兴业可转债混合型证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接224版）

七、投资组合报告

（一）本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
1	股票	710,734,312.54	24.59%
2	债券	1,442,120,992.44	49.89%
3	权证	16,196,172.79	0.56%
4	银行存款及清算备付金	685,676,998.80	23.72%
5	其他资产	36,144,304.10	1.25%
6	资产合计	2,890,872,780.67	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	153,672,411.60	5.63%
C	制造业	314,963,877.26	11.54%
C0	其中：食品、饮料	95,532,400.00	3.50%
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	106,181,900.71	3.89%
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	21,023,168.00	0.77%
C7	机械、设备、仪表	92,226,408.55	3.38%
C8	医药、生物制品	—	—
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	—	—
H	批发和零售贸易	66,074,023.68	2.42%
I	金融、保险业	129,414,000.00	4.74%
J	房地产业	39,440,000.00	1.44%
K	社会服务业	7,170,000.00	0.26%
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合 计	710,734,312.54	26.03%

（三）报告期末按市值占基金资产净值前十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	600123	兰花科创	2,014,140	94,543,731.60	3.4624%
2	000895	双汇发展	1,600,000	94,384,000.00	3.4565%
3	600036	招商银行	1,800,000	71,334,000.00	2.6124%
4	600000	浦发银行	1,100,000	58,080,000.00	2.1270%
5	600686	金龙汽车	2,500,000	56,725,000.00	2.0774%
6	000061	农 产 品	1,889,336	54,564,023.68	1.9982%
7	600309	烟台万华	1,300,000	49,465,000.00	1.8115%
8	600748	上实发展	850,000	39,440,000.00	1.4444%
9	600096	云 天 化	795,477	39,161,332.71	1.4342%
10	601857	中国石油	1,045,500	32,368,680.00	1.1854%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于兴业基金管理有限公司网站的年度报告正文。

（四）本报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
1	000959	首钢股份	645,820,679.44	39.66%
2	000717	韶钢松山	351,659,549.02	21.59%
3	600317	营 口 港	202,881,061.57	12.46%
4	600021	上海电力	187,570,672.00	11.52%
5	600795	国电电力	168,753,072.00	10.36%
6	000024	招商地产	145,816,882.89	8.95%
7	000488	晨鸣纸业	133,755,289.08	8.21%
8	600036	招商银行	133,427,868.28	8.19%
9	000822	山东海化	125,956,959.37	7.73%
10	600748	上实发展	120,570,834.33	7.40%
11	600398	凯诺科技	95,682,087.80	5.88%
12	600325	华发股份	89,343,748.28	5.49%
13	600000	浦发银行	69,853,166.18	4.29%
14	600117	西宁特钢	58,902,686.48	3.62%
15	600874	创业环保	55,639,496.10	3.42%
16	600900	长江电力	52,417,339.96	3.22%
17	600236	桂冠电力	49,501,788.77	3.04%
18	600348	国阳新能	48,536,628.94	2.98%
19	000061	农 产 品	42,236,865.30	2.59%
20	000910	大亚科技	35,619,380.54	2.19%
21	600282	南钢股份	34,295,193.44	2.11%
22	600488	天药股份	33,640,749.34	2.07%
23	600096	云 天 化	33,628,248.60	2.07%
24	600590	泰豪科技	32,941,093.96	2.02%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
1	000959	首钢股份	717,329,516.74	44.05%
2	000717	韶钢松山	349,585,174.11	21.47%
3	000024	招商地产	267,109,275.12	16.40%
4	600036	招商银行	257,125,617.19	15.79%
5	600317	营 口 港	242,538,135.78	14.89%
6	000822	山东海化	231,749,272.27	14.23%
7	600795	国电电力	224,687,080.74	13.80%
8	000488	晨鸣纸业	202,288,673.06	12.42%
9	600021	上海电力	187,924,568.94	11.54%
10	600325	华发股份	133,251,961.42	8.18%
11	600117	西宁特钢	126,709,643.04	7.78%
12	600748	上实发展	101,592,807.51	6.24%
13	600398	凯诺科技	94,017,141.56	5.77%
14	600219	南山铝业	78,332,243.73	4.81%
15	600000	浦发银行	73,671,153.12	4.52%
16	600675	中华企业	63,956,304.04	3.93%
17	600900	长江电力	54,585,030.08	3.35%
18	600874	创业环保	54,564,929.42	3.35%
19	600348	国阳新能	53,827,637.70	3.31%
20	600488	天药股份	51,668,196.44	3.17%
21	600309	烟台万华	48,655,901.88	2.99%
22	600500	中化国际	48,646,913.29	2.99%
23	600686	金龙汽车	47,294,092.48	2.90%
24	600236	桂冠电力	42,914,705.86	2.64%
25	601919	中国远洋	41,795,001.00	2.57%
26	000910	大亚科技	40,264,024.57	2.47%
27	600196	复星医药	39,280,935.93	2.41%
28	600123	兰花科创	37,100,017.66	2.28%
29	000895	双汇发展	35,528,243.51	2.18%
30	600282	南钢股份	35,516,171.57	2.18%
31	600590	泰豪科技	34,191,998.70	2.10%
32	600320	振华港机	33,536,229.48	2.06%
33	600406	国电南瑞	32,926,009.57	2.02%

3、报告期内买入股票的成本总额为3,650,244,338.58元，卖出股票的收入总额为4,838,841,579.90元。

（五）报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
可转债	1,181,341,784.84	43.26%
可分离可转债	66,799,207.60	2.45%
央行票据	193,980,000.00	7.10%
债券投资合计	1,442,120,992.44	52.81%

（六）报告期末债券明细

1、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

序号	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	中海转债	325,058,621.30	11.90%
2	桂冠转债	196,296,550.00	7.19%
3	唐钢转债	194,531,940.59	7.12%
4	07央行票据31	193,980,000.00	7.10%
5	锡业转债	142,088,400.00	5.20%

2、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名可转换债券明细

序号	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	中海转债	325,058,621.30	11.90%
2	桂冠转债	196,296,550.00	7.19%
3	唐钢转债	194,531,940.59	7.12%
4	锡业转债	142,088,400.00	5.20%
5	山鹰转债	62,399,199.80	2.29%
6	金鹰转债	48,393,099.30	1.77%
7	澄星转债	43,978,955.50	1.61%
8	巨轮转债	41,705,963.40	1.53%
9	恒源转债	40,150,518.40	1.47%
10	大荒转债	35,626,681.20	1.30%

（七）投资组合报告附注

1、本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

3、报告项目的计价方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日的市场收市价计算，已发行未上市股票采用成本价计算。

4、本报告期末基金的其他资产构成

序号	项目	金额
1	存出保证金	1,098,780.49
2	应收证券清算款	26,346,137.49
3	应收利息	8,699,386.12
	合 计	36,144,304.10

5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	100236	桂冠转债	196,296,550.00	7.19%
2	110036	招行转债	20,188,329.90	0.74%
3	110232	金鹰转债	48,393,099.30	1.77%
4	125822	海化转债	30,923,525.45	1.13%
5	128031	巨轮转债	41,705,963.40	1.53%
6	110078	澄星转债	43,978,955.50	1.61%
7	125960	锡业转债	142,088,400.00	5.20%

6、本报告期内获得权证的数量明细

权证代码	权证名称	本期获得数量（份）	本期获得成本（元）	期末市值（元）	期末市值占净值比例
主动投资					
580012	云化CWB1	149,094	882,233.93	4,937,695.09	0.18%
580013	武钢CWB1	719,740	1,667,421.66	5,686,665.74	0.21%
580014	深高CWB1	156,816	519,557.08	1,146,481.78	0.04%
031005	国安GAC1	377,266	1,963,370.33	4,425,330.18	0.16%
030002	五粮YGC1	300,000	5,845,571.08	—	—
580007	长电CWB1	3,300,000	25,873,539.43	—	—

7、本报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的资产支持证券明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

八、基金份额持有人户数、持有人结构

基金持有人户数	户均持有的份额	基金持有人份额结构			
		机构投资者持有份额	占总份额比例	个人投资者持有份额	占总份额比例
29,158	62,896.83	501,555,444.17	27.35%	1,332,390,223.77	72.65%

期末本基金管理公司从业人员持有本开放式基金情况

项 目	期末持有本开放式基金份额的总量（份）	占本基金总份额的比例（%）
本基金管理公司持有本基金的所有从业人员	9,267.5	0.0001%

九、开放式基金份额变动

序号	项目	份额（份）
1	期初基金份额总额	1,321,519,925.17
2	期间基金总申购份额	2,013,114,356.15
3	期间基金总赎回份额	1,500,688,613.38
4	期末基金份额总额	1,833,945,667.94

十、重大事件揭示

1、报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

2、报告期内本基金的管理人、托管人重大人事变动。

（1）报告期内本基金管理人无重大人事变动。

（2）报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

3、报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

4、报告期内本基金投资策略未发生改变。

5、报告期内本基金收益分配事项。

序号	项目	权益登记日、除息日	每10份基金份额收益分配金额(元)	信息披露媒体
1	本基金第17次分红	2007年1月11日	0.37元	中国证券报、上海证券报和本基金管理人网站
2	本基金第18次分红	2007年1月24日	0.32元	
3	本基金第19次分红	2007年2月1日	0.55元	
4	本基金第20次分红	2007年2月13日	0.39元	
5	本基金第21次分红	2007年3月12日	0.36元	
6	本基金第22次分红	2007年4月3日	0.36元	
7	本基金第23次分红	2007年4月25日	0.53元	
8	本基金第24次分红	2007年5月28日	1.10元	
9	本基金第25次分红	2007年6月5日	0.52元	
10	本基金第26次分红	2007年7月2日	0.63元	
11	本基金第27次分红	2007年8月6日	0.71元	
12	本基金第28次分红	2007年9月12日	0.94元	
13	本基金第29次分红	2007年10月17日	0.95元	
14	本基金第30次分红	2007年12月26日	0.63元	

6、本基金自合同生效日起聘请安永大华会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度支付给所聘任的会计师事务所9万元人民币。

7、报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

8、本报告期内，本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》刊登的其他重要临时公告：

序号	事项名称	披露日期
1	关于兴业可转债基金投资兰花科创（600123）非公开发行股票的公告	2007-1-5
2	关于通过中信建投证券网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	2007-2-12
3	关于旗下部分基金基金经理变更的公告	2007-3-2
4	关于取消西北证券的兴业可转债混合型证券投资基金销售代理业务的公告	2007-3-6
5	关于开通全国统一客户服务电话的公告	2007-3-19
6	关于旗下基金开通网上交易业务的公告	2007-4-20
7	关于通过广发证券网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	2007-5-9
8	关于修改兴业可转债混合型基金和兴业全球视野股票型基金基金合同部分条款的公告	2007-5-15
9	关于“外扣法”在旗下基金转换业务中适用的补充公告	2007-5-19
10	关于修改兴业可转债混合型证券投资基金招募说明书收益分配相关内容的公告	2007-5-25
11	关于变更客户服务电话号码的公告	2007-5-31
12	关于兴业可转债混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	2007-6-13
13	关于通过工商银行个人网银申购兴业可转债基金费率优惠活动的公告	2007-6-19
14	兴业可转债混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要	2007-6-25
15	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第一次提示性公告	2007-6-27
16	兴业基金管理有限公司旗下各基金2007年半年度资产 净值公告	2007-7-2
17	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第二次提示性公告	2007-7-11
18	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第三次提示性公告	2007-7-25
19	关于通过兴业证券网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	2007-8-1
20	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第四次提示性公告	2007-8-8
21	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第五次提示性公告	2007-9-4
22	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第六次提示性公告	2007-9-28
23	关于修改旗下四基金基金合同和托管协议部分条款的公告	2007-9-28
24	关于通过工商银行个人网银申购兴业可转债基金申购费率优惠活动展期的公告	2007-9-29
25	关于增加中国建设银行为旗下四基金代销机构的公告	2007-10-12
26	关于通过海通证券网上交易系统申购兴业全球视野基金和兴业可转债基金费率优惠活动的公告	2007-10-18
27	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第七次提示性公告	2007-10-29
28	关于通过建设银行办理旗下基金定期定额投资业务的补充公告	2007-11-5
29	关于增加联合证券为旗下基金代销机构的公告	2007-11-8
30	关于旗下基金开通建行龙卡储蓄卡网上交易业务的公告	2007-11-8
31	关于通过华泰证券网上交易系统申购兴业趋势基金和兴业可转债基金费率优惠活动的公告	2007-11-15
32	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第八次提示性公告	2007-11-29
33	关于通过招商银行网银申购兴业可转债基金费率优惠活动的公告	2007-11-29
34	关于增加浦发银行为旗下三基金代销机构的公告	2007-12-14
35	关于通过浦发银行办理旗下部分基金定期定额投资业务的公告	2007-12-14
36	关于通过联合证券网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	2007-12-14
37	关于增加交通银行为旗下两基金代销机构的公告	2007-12-26
38	关于旗下两只基金参加交通银行网上银行申购费率优惠活动的公告	2007-12-26
39	关于在交通银行开通旗下两只基金定期定额投资业务的公告	2007-12-26
40	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停申购业务的第九次提示性公告	2007-12-28

9、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并经公司董事会批准。

（1）2007年通过各证券公司专用席位股票年交易量和年佣金情况

序号	券商名称	席位个数	股票交易量（元）	占交易量比例	席位交易佣金（元）	占交易量比例
1	兴业证券	2	1,802,702,232.87	30.39%	1,499,176.68	30.57%
2	中金公司	1	596,399,105.22	10.05%	495,009.00	10.09%
3	广发证券	1	143,368,487.01	2.42%	119,962.18	2.45%
4	中银国际	1	630,005,768.40	10.62%	516,733.26	10.54%
5	国泰君安	1	1,309,336,209.23	22.07%	1,096,054.42	22.35%
6	申银万国	1	806,485,665.41	13.59%	666,196.66	13.58%
7	光大证券	1	643,980,014.87	10.86%	510,973.85	10.42%
	合 计	8	5,932,277,483.01	100%	4,904,106.05	100.00%

（2）2007年通过各证券公司专用席位债券、权证交易量情况

序号	券商名称	债券交易量（元）	占交易量比例	权证成交量（元）	占交易量比例
1	兴业证券	1,186,569,698.66	46.71%	14,119,610.80	26.03%
2	中金公司	119,248,359.50	4.69%	21,650,846.56	39.91%
3	广发证券	29,992,074.50	1.18%	—	—
4	中银国际	474,979,937.95	18.70%	7,218,803.20	13.31%
5	国泰君安	440,145,640.60	17.33%	11,253,547.37	20.75%
6	申银万国	148,344,025.20	5.84%	—	—
7	光大证券	141,128,208.43	5.56%	—	—
	合 计	2,540,407,944.84	100.00%	54,242,807.93	100.00%

（3）2007年通过各证券公司专用席位债券回购成交金额情况

报告期内本基金未通过专用席位进行债券回购交易。

（4）本报告期内租用证券公司席位变更情况

报告期内本基金专用交易席位减少中银国际证券、湘财证券、金元证券、国元证券、中信建投证券各1个，减少银河证券席位2个。

十一、备查文件目录

1、中国证监会批准兴业可转债混合型证券投资基金设立的文件

2、《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》

3、《兴业可转债混合型证券投资基金托管协议》

4、《兴业可转债混合型证券投资基金更新招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

存放地点：基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536

兴业基金管理有限公司
2008年3月29日

兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)2007年年度报告摘要

（上接222版）

衍生金融资产	—	—	—	45,569,443.65	45,569,443.65
应收证券清算款	—	—	—	210,250,000.00	210,250,000.00
应收利息	—	—	—	12,344,197.84	12,344,197.84
应收申购款	—	—	—	62,479,903.30	62,479,903.30
资产总计	7,217,002,330.19	66,717,347.40	29,906,508.20	19,349,059,612.42	26,662,685,798.21
负债					
应付赎回款	—	—	—	114,397,468.78	114,397,468.78
应付管理人报酬	—	—	—	31,660,654.87	31,660,654.87
应付托管费	—	—	—	5,276,775.82	5,276,775.82
应付交易费用	—	—	—	2,471,250.43	2,471,250.43
其他负债	—	—	—	1,894,409.28	1,894,409.28
负债总计	—	—	—	155,700,559.18	155,700,559.18
利率敏感度缺口	7,217,002,330.19	66,717,347.40	29,906,508.20	19,193,359,053.24	26,506,985,239.03
2006/12/31	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	140,388,811.49	—	—	—	140,388,811.49
结算备付金	1,561,112.17	—	—	—	1,561,112.17
存出保证金	2,002,160.00	—	—	250,000.00	2,252,160.00
交易性金融资产	—	2,739,251.60	—	1,155,895,441.28	1,158,634,692.88
衍生金融资产	—	—	—	31,114,649.83	31,114,649.83
应收利息	—	—	—	47,943.34	47,943.34
应收申购款	—	—	—	11,985,003.85	11,985,003.85
资产总计	143,952,083.66	2,739,251.60	—	1,199,293,038.30	1,345,984,373.56
负债					
应付证券清算款	—	—	—	252,111.57	252,111.57
应付赎回款	—	—	—	1,492,112.78	1,492,112.78
应付管理人报酬	—	—	—	1,417,507.76	1,417,507.76
应付托管费	—	—	—	236,251.30	236,251.30
应付交易费用	—	—	—	828,500.39	828,500.39
其他负债	—	—	—	1,121,918.96	1,121,918.96
负债总计	—	—	—	5,348,402.76	5,348,402.76
利率敏感度缺口	143,952,083.66	2,739,251.60	—	1,193,944,635.54	1,340,635,970.80

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

	增加/减少基准点	对净值的影响
	%	（千元）
2007年12月31日		
利率	+1.00	-9,071.70
	-1.00	9,233.80
2006年12月31日		
利率	+1.00	—
	-1.00	—

注：1.此处的基准利率变化采用收益率曲线的平移进行模拟。因本基金债券多为央票，所以以银行间国债作为样本拟和收益率曲线。具体采用Nelson-siegel模型模拟收益率曲线。

2.可转债受正股价格影响较大，受利率变动影响较小，因此不适合做利率敏感性分析。

(c)外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

七、投资组合报告

（一）本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
1	股票	19,016,938,976.42	71.32%
2	债券	1,349,813,855.60	5.06%
3	权证	45,569,443.65	0.17%
4	银行存款及清算备付金	5,961,812,330.19	22.36%
5	其他资产	288,551,192.35	1.09%
	资产合计	26,662,685,798.21	100%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	827,355.90	0.00%
B	采掘业	1,488,570,350.91	5.62%
C	制造业	6,945,735,215.04	26.20%
C0	其中：食品、饮料	671,929,933.45	2.53%
C1	纺织、服装、皮毛	615,610.40	0.00%
C2	木材、家具	55,948,658.37	0.21%
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,322,979,378.67	4.99%
C5	电子	168,570,156.50	0.64%
C6	金属、非金属	2,314,614,016.55	8.73%
C7	机械、设备、仪表	2,153,705,154.46	8.13%
C8	医药、生物制品	217,528,258.57	0.82%
C99	其他制造业	39,844,048.07	0.15%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	832,938,187.66	3.14%
E	建筑业	259,900,778.13	0.98%
F	交通运输、仓储业	1,598,793,852.48	6.03%
G	信息技术业	1,087,119,782.76	4.10%
H	批发和零售贸易	656,547,492.13	2.48%
I	金融、保险业	4,806,594,408.80	18.13%
J	房地产业	1,109,700,240.02	4.19%
K	社会服务业	43,594,031.39	0.16%
L	传播与文化产业	152,414,252.97	0.57%
M	综合类	34,203,028.23	0.13%
	合计	19,016,938,976.42	71.74%

（三）报告期末按市值占基金资产净值前十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	43,086,240	1,707,507,691.20	6.44%
2	600019	宝钢股份	66,200,000	1,154,528,000.00	4.36%
3	600000	浦发银行	18,400,000	971,520,000.00	3.67%
4	601006	大秦铁路	30,626,700	784,656,054.00	2.96%
5	601318	中国平安	7,395,000	784,609,500.00	2.96%
6	600005	武钢股份	36,648,818	721,981,714.60	2.72%
7	601398	工商银行	81,800,939	665,041,634.07	2.51%
8	600050	中国联通	46,000,000	555,680,000.00	2.10%
9	600900	长江电力	25,047,677	488,179,224.73	1.84%
10	000063	中兴通讯	7,003,877	446,076,926.13	1.68%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于兴业基金管理有限公司网站的年度报告正文。

（四）本报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
1	600019	宝钢股份	909,809,223.69	67.86%
2	600036	招商银行	887,684,046.44	66.21%
3	601318	中国平安	615,184,780.47	45.89%
4	600000	浦发银行	598,198,348.75	44.62%
5	601006	大秦铁路	590,908,541.81	44.08%
6	601398	工商银行	506,446,846.09	37.78%
7	600005	武钢股份	401,767,793.86	29.97%
8	600900	长江电力	376,668,758.67	28.10%
9	600030	中信证券	348,100,453.86	25.97%
10	000063	中兴通讯	331,715,999.73	24.74%
11	600050	中国联通	326,672,993.20	24.37%
12	000002	万 科 A	316,955,809.90	23.64%
13	600383	金地集团	295,999,990.00	22.08%
14	600104	上海汽车	282,648,242.61	21.08%
15	000625	长安汽车	220,046,787.91	16.41%
16	600096	云 天 化	216,244,802.33	16.13%
17	601666	平煤天安	213,585,689.47	15.93%
18	600028	中国石化	207,850,436.53	15.50%
19	600309	烟台万华	193,942,287.95	14.47%
20	600176	中国玻纤	159,434,955.14	11.89%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
1	600519	贵州茅台	226,579,332.20	16.90%
2	600104	上海汽车	158,458,113.59	11.82%
3	601318	中国平安	153,192,481.07	11.43%
4	600048	保利地产	137,411,803.59	10.25%
5	601006	大秦铁路	132,812,952.27	9.91%
6	600748	上实发展	125,220,957.35	9.34%
7	600549	厦门钨业	121,263,825.63	9.05%
8	600472	包头铝业	118,587,196.35	8.85%
9	600900	长江电力	115,623,407.47	8.62%
10	600016	民生银行	114,305,290.69	8.53%
11	600887	伊利股份	108,633,365.85	8.10%
12	600050	中国联通	107,938,050.58	8.05%
13	600019	宝钢股份	101,869,773.80	7.60%
14	600000	浦发银行	101,340,079.93	7.56%
15	000031	中粮地产	81,193,916.68	6.06%
16	600030	中信证券	79,938,028.16	5.96%
17	601600	中国铝业	72,956,067.88	5.44%
18	600500	中化国际	61,623,212.36	4.60%
19	600688	S上石化	56,911,127.41	4.25%
20	600219	南山铝业	51,488,120.50	3.84%

3、报告期内买入股票的成本总额为13,110,849,350.71元，卖出股票的收入总额为3,348,523,105.68元。

（五）报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
可转债	66,717,347.40	0.25%
企业债	29,906,508.20	0.11%
央行票据	1,253,190,000.00	4.73%
债券投资合计	1,349,813,855.60	5.09%

（六）本报告期末债券明细

报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的债券明细

序号	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	07央行票据127	577,140,000.00	2.18%
2	07央行票据118	288,780,000.00	1.09%
3	07央行票据81	193,120,000.00	0.73%
4	07央行票据18	97,150,000.00	0.37%
5	07央行票据28	97,000,000.00	0.37%
6	唐钢转债	55,898,152.20	0.21%
7	07上汽债	27,620,024.00	0.10%
8	大荒转债	10,819,195.20	0.04%
9	07日照债	2,286,484.20	0.01%

（七）投资组合报告附注

1、报告期内本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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规