们将重点关注的10只股票：上海汽车、西飞国际、广船国际、特变电工、中信证券、沈阳机床、大秦铁路、中国玻纤、中国联通、轴研科技。

第四章 托管人报告

在托管长盛动态精选证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长盛动态精选证券投资基金基金合同》、《长盛动态精选证券投资基金托管协议》的约定，对长盛动态精选证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司2006年1月1日至2006年12月31日基金的投资运作，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，长盛基金管理有限公司在长盛动态精选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规定进行。

本托管人认为，长盛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，基金管理人所编制和披露的长盛动态精选证券投资基金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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

2007年3月28日

第五章 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、陈宇2007年3月26日对本基金2006年12月31日的财务状况以及2006年度的经营成果和基金净值变动出具了普华永道中天审字（2007)第20269号无保留意见的审计报告。

第六章 财务会计报告

第一节 基金会计报表（经审计）

一、资产负债表

长盛动态精选证券投资基金资产负债表

单位：人民币元

项目	2006年12月31日	2005年12月31日
资产		
银行存款	95,834,012.65	272,352,132.65
清算备付金	991,971.16	1,317,095.91
交易保证金	1,460,000.00	1,460,000.00
应收证券清算款	8,242,523.85	2,041,896.67
应收股利	0.00	0.00
应收利息	28,864.31	5,373,777.34
应收申购款	104,158.04	19,700.00
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	744,599,412.78	1,800,373,401.84
其中：股票投资成本	369,469,568.06	1,651,837,959.76
债券投资市值	0.00	278,771,032.59
其中：债券投资成本	0.00	277,966,919.84
权证投资	0.00	0.00
其中：权证投资成本	0.00	0.00
买入返售证券	0.00	11,900,000.00
待摊费用	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	851,260,942.79	2,373,609,037.00
负债及持有人权益		
负债		
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	1,740,846.73	28,108,957.39
应付赎回费	3,718.83	70,797.04
应付管理人报酬	1,020,152.58	2,944,723.54
应付托管费	136,020.31	392,629.79
应付佣金	715,565.65	524,059.19
应付利息	0.00	0.00
应付收益	0.00	0.00
应交税金	0.00	0.00
其他应付款	500,200.00	500,000.00
卖出回购证券款	0.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	95,000.00	100,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	4,211,504.10	32,641,166.95
持有人权益		
实收基金	479,068,561.67	2,351,575,395.95
未实现利得	186,037,626.66	130,940,690.09
未分配收益	181,943,250.36	-141,548,215.99
持有人权益合计	847,049,438.69	2,340,967,870.05
负债及持有人权益总计	851,260,942.79	2,373,609,037.00

注：2006年12月31日每份额基金资产净值：1.7681元，2005年12月31日每份额基金资产净值：0.9955元。

二、经营业绩表及收益分配表

长盛动态精选证券投资基金经营业绩表

单位：人民币元

项目	2006年度	2005年度
收入		
股票差价收入	540,764,518.12	-196,894,442.46
债券差价收入	494,449.18	529,858.44
权证差价收入	21,003,711.33	19,680,575.45
债券利息收入	1,113,326.63	15,566,914.59
存款利息收入	1,094,769.07	3,775,177.41
股利收入	11,372,031.20	31,994,155.60
买入返售证券收入	1,802.00	23,505.00
其他收入	2,349,605.38	751,663.93
收入合计	578,194,212.91	-124,572,592.04
费用		
基金管理人报酬	14,270,961.92	38,588,570.61
基金托管费	1,902,794.89	5,145,142.83
卖出回购证券支出	0.00	265,782.72
利息支出	0.00	0.00
其他费用	406,788.99	419,436.54
其中：上市年费	0.00	0.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
审计费用	95,000.00	100,000.00
费用合计	16,580,545.80	44,418,932.70
基金净收益	561,613,667.11	-168,991,524.74
加：未实现利得	225,790,289.89	253,458,829.43
基金经营业绩	787,403,957.00	84,467,304.69
本期基金净收益	561,613,667.11	-168,991,524.74
加：期初基金净收益	-141,548,215.99	-3,478,465.23
加：本期损益平准金	37,114,990.85	30,921,773.98
可供分配基金净收益	457,180,441.97	-141,548,215.99
减：本期已分配基金净收益	275,237,191.61	0.00
期末基金净收益	181,943,250.36	-141,548,215.99

所述基金业绩指标不包括基金份额持有人交易基金的各项费用（例如开放式基金申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

三、基金净值变动表

长盛动态精选证券投资基金基金净值变动表

单位：人民币元

项目	2006年度	2005年度
期初基金净值	2,340,967,870.05	2,913,869,622.11
本期经营活动		
基金净收益	561,613,667.11	-168,991,524.74
未实现利得	225,790,289.89	253,458,829.43
经营活动产生的基金净值变动数	787,403,957.00	84,467,304.69
本期基金份额交易		
基金申购款	900,182,420.94	93,636,617.67
其中：分红再投资	12,667,190.45	0.00
基金赎回款	-2,906,267,617.69	-751,005,674.42
基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,006,085,196.75	-657,369,056.75
本期向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	-275,237,191.61	0.00
年末基金净值	847,049,438.69	2,340,967,870.05

第二节 年度会计报表附注（经审计）

一、本报告期对投资分离交易可转债以及获取的权证所采用的会计政策、会计估计的相关列示见本报告正文。

二、本报告期无重大会计差错和内容的更正金额。

三、关联方关系及关联方交易

（一）关联方关系：本报告期内，本基金无关联方关系的变化情况。

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券有限责任公司（以下简称“国元证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
安徽省创新投资有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

（二）关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

1、通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

单位：人民币元

	2006年度		2005年度	
	成交量	占全年成交量的比例	成交量	占全年成交量的比例
国元证券				
买卖股票	823,060,158.06	24.60%	642,819,116.71	24.55%
买卖债券	25,252,056.10	12.39%	5,127,050.00	2.31%
买卖权证	21,005,487.54	100.00%	0.00	0.00%
	佣金	占全年佣金总量的比例	佣金	占全年佣金总量的比例
国元证券	667,793.69	24.70%	512,218.03	24.21%

上述佣金按市场佣金率计算，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。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议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。

2、关联方报酬

（1）基金管理人报酬

支付基金管理人长盛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。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬14,270,961.92元(2005年：38,588,570.61元)。

（2）基金托管报酬

支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%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×0.2%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费1,902,794.89元(2005年：5,145,142.83元)。

3、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农业银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为95,834,012.65元(2005年：272,352,132.65元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,068,225.81元(2005年：3,640,760.40元)。

4、与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：无

5、关联方持有的基金份额

（1）基金管理人所持有的本基金份额：本基金管理人于2006年、2005年的报告期末和报告期内均未持有本基金份额。

（2）基金其他关联方及其控制的机构于2006年、2005年的报告期末和报告期内均未持有本基金份额。

四、报告期末流通受限制不能自由转让的基金资产

（一）本基金截至2006年12月31日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
方案沟通协商阶段停牌：								
000895	S双汇	06-06-01	31.17	未知	未知	2,000,000	24,474,153.71	62,340,000.00

（二）基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至2006年12月31日止投资的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	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601628	中国人寿	06-12-28	07-01-09	18.88	18.88	99,000	1,869,120.00	1,869,120.00
601988	中国银行	06-06-28	07-01-05	3.08	5.43	235,785	726,217.80	1,280,312.55
601006	大秦铁路	06-07-26	07-02-01	4.95	8.10	70,840	350,658.00	573,804.00
002073	青岛软控	06-09-28	07-01-18	26.00	47.35	8,281	215,306.00	392,105.35
合计							3,161,301.80	4,115,341.90

五、其他事项

本基金的基金管理人于2007年2月1日宣告2007年度第1次分红，向截至2007年2月7日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体基金份额持有人，按每10份基金份额派发红利5.80元。

第七章 投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

资产项目	金额（人民币元）	占基金资产总值比例
股票市值	744,599,412.78	87.47%
债券市值	0.00	0.00%
权证市值	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	96,825,983.81	11.37%
其他资产	9,835,546.20	1.16%
合计	851,260,942.79	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
A农、林、牧、渔业	8,220.00	0.00%
B采掘业	62,929,602.00	7.43%
C制造业	439,961,716.23	51.94%
C0食品、饮料	156,105,000.00	18.43%
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	639.00	0.00%
C4石油、化学、塑胶、塑料	43,463,262.88	5.13%
C5电子	2,000.00	0.00%
C6金属、非金属	44,821,188.00	5.29%
C7机械、设备、仪表	195,568,545.35	23.09%
C8医药、生物制品	1,081.00	0.00%
C99其他制造业	0.00	0.00%
D电力、煤气及水的生产和供应业	1,032.00	0.00%
E建筑业	1,238.00	0.00%
F交通运输、仓储业	33,677,084.00	3.98%
G信息技术业	8,631.00	0.00%
H批发和零售贸易	951.00	0.00%
I金融、保险业	147,794,232.55	17.45%
J房地产业	60,216,000.00	7.11%
K社会服务业	706.00	0.00%
L传播与文化产业	0.00	0.00%
M综合类	0.00	0.00%
合计	744,599,412.78	87.91%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	4,900,000	80,164,000.00	9.46%
2	600028	中国石化	6,900,000	62,928,000.00	7.43%
3	000895	S双汇	2,000,000	62,340,000.00	7.36%
4	000002	万科A	3,900,000	60,216,000.00	7.11%
5	600887	伊利股份	1,900,000	50,350,000.00	5.95%
6	000858	五粮液	1,900,000	43,415,000.00	5.13%
7	601398	工商银行	5,984,000	37,100,800.00	4.38%
8	600150	沪东重机	1,000,000	31,800,000.00	3.75%
9	000410	沈阳机床	1,500,000	30,075,000.00	3.55%
10	600495	晋西车轴	1,400,000	29,162,000.00	3.44%
11	600458	时代新材	3,500,000	28,245,000.00	3.34%
12	600030	中信证券	1,000,000	27,380,000.00	3.23%
13	600019	宝钢股份	3,000,000	25,980,000.00	3.07%
14	600089	特变电工	1,509,750	22,570,762.50	2.67%
15	000039	中集集团	1,000,000	18,840,000.00	2.22%
16	600685	广船国际	999,835	17,697,079.50	2.09%
17	600320	振华港机	1,500,000	17,640,000.00	2.08%
18	600018	上港集团	2,500,000	17,475,000.00	2.06%
19	600104	上海汽车	2,100,000	17,157,000.00	2.03%
20	601006	大秦铁路	2,000,000	16,200,000.00	1.91%
21	000768	西飞国际	1,305,200	15,270,840.00	1.80%
22	600176	中国玻纤	2,009,884	15,214,821.88	1.80%
23	002046	轴研科技	1,000,000	13,800,000.00	1.63%
24	601628	中国人寿	99,000	1,869,120.00	0.22%
25	601988	中国银行	235,785	1,280,312.55	0.15%
26	002073	青岛软控	8,281	392,105.35	0.05%
27	002069	獐子岛	100	7,404.00	0.00%
28	002065	东华合创	100	2,752.00	0.00%
29	002052	同洲电子	130	2,715.70	0.00%
30	600406	国电南瑞	118	2,696.30	0.00%
31	002056	横店东磁	100	2,000.00	0.00%
32	600686	金龙汽车	100	1,706.00	0.00%
33	601699	潞安环能	100	1,602.00	0.00%
34	002061	江山化工	100	1,314.00	0.00%
35	002062	宏润建设	100	1,238.00	0.00%
36	002068	黑猫股份	100	1,214.00	0.00%
37	002066	瑞泰科技	100	1,188.00	0.00%
38	600518	康美药业	100	1,081.00	0.00%
39	002031	巨轮股份	100	1,051.00	0.00%
40	601991	大唐发电	100	1,032.00	0.00%
41	002058	威尔泰	100	1,001.00	0.00%
42	600631	百联股份	100	951.00	0.00%
43	002054	德美化工	100	913.00	0.00%
44	600467	好当家	100	816.00	0.00%
45	601872	招商轮船	100	795.00	0.00%
46	601333	广深铁路	100	720.00	0.00%
47	002059	世博股份	100	706.00	0.00%
48	002067	景兴纸业	100	639.00	0.00%
49	000652	泰达股份	100	569.00	0.00%
50	600050	中国联通	100	467.00	0.00%

四、报告期内股票投资组合重大变动

（一）报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额（人民币元）	占期初基金资产净值的比例
1	600019	宝钢股份	34,619,232.47	1.48%
2	600036	招商银行	33,923,889.83	1.45%
3	000002	万科A	29,888,598.38	1.28%
4	600631	百联股份	26,596,839.82	1.14%
5	600416	湘电股份	24,767,255.50	1.06%
6	601006	大秦铁路	24,724,790.11	1.06%
7	600150	沪东重机	22,985,825.17	0.98%
8	000039	中集集团	22,811,755.64	0.97%
9	600050	中国联通	22,058,014.49	0.94%
10	600458	时代新材	21,726,785.31	0.93%
11	000410	沈阳机床	20,884,587.76	0.89%
12	000930	丰原生化	19,786,901.83	0.85%
13	601398	工商银行	19,455,382.32	0.83%
14	002046	轴研科技	18,989,426.13	0.81%
15	600089	特变电工	18,949,403.53	0.81%
16	002031	巨轮股份	17,103,513.51	0.73%
17	601988	中国银行	16,581,284.66	0.71%
18	600495	晋西车轴	16,141,047.90	0.69%
19	600018	上港集团	15,941,819.75	0.68%
20	600030	中信证券	15,632,768.17	0.67%

（二）报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额（人民币元）	占期初基金资产净值的比例
1	600900	长江电力	150,339,859.72	6.42%
2	600320	振华港机	132,180,533.80	5.65%
3	600036	招商银行	125,947,510.64	5.38%
4	000002	万科A	115,056,997.12	4.91%
5	600019	宝钢股份	112,201,207.89	4.79%
6	600694	大商股份	91,393,263.89	3.90%
7	000402	金融街	81,832,384.26	3.50%
8	600583	海油工程	81,052,635.40	3.46%
9	000869	张裕A	69,980,751.12	2.99%
10	600406	国电南瑞	67,421,934.91	2.88%
11	000063	中兴通讯	65,353,272.78	2.79%
12	000858	五粮液	64,224,483.22	2.74%
13	000970	中科三环	64,206,165.82	2.74%
14	600009	上海机场	63,572,213.54	2.72%
15	600276	恒瑞医药	57,785,404.71	2.47%
16	600028	中国石化	56,918,946.86	2.43%
17	600585	海螺水泥	50,628,821.24	2.16%
18	600309	烟台万华	50,347,838.07	2.15%
19	600717	天津港	48,288,826.25	2.06%
20	600887	伊利股份	46,412,887.31	1.98%

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额：

项目	金额（人民币元）
买入股票成本总额	768,072,810.27
卖出股票收入总额	2,587,209,067.50

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金期末未持有债券。

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

本基金期末未持有债券。

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本基金期末未持有资产支持证券。

八、报告期末本基金投资权证明细

（一）报告期末持有权证明细

本基金期末未持有权证。

（二）报告期内获得权证明细

获取方式	权证代码	权证名称	数量（份）	成本总额（人民币元）
主动持有	无	无	0	0.00
被动持有	580005	万华HXB1	1,000	0.00
	580009	伊利CWB1	600,000	0.00
	030002	五粮YGC1	1,833,000	0.00
	580993	万华HXP1	1,500	0.00
	580996	沪场JTP1	1,500,000	0.00
	580997	招行CMP1	6,600,000	0.00
	038003	华菱JTP1	1,078,776	0.00
	038004	五粮YGP1	1,927,000	0.00

九、投资组合报告附注

（一）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（二）基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

（三）报告期末基金其他资产的构成

其他资产	金额（人民币元）
交易保证金	1,460,000.00
应收证券清算款	8,242,523.85
应收利息	28,864.31
应收股利	0.00
应收申购款	104,158.04
合计	9,835,546.20

（四）报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有可转换债券。

（五）本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内未投资本基金。

第八章 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数：

报告期末基金份额持有人户数：	13,233户
报告期末平均每户持有的基金份额：	36,202.57份

二、报告期末基金份额持有人结构：

| 项目 | 数量（份） | 占总