宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 2006年年度报告摘要

基金管理人:宝盈基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

第一节 重要提示

重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年3月27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、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。

第二节 基金简介

(一)基金名称: 宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
基金简称: 宝盈泛沿海
基金代码: 213002
基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日: 2005年3月8日
报告期末基金份额总额: 356,608,933.87份

(二)基金投资

投资目标:通过投资于泛沿海地区有增长潜力的上市公司,有效分享中国经济快速增长的成果,在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。

投资策略:本基金采取"自上而下"进行资产配置和行业及类属资产配置,"自下而上"精选个股的积极投资策略。

在整体资产配置层面,本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区域经济发展政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。

在区域资产配置及行业权重层面,本基金根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重。

在个股选择层面,本基金以PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据,通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。

业绩比较基准:

上证A股指数×80%+上证国债指数×20%

当市场出现合适的全市场统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。

风险收益特征:

本基金属于区域类增长型股票基金,风险介于价值型股票基金与积极成长型股票基金之间,适于能承担一定风险,追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。

(三)基金管理人

法定名称: 宝盈基金管理有限公司
信息披露负责人: 刘传葵
联系电话: 0755-83276688-5698
传真: 0755-83515622
电子邮箱: liuck@byfunds.com

(四)基金托管人

法定名称: 中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人: 蒋松云
联系电话: 010-66106912
传真: 010—66106904
电子邮箱: custody@icbc.com.cn

(五)基金年度报告正文查阅方式

基金管理人互联网网址:http://www.byfunds.com

基金年度报告置备地点:基金管理人、基金托管人处

第三节 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一)主要会计数据和财务指标(截止2006年12月31日)

单位:人民币元

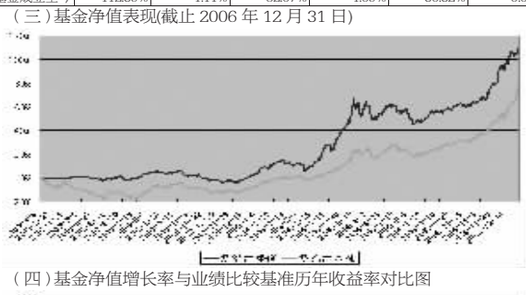
	主要会计数据和财务指标	2006年12月31日	2005年12月31日
1	基金本期净收益	74,675,741.84	1,645,951.97
2	基金份额本期净收益	0.7423	0.0071
3	期末可供分配基金收益	34,289,659.82	-4,444,683.48
4	期末可供分配基金份额收益	0.0962	-0.0226
5	期末基金资产净值	392,335,027.49	196,994,831.47
6	期末基金份额净值	1.1002	1.0024
7	基金加权平均净值收益率	59.34%	0.68%
8	本期基金份额净值增长率	105.78%	3.21%
9	基金份额累计净值增长率	112.39%	3.21%

提示:上述基金业绩指标不包括份额持有人认购或者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。

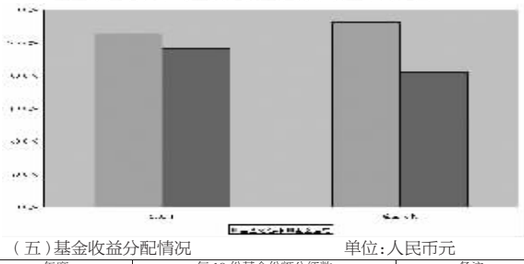
(二)同期业绩比较(截止2006年12月31日)

阶段	净值增长率①	净值增长标准差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3个月	32.67%	1.17%	40.75%	1.10%	-8.08%	0.07%
过去6个月	32.84%	1.11%	46.47%	1.07%	-13.63%	0.04%
过去1年	105.78%	1.40%	96.64%	1.08%	9.14%	0.32%
自基金成立至今	112.39%	1.11%	82.07%	1.09%	30.32%	0.02%

(三)基金净值表现(截止2006年12月31日)



(四)基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



(五)基金收益分配情况 单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	备注
2005年	0.30	本年分红1次
2006年	8.20	本年分红4次
合计	8.50	

第四节 管理人报告

(一)基金管理人及基金经理简介

基金管理人:宝盈基金管理有限公司是2001年按照证监会"新的治理结构、新的内控体系"标准设立的首批基金管理公司之一,2001年5月18日成立,注册资本为人民币1亿元,注册地在深圳。公司目前管理两只封闭式基金(基金鸿飞、基金鸿阳)和两只开放式基金(宝盈鸿利收益证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金),公司恪守价值投资的投资理念,并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队,在研究方面,公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才,为公司的投资决策提供科学的研究支持;在投资方面,公司的基金经理都具有丰富的证券市场投资经验,并有着良好的过往业绩,他们以自己专业知识使基金业绩不断提高,努力为投资者创造丰厚的回报。

基金经理:祝东升先生,上海财经大学经济学硕士,曾在北京证券、联合证券等证券公司从事证券投资业务,12年证券投资管理经历。2004年3月加盟宝盈基金管理有限公司,任总经理助理、基金管理部总监。现为宝盈泛沿海股票证券投资基金基金经理。

(二)本报告期内基金运作的遵规守信情况

在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及各项配套法规、《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。无损害基金持有人利益的行为。基金投资范围、投资比例、投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

(三)本报告期内基金的投资策略和业绩表现

2006年是中国资本市场发展具有重要历史意义的一年,在全球流动性过剩、人民币持续升值和中国宏观经济快速稳健发展的大背景下,A股市场的制度性变革取得了突破性进展,股权分置改革年内基本完成,证券公司综合治理成效显著,价值投资理念日益深入人心,A股市场演绎了一轮汹涌壮阔的大幅上扬行情,上证综合指数稳步攀升,创下近十年新高。宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金自05年3月8日成立以来,基金份额净值增长率为112.39%,业绩比较基准增长率为82.07%,本基金净值增长优于业绩基准。2006年度净值翻番并为基金持有人实现四次分红,累计分红金额为每10份8.5元。

2005年12月A股市场见底回升。我国宏观经济呈现高增长的格局,城镇固定资产投资延续平稳快速增长的势头,国际贸易顺差持续增长,消费稳定增长。伴随国内经济快速增长以及世界主要经济体经济的复苏,能源及资源紧张,石油、贵金属、基本金属、糖等商品价格持续上涨;房价稳中有升;银行信贷投放较快,流动性充足;人民币持续稳定升值且趋势未变。基于对这些基本面的分析,我们集中重点配置了受益于证券市场快速发展的证券公司;受益于商品涨价的资源类公司;受益于人民币升值及需求强劲的房地产等龙头公司;受益于消费升级而持续增长的食品饮料类公司;3G主题下的通信设备制造商和具有持续增长潜力的优质银行股成为我们投资的选择对象;制造业中具有全球核心竞争力的公司、部分景气走出低谷的周期性行业的龙头公司(工程机械、水泥、钢铁、石油化工等)以及国家鼓励重点投资行业的部分上市公司也是我们配置的目标。

(四)2007年的宏观经济和市场前景展望

随着股权分置改革的基本完成,随着制度性变革的不断推进,证券市场已步入健康、快速、有序的发展时期。展望2007年,宏观经济持续发展,中国资本市场将迎来更大的发展空间。投资基金的高速扩容、人民币的持续升值、股指期货等金融衍生品的推出、大型国有企业在A股市场的发行与上市等必将使2007年成为又一个充满机遇与挑战的一年。我们判断中国经济的增长速度、投资、消费等方面都具有内在的高速增长潜力,2007年乃至今后两年将是中国经济新一轮景气周期的扩张期。在中国经济持续稳健快速增长的大背景下,我们继续看好2007年中国股票市场的投资机会,尤其是更多的具有行业代表性的领导型公司陆续在A股市场上市,为投资中国的股票市场提供了良好的机遇。我们继续看好消费升级、自主创新、人民币升值和大股东向股份公司注入资产、收购兼并等因素带来的投资机会。这些机会出现的行业包括金融、食品饮料、商业零售、地产、医药制造、通信、装备制造、高成长性的新兴行业等。我们仍将对持有人的绝对回报放在首位,努力提高经风险调整后的净值增长水平。谢谢持有人对本基金的厚爱和支持。希望继续得到你们一贯的支持和信任。

(五)内部监察稽核报告

本报告期,公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常交易监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作,不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制,并定期出具专项监察报告及合规性报告等,对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作,在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易,也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易,基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范和控制各种风险,充分保障基金持有人的合法权益。

第五节 托管人报告

2006年度,本基金托管人在对宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2006年度,宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

第六节 审计报告

本基金2006年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2007)第20303号"标准无保留意见的审计报告"。

第七节 财务会计报告

(一)基金会计报告书

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
2006年12月31日资产负债表

单位:人民币元

	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产			
银行存款		117,979,694.74	11,298,425.90
结算备付金		630,585.31	1,629,463.23
交易保证金	5	598,780.49	348,780.49
应收利息	6	24,288.40	7,399.51
应收申购款		33,939,171.00	41,442,995.00
股票投资市值		265,478,595.40	144,777,044.76
其中:股票投资成本		240,141,205.48	139,089,067.78
债券投资市值		-	-
其中:债券投资成本		-	-
权证投资		-	-
其中:权证投资成本		-	-
资产总计		418,651,115.34	199,504,108.89
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		23,026,295.48	585,335.85
应付赎回款		1,717,255.67	1,067,106.68
应付赎回费		6,461.80	1,668.95
应付管理人报酬		234,181.87	222,763.84
应付托管费		39,030.30	37,127.32
应付佣金	7	438,362.73	135,743.28
其他应付款	8	500,000.00	250,031.50
预提费用	9	354,500.00	209,500.00
负债合计		26,316,087.85	2,509,277.42
持有人权益			
实收基金	10	356,608,933.87	196,525,507.50
未实现利得	11	1,436,433.80	4,914,007.45
未分配收益		34,289,659.82	-4,444,683.48
持有人权益合计		392,335,027.49	196,994,831.47
(2006年末基金份额净值:1.1002元)			
(2005年末基金份额净值:1.0024元)			
负债及持有人权益总计		418,651,115.34	199,504,108.89

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
2006年度经营业绩表及利润分配表

单位:人民币元

	附注	2006年度	2005年3月8日(基金合同生效日)至2005年12月31日
收入			
股票差价收入	12	71,609,610.24	-3,932,347.85
债券差价收入	13	-	2,682,904.10
权证差价收入	14	3,297,949.60	1,264,761.40
债券利息收入			1,617,572.61
存款利息收入		266,287.32	447,704.01
股利收入		1,651,499.92	2,338,092.90
买入返售证券收入		396.00	369,849.00
其他收入	15	405,561.07	446,200.34
收入合计		77,231,304.15	5,234,736.51
费用			
基金管理人报酬		1,883,192.18	2,804,068.54
基金托管费		313,865.38	467,344.81
卖出回购证券支出		-	87,632.41
其他费用	16	358,504.75	229,738.78
其中:信息披露费		300,000.00	145,000.00 50,000
审计费用		40,000.00	50,000.00
费用合计		2,555,562.31	3,588,784.54
基金净收益		74,675,741.84	1,645,951.97
加:未实现利得	11	19,649,412.94	5,687,976.98
基金经营业绩		94,325,154.78	7,333,928.95
本期基金净收益		74,675,741.84	1,645,951.97
加:期初基金净收益		-4,444,683.48	-
本期申购基金份额的损益平准金		51,589,862.70	-839,547.51
本期赎回基金份额的损益平准金		-33,857,237.26	-172,739.73
可供分配基金净收益		87,963,683.80	633,664.73
减:本期已分配基金净收益	17	53,674,023.98	5,078,348.21
期末基金净收益		34,289,659.82	-4,444,683.48

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
2006年度基金净值变动表

单位:人民币元

	2006年度	2005年3月8日(基金合同生效日)至2005年12月31日
期初基金净值	196,994,831.47	402,050,224.74
本期经营活动		
基金净收益	74,675,741.84	1,645,951.97
未实现利得	19,649,412.94	5,687,976.98
经营活动产生的基金净值变动数	94,325,154.78	7,333,928.95
本期基金份额交易		
基金申购款	498,039,188.96	149,565,839.96
其中:分红再投资	17,291,077.22	639,249.96
基金赎回款	-343,350,123.74	-356,876,813.97
基金份额交易产生的基金净值变动数	154,689,065.22	-207,310,974.01
本期向基金持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-53,674,023.98	-5,078,348.21
期末基金净值	392,335,027.49	196,994,831.47

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二)会计报告书附注

1本基金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的内容和更正金额。

3主要税项

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(股票)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]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a)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。

(b)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。

(c)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,自2005年6月13日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%(此前按100%)计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(d)基金买卖股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4重大关联方关系及关联交易

(a)关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
中国对外经济贸易信托投资有限公司	基金管理人的股东
衡平信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
成都工业投资经营有限责任公司	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。

(b)基金管理人报酬

支付基金管理人宝盈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X 1.5%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬1,883,192.18元(2005年:2,804,068.54元)。

(c)基金托管费

支付基金托管人中国工商银行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X 0.25%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费313,865.38元(2005年:467,344.81元)。

(d)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工商银行保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为117,979,694.74元(2005年:11,298,425.90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256,151.22元(2005年:363,089.74元)。

(e)与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国工商银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

	2006年度	2005年3月8日(基金合同生效日)至2005年12月31日止期间
卖出回购证券协议金额	-	552,860,000.00
卖出回购证券利息支出	-	87,632.41

5流通受限制不能自由转让的基金资产

流通受限制不能自由转让的股票

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
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.10	70,840	350,658.00	573,804.00
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	39,000	736,320.00	736,320.00
合计							1,086,978.00	1,310,124.00

第七节 基金投资组合报告

(一)基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
银行存款和清算备付金	118,610,280.05	28.33
股票	265,478,595.40	63.41
债券	-	-
权证	-	-
其他资产	34,562,239.89	8.26
合计	418,651,115.34	100.00

(二)行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	-	-
2	B 采掘业	4,474,391.40	1.14
3	C 制造业	120,694,751.78	30.76
	C0 食品、饮料	30,370,112.55	7.74
	C1 纺织、服装、皮毛	-	-
	C2 木材、家具	-	-
	C3 造纸、印刷	-	-
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
	C5 电子	-	-
	C6 金属、非金属	56,492,388.40	14.40
	C7 机械、设备、仪表	17,976,988.24	4.58
	C8 医药、生物制品	15,855,262.59	4.04
	C99 其他制造业	-	-
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
5	E 建筑业	-	-
6	F 交通运输、仓储业	573,804.00	0.15
7	G 信息技术业	27,217,119.00	6.94
8	H 批发和零售贸易	-	-
9	I 金融、保险业	68,080,346.00	17.35
10	J 房地产业	21,924,800.00	5.59
11	K 社会服务业	20,027,383.22	5.10
12	L 传播与文化产业	2,486,000.00	0.64
13	M 综合类	-	-
	合计	265,478,595.40	67.67

(三)基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	库存数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	3,199,930	32,639,286.00	8.32
2	000063	中兴通讯	696,090	27,217,119.00	6.94
3	000002	万 科 A	1,420,000	21,924,800.00	5.59
4	000069	华侨城 A	909,922	20,027,383.22	5.10
5	600036	招商银行	1,159,000	18,961,240.00	4.83
6	000039	中集集团	999,793	18,836,100.12	4.80
7	600019	宝钢股份	1,831,500	15,860,790.00	4.04
8	600030	中信证券	575,000	15,743,500.00	4.01
9	600519	贵州茅台	140,000	12,296,200.00	3.13
10	000858	五 粮 液	499,843	11,421,412.55	2.91

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于宝盈基金管理有限公司http://www.byfunds.com网站的年度报告正文。

(四)股票投资组合的重大变动

1、累计买入金额超过期初净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额	占净值比(%)
1	600016	民生银行	38,660,608.73	19.63
2	000063	中兴通讯	33,675,569.14	17.09
3	000039	中集集团	33,169,778.45	16.84
4	000002	万 科 A	30,157,012.85	15.31
5	600028	中国石化	27,839,663.47	14.13
6	600036	招商银行	25,639,247.94	13.02
7	600019	宝钢股份	23,624,528.89	11.99
8	000069	华侨城 A	23,324,921.80	11.84
9	600030	中信证券	21,024,638.11	10.67
10	600519	贵州茅台	16,909,233.40	8.58
11	600050	中国联通	13,503,179.63	6.85
12	600111	稀土高科	13,154,941.59	6.68
13	000858	五 粮 液	12,790,990.21	6.49
14	600005	武钢股份	9,817,847.42	4.98
15	600900	长江电力	9,461,590.05	4.80
16	600495	晋西车轴	9,262,194.75	4.70
17	000625	长安汽车	8,785,004.42	4.46
18	600489	中金黄金	8,170,838.76	4.15
19	000060	中金岭南	8,159,953.32	4.14
20	002082	栋梁新材	7,863,551.73	3.99
21	000538	云南白药	7,523,443.89	3.82
22	600808	马钢股份	7,338,129.10	3.73
23	600970	中材国际	7,129,732.83	3.62
24	600037	歌华有线	7,020,611.47	3.56
25	600276	恒瑞医药	6,982,398.90	3.54
26	600361	华联综超	6,467,172.65	3.28
27	000089	深圳机场	6,394,002.17	3.25
28	600588	用友软件	6,205,914.17	3.15
29	600195	中牧股份	6,014,394.62	3.05
30	000839	中信国安	6,013,873.25	3.05
31	000898	鞍钢股份	5,884,235.97	2.99
32	600832	东方明珠	5,794,818.07	2.94
33	000758	中色股份	5,673,306.75	2.88
34	600418	江淮汽车	5,637,660.14	2.86
35	002008	大族激光	5,445,159.21	2.76
36	000951	中国重汽	5,438,608.93	2.76
37	600309	烟台万华	5,152,976.57	2.62
38	002024	苏宁电器	5,028,077.16	2.55
39	600827	友谊股份	5,009,027.00	2.54
40	000528	柳 工	4,970,391.38	2.52
41	600535	天士力	4,919,715.48	2.50
42	600887	伊利股份	4,860,143.68	2.47
43	601988	中国银行	4,702,792.15	2.39
44	000423	S 阿 胶	4,486,013.78	2.28
45	000709	唐钢股份	4,479,105.34	2.27
46	000983	西山煤电	4,478,683.48	2.27
47	600547	山东黄金	4,435,917.24	2.25
48	000568	泸州老窖	4,402,642.49	2.23
49	600315	上海家化	4,328,631.00	2.20
50	000970	中科三环	4,198,619.41	2.13
51	000869	张 裕 A	4,101,645.33	2.08
52	600790	轻纺城	3,940,764.21	2.00

2、累计卖出金额超过期初净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额	占净值比(%)
1	600028	中国石化	29,615,252.23	15.03
2	600036	招商银行	24,748,970.55	12.56
3	000002	万 科 A	24,291,903.02	12.33
4	000039	中集集团	17,026,279.65	8.64
5	600037	歌华有线	16,482,273.80	8.37
6	000063	中兴通讯	15,969,170.68	8.11
7	000960	锡业股份	13,730,519.35	6.97
8	600900	长江电力	13,463,621.11	6.83
9	600050	中国联通	13,013,015.51	6.61
10	000858	五 粮 液	11,852,478.68	6.02
11	600016	民生银行	11,761,551.74	5.97
12	000060	中金岭南	11,407,380.09	5.79
13	600019	宝钢股份	10,921,258.94	5.54
14	600030	中信证券	10,465,035.16	5.31
15	000069	华侨城 A	10,171,365.91	5.16
16	600489	中金黄金	9,806,044.77	4.98
17	600383	金地集团	9,705,917.28	4.93
18	600361	华联综超	9,595,279.43	4.87
19	600596	新安股份	9,159,205.40	4.65
20	600970	中材国际	8,701,765.24	4.42
21	000088	盐 田 港	8,272,952.08	4.20
22	600808	马钢股份	8,166,476.49	4.15
23	002024	苏宁电器	7,731,270.63	3.92
24	600519	贵州茅台	7,671,617.86	3.89
25	600585	海螺水泥	7,570,845.25	3.84
26	600588	用友软件	7,558,469.40	3.84
27	600887	伊利股份	7,508,619.25	3.81
28	600085	同仁堂	7,245,297.76	3.68
29	600547	山东黄金	7,208,686.84	3.66
30	600827	友谊股份	7,063,339.81	3.59
31	600258	S首旅	6,867,755.93	3.49
32	600308	华泰股份	6,845,904.70	3.48
33	000089	深圳机场	6,516,506.65	3.31
34	600694	大商股份	6,493,523.84	3.30
35	600362	江西铜业	6,193,103.59	3.14
36	000839	中信国安	6,128,735.48	3.11
37	000024	招商地产	5,983,067.31	3.04
38	600331	宏达股份	5,957,417.72	3.02
39	000758	中色股份	5,924,166.40	3.01
40	000898	鞍钢股份	5,823,396.89	2.96
41	600005	武钢股份	5,690,913.14	2.89
42	600418	江淮汽车	5,676,235.61	2.88
43	600584	长电科技	5,675,588.16	2.88
44	002082	栋梁新材	5,674,827.23	2.88
45	002008	大族激光	5,317,866.86	2.70
46	600832	东方明珠	5,284,404.41	2.68
47	000528	柳 工	5,279,017.14	2.68
48	600320	振华港机	5,121,080.32	2.60
49	600309	烟台万华	5,040,706.52	2.56
50	000709	唐钢股份	5,003,236.57	2.54
51	600535	天士力	4,942,777.08	2.51
52	600018	上港集团	4,838,124.83	2.46
53	000568	泸州老窖	4,830,501.53	2.45
54	000970	中科三环	4,811,801.73	2.44
55	601988	中国银行	4,725,100.08	2.40
56	000423	S 阿 胶	4,704,917.47	2.39
57	000625	长安汽车	4,552,329.18	2.31
58	600616	第一食品	4,374,393.33	2.22
59	600296	S兰铝	4,308,583.68	2.19
60	600017	日照港	4,206,685.18	2.14
61	600183	生益科技	4,081,840.54	2.07
62	000538	云南白药	4,068,184.07	2.07
63	000837	秦川发展	3,995,310.82	2.03
64	600195	中牧股份	3,979,887.63	2.02
65	600583	海油工程	3,968,213.75	2.01

3、买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目名称	金额(元)
报告期内买入股票成本总额	735,321,752.37
报告期内卖出股票收入总额	706,362,271.54

(五)按券种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

(六)投资组合报告附注

1、本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;在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中未有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产明细

项目名称	金额(元)
应收利息	24,288.40
应收申购款	33,939,171.00
保证金	598,780.49
合计	34,562,239.89

4、报告期内权证投资明细

(1)本报告期内因股权分置改革被动持有权证明细如下:

序号	权证代码	权证名称	本期增加(股)	成本(元)	本期余额(股)	类别(被动持有/主动投资)
1	031001	侨城HQC1	129,200	--	--	被动持有
2	580990	茅台JCP1	32,000	--	--	被动持有
3	580997	招行CMP1	660,000	--	--	被动持有
4	038003	华菱JTP1	287,682	--	--	被动持有
合计			1,108,882			

(2)本报告期内主动投资权证明细如下:

序号	权证代码	权证名称	本期增加(股)	成本(元)	本期余额(股)	类别(被动持有/主动投资)
1	580001	武钢JTB1	500,000	376,303.58	--	主动投资
2	580003	邯钢JTB1	480,000	561,493.72	--	主动投资
3	030001	鞍钢JTC1	230,000	777,163.62	--	主动投