泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金2007年半年度报告摘要

（上接D96版）

(j)债券差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
债券成交总额	425,603,260.98
债券成本总额	424,776,719.47
应收利息总额	5,315,979.63
债券差价收入	-4,489,438.12

(k)其他收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
新股申购手续费返还	
国债兑付手续费返还	
赎回基金补偿收入	1,853,911.72
合计	1,853,911.72

(l)其它费用

	2007年1月1日至2007年6月30日
审计师费	24,795.19
信息披露费	49,586.76
回购交易费用	646.90
银行手续费	37,496.32
银行间服务费	13,090.00
外汇交易中心交易手续费	1,854.95
其它	
合计	127,470.12

(m)收益分配

登记日	分红率	现金形式发放	再投资形式发放	发放红利合计
2007-1-5	每10份基金份额12.20元	97,382,248.38	70,703,220.02	168,085,468.40
2007-2-8	每10份基金份额0.30元	30,927,491.14	13,990,495.58	44,917,986.72
2007-3-13	每10份基金份额0.90元	79,691,674.94	42,535,413.68	122,227,088.62

（n）报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价对报告期内股票投资成本等项目的累计影响金额。

本基金于本会计期间未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

5、 本报告期流通转让受限制的基金资产

本基金截至2006年6月30日止流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	数量	股票成本	股票市值	流通日期
600761	安徽合力	500,000	5,300,000.00	14,250,000.00	2007-7-5

六、投资组合报告

合丰成长基金

（一）报告期末基金资产组合（单位:元）

项目	金额	占基金总资产比例
股票	844,977,259.53	63.50%
债券	261,004,346.03	19.61%
银行存款和清算备付金	175,125,140.92	13.16%
权证	1,911,360.75	0.14%
其它资产	47,697,155.07	3.58%
合计	1,330,715,262.30	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合（单位:元）

行业分类	市值	占基金净值比例
A 农、林、牧、渔业	26,795,343.50	2.19%
B 采掘业	31,049,019.57	2.53%
C 制造业	459,335,779.36	37.48%
C0 食品、饮料	10,558,521.60	0.86%
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	46,932,109.50	3.83%
C5 电子	49,874,967.24	4.07%
C6 金属、非金属	8,542,000.00	0.70%
C7 机械、设备、仪表	253,471,815.32	20.68%
C8 医药、生物制品	45,661,589.70	3.73%
C99 其他制造业	44,294,776.00	3.61%
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	58,124,124.54	4.74%
G 信息技术业	56,616,503.49	4.62%
H 批发和零售贸易	74,599,001.12	6.09%
I 金融、保险业	52,970,000.00	4.32%
J 房地产业	14,758,343.31	1.20%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	70,729,144.64	5.77%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	844,977,259.53	68.94%

本基金投资成长类行业股票市值合计占投资股票总市值的80.30%。

（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（单位:元）

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占基金净值
600037	歌华有线	2,701,648	70,729,144.64	5.77%
600717	天津港	2,309,262	58,124,124.54	4.74%
600183	生益科技	4,500,000	55,215,000.00	4.51%
600030	中信证券	1,000,000	52,970,000.00	4.32%
000063	中兴通讯	921,852	50,148,748.80	4.09%
600089	特变电工	1,569,405	48,259,203.75	3.94%
600206	有研硅股	1,261,600	44,294,776.00	3.61%
600143	金发科技	1,049,925	40,464,109.50	3.30%
000410	沈阳机床	1,679,191	40,300,584.00	3.29%
002024	苏宁电器	800,000	37,568,000.00	3.07%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入占期初基金资产净值2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
002025	航天电器	147,303,100.13	23.29%
000063	中兴通讯	122,714,602.93	19.41%
600037	歌华有线	98,499,264.11	15.58%
600005	武钢股份	84,456,641.23	13.36%
600261	浙江阳光	79,242,431.23	12.53%
600030	中信证券	78,547,481.28	12.42%
000410	沈阳机床	77,334,537.02	12.23%
600183	生益科技	76,633,312.08	12.12%
002106	莱宝高科	67,991,600.69	10.75%
600717	天津港	65,183,426.53	10.31%
600206	有研硅股	61,772,470.31	9.77%
600143	金发科技	58,622,722.57	9.27%
600570	恒生电子	57,914,152.00	9.16%
000039	中集集团	57,858,338.77	9.15%
600089	特变电工	56,765,512.11	8.98%
000898	鞍钢股份	55,727,199.97	8.81%
000002	万 科 A	53,289,802.68	8.43%
600511	国药股份	53,007,137.70	8.38%
600161	天坛生物	52,144,624.20	8.25%
600529	山东药玻	47,637,942.45	7.53%
000157	中联重科	45,004,569.58	7.12%
002070	众和股份	44,793,977.93	7.08%
600016	民生银行	44,296,876.54	7.01%
000983	西山煤电	38,547,993.19	6.10%
600332	广州药业	36,301,255.02	5.74%
002024	苏宁电器	36,237,471.23	5.73%
002022	科华生物	34,241,315.74	5.41%
000400	许继电气	31,609,181.18	5.00%
000829	天音控股	31,131,191.70	4.92%
601628	中国人寿	30,495,373.54	4.82%
600096	云天化	30,017,327.07	4.75%
002093	国脉科技	29,992,758.80	4.74%
600832	东方明珠	29,420,638.79	4.65%
600406	国电南瑞	29,406,455.36	4.65%
002028	思源电气	29,250,562.39	4.63%
600718	东软股份	28,987,459.35	4.58%
600150	沪东重机	28,588,631.46	4.52%
002056	横店东磁	27,742,888.97	4.39%
600036	招商银行	24,572,976.03	3.89%
600050	中国联通	23,962,324.13	3.79%
600675	中华企业	23,850,242.71	3.77%
600201	金宇集团	22,095,862.02	3.49%
600299	星新材料	21,760,390.11	3.44%
002052	同洲电子	20,947,717.11	3.31%
600111	稀土高科	20,781,503.23	3.29%
601988	中国银行	20,178,272.14	3.19%
600685	广船国际	19,905,498.31	3.15%
600269	赣粤高速	19,290,754.02	3.05%
601006	大秦铁路	19,149,345.34	3.03%
002065	东华合创	18,040,584.32	2.85%
002104	恒宝股份	17,608,370.31	2.78%
000933	神火股份	17,485,443.50	2.77%
600476	湘邮科技	16,829,363.14	2.66%
600642	申能股份	16,469,004.00	2.60%
600436	片仔癀	16,119,060.91	2.55%
600309	烟台万华	15,845,093.85	2.51%
600004	白云机场	15,619,909.40	2.47%
600360	华微电子	15,474,503.59	2.45%
600396	金山股份	15,262,519.46	2.41%
000768	西飞国际	14,907,687.87	2.36%
600320	振华港机	14,621,764.70	2.31%
600219	南山铝业	14,445,733.08	2.28%
600410	华胜天成	14,378,511.08	2.27%
600428	中远航运	14,236,294.89	2.25%
000527	美的电器	14,131,758.05	2.23%
600584	长电科技	13,482,299.06	2.13%
600195	中牧股份	13,403,469.69	2.12%
000623	吉林敖东	13,271,893.76	2.10%
600000	浦发银行	12,620,565.26	2.00%

2、报告期内累计卖出占期初基金资产净值2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计买出金额	占期初净值比例
002025	航天电器	176,119,900.36	27.85%
000063	中兴通讯	140,000,631.83	22.14%
600037	歌华有线	127,088,159.97	20.10%
600206	有研硅股	114,254,078.68	18.07%
600005	武钢股份	89,824,395.93	14.20%
600261	浙江阳光	86,806,515.42	13.73%
600570	恒生电子	79,066,549.40	12.50%
000157	中联重科	78,969,280.73	12.49%
000898	鞍钢股份	73,843,549.84	11.68%
000768	西飞国际	73,044,688.82	11.55%
002028	思源电气	63,452,402.60	10.03%
600529	山东药玻	61,548,316.13	9.73%
000829	天音控股	59,028,717.75	9.33%
000410	沈阳机床	58,711,927.95	9.28%
600299	星新材料	57,452,002.33	9.09%
600511	国药股份	56,857,139.09	8.99%
000039	中集集团	55,062,824.56	8.71%
000002	万 科 A	51,386,574.27	8.13%
002093	国脉科技	51,242,809.31	8.10%
600030	中信证券	50,772,988.19	8.03%
600161	天坛生物	49,353,311.48	7.80%
002070	众和股份	47,051,744.90	7.44%
002106	莱宝高科	45,977,307.32	7.27%
600016	民生银行	43,929,559.47	6.95%
600332	广州药业	43,157,478.71	6.82%
600089	特变电工	39,169,549.21	6.19%
600718	东软股份	38,939,423.29	6.16%
000623	吉林敖东	35,073,213.10	5.55%
600096	云天化	34,127,611.28	5.40%
600143	金发科技	32,277,368.88	5.10%
002052	同洲电子	31,628,226.92	5.00%
600410	华胜天成	29,474,391.21	4.66%
600476	湘邮科技	28,963,547.18	4.58%
600797	浙大网新	28,788,274.12	4.55%
601006	大秦铁路	28,306,637.23	4.48%
601628	中国人寿	28,132,858.51	4.45%
002065	东华合创	27,516,906.28	4.35%
600406	国电南瑞	27,080,024.58	4.28%
002056	横店东磁	26,194,718.77	4.14%
600036	招商银行	25,807,062.22	4.08%
600271	航天信息	24,965,938.31	3.95%
600050	中国联通	24,729,025.81	3.91%
002007	华兰生物	23,856,812.64	3.77%
000933	神火股份	22,543,555.27	3.57%
600396	金山股份	22,326,726.04	3.53%
601988	中国银行	21,649,067.87	3.42%
002104	恒宝股份	21,559,193.67	3.41%
002022	科华生物	21,487,036.33	3.40%
600832	东方明珠	21,293,574.42	3.37%
600111	稀土高科	20,130,301.30	3.18%
600685	广船国际	19,423,365.91	3.07%
600031	三一重工	19,164,785.92	3.03%
600269	赣粤高速	18,974,439.97	3.00%
600675	中华企业	18,491,679.61	2.92%
600004	白云机场	18,282,074.40	2.89%
600717	天津港	18,041,237.25	2.85%
600642	申能股份	18,033,626.29	2.85%
600309	烟台万华	17,554,521.58	2.78%
600436	片仔癀	17,050,698.27	2.70%
600312	平高电气	16,528,180.58	2.61%
600585	海螺水泥	16,182,719.31	2.56%
000400	许继电气	15,480,932.16	2.45%
600360	华微电子	15,212,519.98	2.41%
600428	中远航运	15,196,815.02	2.40%
600320	振华港机	14,961,550.88	2.37%
600584	长电科技	14,724,390.01	2.33%
000069	华侨城 A	14,597,240.12	2.31%
600219	南山铝业	14,131,710.83	2.23%
600485	中创信测	13,958,173.57	2.21%
600000	浦发银行	13,544,870.76	2.14%
600867	通化东宝	12,816,308.73	2.03%
000983	西山煤电	12,711,703.09	2.01%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内买入股票成本总额	2,802,765,140.20
报告期内卖出股票收入总额	3,068,781,252.21

（五）报告期末按券种分类的债券投资组合（单位:元）

债券类别	债券市值	市值占净值比例
国家债券投资	129,854,460.00	10.59%
央行票据投资	21,351,886.03	1.74%
企业债券投资		
金融债券投资	109,798,000.00	8.96%
可转换债投资		
合计	261,004,346.03	21.29%

（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投资明细（单位:元）

债券名称	市 值	市值占净值比例
05国债14	79,836,960.00	6.51%
06国开31	50,025,000.00	4.08%
07农发01	49,975,000.00	4.08%
07央票15	21,351,886.03	1.74%
21国债(05)	16,562,700.00	1.35%

（七）报告期末基金持有的权证投资明细（单位:元）

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
580013	武钢CWB1	315,250	730,521.15	1,911,360.75

（八）投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的股票库。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站上的半年度报告正文。

3、其他资产

项目	金额
交易保证金	2,447,747.77
应收证券清算款	41,228,512.64
应收股利	
应收利息	3,330,920.92
应收申购款	689,973.74
其他应收款	
买入返售证券	
待摊费用	

4、基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内基金未主动投资权证，报告期内因投资认股权和债券分离交易的可转换公司债所附认股权证信息如下：

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
580013	武钢CWB1	315,250	730,521.15	1,911,360.75
580012	云化CWB1	70,200	415,392.56	0.00

6、报告期末基金未持有资产支持证券。

合丰周期基金

（一）报告期末基金资产组合（单位:元）

项目	金额	占基金总资产比例
股票	712,748,002.62	61.41%
债券	217,892,835.79	18.77%
银行存款和清算备付金	183,229,544.98	15.79%
权证	0.00	0.00%
其它资产	46,721,005.96	4.03%
合计	1,160,591,389.35	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合（单位:元）

行业	市值	占基金净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	39,520,927.26	3.75%
C 制造业	553,124,545.36	52.44%
C0 食品、饮料	0.00	0.00%
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	143,963,940.89	13.65%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	24,374,496.72	2.31%
C7 机械、设备、仪表	314,566,107.75	29.82%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	70,220,000.00	6.66%
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	24,475,000.00	2.32%
G 信息技术业	19,040,000.00	1.80%
H 批发和零售贸易	0.00	0.00%
I 金融、保险业	23,402,530.00	2.22%
J 房地产业	53,185,000.00	5.04%
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	712,748,002.62	67.56%

本基金投资周期类行业股票市值合计占投资股票总市值的90.61%。

（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（单位:元）

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占基金净值
600143	金发科技	2,108,281	81,253,149.74	7.70%
600206	有研硅股	2,000,000	70,220,000.00	6.66%
600582	天地科技	955,121	56,972,967.65	5.40%
000792	盐湖钾肥	1,250,000	55,475,000.00	5.26%
000651	格力电器	1,557,529	54,357,762.10	5.15%
002097	山河智能	767,833	54,055,443.20	5.12%
000157	中联重科	1,400,000	53,900,000.00	5.11%
000983	西山煤电	1,399,962	39,520,927.26	3.75%
000410	沈阳机床	1,600,000	38,400,000.00	3.64%
600675	中华企业	1,500,000	34,065,000.00	3.23%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入占期初基金资产净值2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
000002	万 科 A	205,473,136.79	81.30%
600028	中国石化	182,180,541.84	72.08%
000792	盐湖钾肥	162,873,554.06	64.44%
600030	中信证券	159,665,409.83	63.17%
600583	海油工程	143,848,853.30	56.91%
600143	金发科技	143,183,402.28	56.65%
000039	中集集团	130,897,496.54	51.79%
000157	中联重科	114,651,082.76	45.36%
600019	宝钢股份	109,107,680.25	43.17%
000410	沈阳机床	103,863,922.57	41.09%
600000	浦发银行	93,439,285.91	36.97%
000898	鞍钢股份	92,997,308.87	36.79%
000825	太钢不锈	85,874,681.44	33.98%
600005	武钢股份	84,830,183.83	33.56%
600320	振华港机	82,410,393.33	32.61%
600206	有研硅股	77,367,855.63	30.61%
600299	星新材料	73,159,598.29	28.95%
600685	广船国际	72,571,469.33	28.71%
600383	金地集团	62,338,100.38	24.66%
600690	青岛海尔	62,268,400.82	24.64%
002037	久联发展	58,187,244.87	23.02%
600582	天地科技	56,502,257.56	22.36%
600009	上海机场	55,279,183.70	21.87%
600048	保利地产	54,730,057.42	21.65%
600585	海螺水泥	53,758,510.08	21.27%
600519	贵州茅台	53,682,923.78	21.24%
600675	中华企业	52,247,717.21	20.67%
002097	山河智能	51,870,020.32	20.52%
000063	中兴通讯	51,004,266.79	20.18%
000625	长安汽车	49,235,396.59	19.48%
000651	格力电器	46,118,256.22	18.25%
000024	招商地产	44,544,350.04	17.62%
600428	中远航运	43,901,617.05	17.37%
000528	柳 工	43,039,827.22	17.03%
000983	西山煤电	42,264,426.39	16.72%
600467	好当家	40,874,101.03	16.17%
600456	宝钛股份	40,594,685.79	16.06%
000402	金 融 街	37,718,476.43	14.92%
601111	中国国航	36,821,096.30	14.57%
000966	长源电力	35,699,341.28	14.12%
600123	兰花科创	35,117,675.79	13.89%
002122	天马股份	34,382,377.90	13.60%
600036	招商银行	33,501,955.36	13.26%
600067	冠城大通	31,349,313.28	12.40%
600150	沪东重机	29,557,360.83	11.69%
000807	云铝股份	27,528,850.89	10.89%
600660	福耀玻璃	26,592,490.26	10.52%
000821	京山轻机	26,250,726.86	10.39%
600037	歌华有线	25,923,725.14	10.26%
601166	兴业银行	25,795,046.49	10.21%
600331	宏达股份	25,722,237.18	10.18%
600096	云天化	25,609,324.23	10.13%
600717	天津港	23,439,752.51	9.27%
600547	山东黄金	23,214,429.55	9.18%
600489	中金黄金	22,749,213.77	9.00%
600472	包头铝业	22,455,430.27	8.88%
601001	大同煤业	22,009,001.10	8.71%
600495	晋西车轴	20,158,735.21	7.98%
601666	平煤天安	20,096,498.41	7.95%
600352	浙江龙盛	19,392,644.65	7.67%
600104	上海汽车	19,023,340.42	7.53%
601628	中国人寿	18,656,869.83	7.38%
600750	江中药业	17,810,414.52	7.05%
600010	包钢股份	17,648,979.58	6.98%
600022	济南钢铁	17,220,205.39	6.81%
000878	云南铜业	15,841,072.57	6.27%
601318	中国平安	15,374,254.72	6.08%
000612	焦作万方	14,899,646.33	5.90%
600761	安徽合力	14,047,370.94	5.56%
000709	唐钢股份	13,988,830.50	5.53%
600997	开滦股份	13,905,853.65	5.50%
600879	火箭股份	13,679,674.63	5.41%
000060	中金岭南	12,966,652.77	5.13%
600780	通宝能源	12,243,067.51	4.84%
601006	大秦铁路	12,209,018.50	4.83%
000338	潍柴动力	12,064,888.12	4.77%
600529	山东药玻	11,927,128.16	4.72%
000069	华侨城 A	10,753,637.42	4.25%
000419	通程控股	10,520,831.62	4.16%
000401	冀东水泥	10,489,361.39	4.15%
600309	烟台万华	10,383,548.01	4.11%
000560	昆百大 A	6,904,927.72	2.73%
600015	华夏银行	6,551,953.29	2.59%
600386	*ST北巴	6,382,655.88	2.53%
600509	天富热电	6,016,809.94	2.38%
600991	长丰汽车	5,923,307.68	2.34%

2、报告期内累计卖出占期初基金资产净值2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比例
000002	万 科 A	214,305,440.05	84.79%
600030	中信证券	186,356,483.47	73.73%
600028	中国石化	176,298,600.78	69.75%
600583	海油工程	157,879,775.83	62.47%
600143	金发科技	135,860,311.55	53.75%
000039	中集集团	134,516,832.50	53.22%
000825	太钢不锈	131,103,047.43	51.87%
000157	中联重科	122,886,933.62	48.62%
000005	武钢股份	119,839,925.85	47.42%
000792	盐湖钾肥	115,671,693.96	45.77%
600685	广船国际	115,348,585.53	45.64%
600019	宝钢股份	99,298,399.23	39.29%
600299	星新材料	96,914,130.44	38.34%
000898	鞍钢股份	96,099,088.51	38.02%
000410	沈阳机床	88,562,272.70	35.04%
600320	振华港机	86,901,256.88	34.38%
600000	浦发银行	86,874,504.90	34.37%
600585	海螺水泥	68,677,127.58	27.17%
600383	金地集团	65,457,262.58	25.90%
600690	青岛海尔	64,831,161.44	25.65%
600519	贵州茅台	57,359,554.70	22.69%
600009	上海机场	55,677,254.93	22.03%
600048	保利地产	55,383,693.88	21.91%
002037	久联发展	54,436,478.50	21.54%
600206	有研硅股	53,229,290.03	21.06%
000528	柳 工	50,186,418.84	19.86%
000625	长安汽车	45,769,083.21	18.11%
600428	中远航运	43,394,104.88	17.17%
000024	招商地产	43,161,119.05	17.08%
600456	宝钛股份	41,638,989.68	16.47%
600675	中华企业	41,438,982.68	16.40%
600467	好当家	39,429,356.04	15.60%
000063	中兴通讯	38,831,567.53	15.36%
000966	长源电力	36,770,294.42	14.55%
002122	天马股份	35,573,564.17	14.07%
000402	金 融 街	33,641,723.23	13.31%
600123	兰花科创	33,113,880.36	13.10%
600036	招商银行	31,720,265.02	12.55%
600489	中金黄金	29,731,442.06	11.76%
600750	江中药业	27,972,405.25	11.07%
000821	京山轻机	27,796,295.43	11.00%
601166	兴业银行	26,835,701.36	10.62%
000807	云铝股份	26,765,266.65	10.59%
600331	宏达股份	26,530,525.34	10.50%
600660	福耀玻璃	26,319,284.65	10.41%
600096	云天化	26,282,913.37	10.40%
600717	天津港	25,871,798.12	10.24%
601001	大同煤业	25,650,947.64	10.15%
600037	歌华有线	24,373,209.42	9.64%
600997	开滦股份	23,390,718.14	9.25%
600472	包头铝业	22,389,134.33	8.86%
601666	平煤天安	21,870,971.78	8.65%
600547	山东黄金	21,111,541.20	8.35%
600352	浙江龙盛	20,356,272.11	8.05%
600495	晋西车轴	19,936,162.35	7.89%
600022	济南钢铁	19,666,076.20	7.78%
600104	上海汽车	19,143,842.02	7.57%
000612	焦作万方	18,522,145.93	7.33%
601628	中国人寿	17,489,316.35	6.92%
000338	潍柴动力	17,142,933.76	6.78%
601318	中国平安	16,778,506.19	6.64%
000401	冀东水泥	16,721,528.44	6.62%
600067	冠城大通	14,737,091.90	5.83%
000709	唐钢股份	14,538,106.13	5.75%
600761	安徽合力	14,266,141.67	5.64%
600780	通宝能源	14,160,350.20	5.60%
601006	大秦铁路	13,356,641.60	5.28%
600879	火箭股份	12,918,208.71	5.11%
000060	中金岭南	12,815,453.21	5.07%
600529	山东药玻	12,605,194.77	4.99%
600875	东方电机	12,274,713.64	4.86%
600309	烟台万华	11,970,861.82	4.74%
601111	中国国航	11,503,990.13	4.55%
600582	天地科技	11,257,044.66	4.45%
601398	工商银行	10,981,355.72	4.34%
600031	三一重工	10,491,249.89	4.15%
000419	通程控股	10,020,984.15	3.96%
000069	华侨城 A	9,942,617.31	3.93%
000878	云南铜业	9,394,875.34	3.72%
600887	伊利股份	9,391,659.59	3.72%
600150	沪东重机	9,247,629.83	3.66%
600386	*ST北巴	8,811,903.99	3.49%
000983	西山煤电	7,707,467.91	3.05%
600509	天富热电	7,077,131.34	2.80%
000616	亿城股份	7,038,213.65	2.78%
600991	长丰汽车	6,108,614.69	2.42%
600015	华夏银行	5,977,859.34	2.37%
601333	广深铁路	5,772,274.77	2.28%
000560	昆百大 A	5,195,743.30	2.06%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内买入股票成本总额	4,043,107,805.05
报告期内卖出股票收入总额	3,986,648,422.33

（五）报告期末按券种分类的债券投资组合（单位:元）

债券类别	债券市值	市值占净值比例
国家债券投资	88,558,658.80	8.39%
央行票据投资	69,302,836.99	6.57%
企业债券投资		
金融债券投资	60,031,340.00	5.69%
可转换债投资		
合计	217,892,835.79	20.65%

（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投资明细（单位:元）

债券名称	市 值	市值占净值比例
07农发01	49,975,000.00	4.74%
07央票55	29,796,000.00	2.82%
02国债(00)	26,514,000.00	2.51%
03国债02	20,080,000.00	1.90%
05国债14	19,959,240.00	1.89%

（七）报告期末基金持有的权证投资明细（单位:元）

本基金本报告期末无权证投资。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的股票库。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站上的半年度报告正文。

3、其他资产

项目	金额
交易保证金	2,787,464.08
应收证券清算款	39,946,716.85
应收股利	441,000
应收利息	2,468,061.95
应收申购款	1,077,763.08
其他应收款	
买入返售证券	
待摊费用	

4、基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内基金未主动投资权证，也未在报告期末被动持有权证。报告期内因投资认股权和债券分离交易的可转换公司债所附认股权证信息如下：

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
580013	武钢CWB1	1,374,781	3,