嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券基金2008年半年度报告摘要

（上接C135版）

2.报告期末本基金持有的因非公开发行而流通受限的股票

序号	股票代码	股票名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
1	000401	冀东水泥	2008-6-30	2009-7-1	非公开发行	11.83	11.83	21,200,000	250,796,000.00	250,796,000.00
合计									250,796,000.00	250,796,000.00

3.报告期末本基金持有的暂时停牌股票

序号	股票代码	股票简称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
1	000792	盐湖钾肥	2008-6-26	重大事项	88.12	未公告	未知	25,206,206	1,622,603,690.31	2,221,170,872.72
合 计									1,622,603,690.31	2,221,170,872.72

4.报告期末债券正回购交易中作为质押的债券：无

5.报告期末本基金持有流通受限的权证：无

（三）嘉实债券基金

1.报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的股票

序号	证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
1	601899	紫金矿业	2008-4-18	2008-7-25	新股流通受限	7.13	7.80	8,231,374	58,689,696.62	64,204,717.20
2	002223	鱼跃医疗	2008-4-10	2008-7-18	新股流通受限	9.48	20.00	19,071	180,793.08	381,420.00
3	002224	三力士	2008-4-17	2008-7-25	新股流通受限	9.38	13.77	18,444	173,004.72	253,973.88
4	002225	濮耐股份	2008-4-17	2008-7-25	新股流通受限	4.79	6.50	46,153	221,072.87	299,994.50
5	002227	奥特迅	2008-4-24	2008-8-6	新股流通受限	14.37	14.05	24,134	346,805.58	339,082.70
6	002228	合兴包装	2008-4-24	2008-8-8	新股流通受限	10.15	10.74	26,049	264,397.35	279,766.26
7	002229	鸿博股份	2008-4-24	2008-8-8	新股流通受限	13.88	13.58	19,853	275,569.64	269,603.74
8	002230	科大讯飞	2008-4-29	2008-8-12	新股流通受限	12.66	30.09	17,585	222,626.10	529,132.65
9	002231	奥维通信	2008-4-29	2008-8-12	新股流通受限	8.46	8.50	21,837	184,741.02	185,614.50
10	002232	启明信息	2008-4-29	2008-8-11	新股流通受限	9.44	12.65	23,382	220,726.08	295,782.30
11	002233	塔牌集团	2008-5-8	2008-8-18	新股流通受限	10.03	9.70	81,297	815,408.91	788,580.90
12	002234	民和股份	2008-5-8	2008-8-18	新股流通受限	10.61	20.24	16,147	171,319.67	326,815.28
13	002236	大华股份	2008-5-12	2008-8-20	新股流通受限	24.24	36.00	12,573	304,769.52	452,628.00
14	002237	恒邦股份	2008-5-12	2008-8-20	新股流通受限	25.98	40.97	21,890	568,702.20	896,833.30
15	002238	天威视讯	2008-5-14	2008-8-26	新股流通受限	6.98	12.25	39,463	275,451.74	483,421.75
16	002239	金飞达	2008-5-14	2008-8-22	新股流通受限	9.33	8.98	26,180	244,259.40	235,096.40
17	002241	歌尔声学	2008-5-16	2008-8-22	新股流通受限	18.78	26.84	24,635	462,645.30	661,203.40
18	002242	九阳股份	2008-5-20	2008-8-28	新股流通受限	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
19	002243	通产丽星	2008-5-20	2008-8-28	新股流通受限	7.78	8.02	39,414	306,640.92	316,100.28
20	002244	滨江集团	2008-5-21	2008-8-29	新股流通受限	20.31	15.68	129,717	2,634,552.27	2,033,962.56
21	002245	澳洋顺昌	2008-5-28	2008-9-5	新股流通受限	16.38	16.02	10,566	173,071.08	169,267.32
22	002246	北化股份	2008-5-29	2008-9-5	新股流通受限	6.95	8.22	37,754	262,390.30	310,337.88
23	002247	帝龙新材	2008-5-30	2008-9-12	新股流通受限	16.05	14.65	13,026	209,067.30	190,830.90
24	002248	华东数控	2008-6-5	2008-9-12	新股流通受限	9.80	10.97	18,001	176,409.80	197,470.97
25	002249	大洋电机	2008-6-10	2008-9-19	新股流通受限	25.60	24.21	29,830	763,648.00	722,184.30
26	002250	联化科技	2008-6-10	2008-9-19	新股流通受限	10.52	12.80	26,001	273,530.52	332,812.80
27	002251	步步高	2008-6-11	2008-9-19	新股流通受限	26.08	48.55	22,142	577,463.36	1,074,994.10
28	002252	上海莱士	2008-6-13	2008-9-23	新股流通受限	12.81	24.87	27,141	347,676.21	674,996.67
29	002254	烟台氨纶	2008-6-18	2008-9-25	新股流通受限	18.59	27.41	36,308	674,965.72	995,202.28
30	002255	海陆重工	2008-6-18	2008-9-25	新股流通受限	10.46	19.64	19,865	207,787.90	390,148.60
31	002257	立立电子	2008-6-30	待定	未上市	21.81	21.81	43,974	959,072.94	959,072.94
32	002258	利尔化学	2008-6-30	2008-10-8	新股流通受限	16.06	16.06	51,434	826,030.04	826,030.04
合计									73,084,665.68	81,997,493.12

2.报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的债券：无

3.报告期末本基金持有的暂时停牌股票：无

4.报告期末债券正回购交易中作为质押的债券：无

5.报告期末本基金持有流通受限的权证：无

§7 投资组合报告

7.1 嘉实增长基金

（1）报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	1,511,497,152.00	56.05%
债券	537,068,302.50	19.91%
权证	4,189,643.72	0.16%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	297,033,838.13	11.01%
其他资产	347,003,524.38	12.87%
合计	2,696,792,460.73	100.00%

（2）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	62,046,278.80	2.80%
B 采掘业	322,700,433.21	14.59%
C 制造业	820,763,207.25	37.10%
C0 食品、饮料	201,196,511.10	9.10%
C1 纺织、服装、皮毛	235,096.40	0.01%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	6,082,941.40	0.27%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	148,732,572.05	6.72%
C5 电子	15,207,054.60	0.69%
C6 金属、非金属	82,753,938.97	3.74%
C7 机械、设备、仪表	133,994,065.53	6.06%
C8 医药、生物制品	207,822,906.78	9.39%
C99 其他制造业	24,738,120.42	1.12%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业	4,999,661.88	0.23%
F 交通运输、仓储业		
G 信息技术业	107,593,239.85	4.86%
H 批发和零售贸易	44,835,660.05	2.03%
I 金融、保险业	75,352,500.32	3.41%
J 房地产业	51,417,131.61	2.32%
K 社会服务业	1,489,772.28	0.07%
L 传播与文化产业	20,299,266.75	0.92%
M 综合类		
合计	1,511,497,152.00	68.33%

（3）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

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600779	水井坊	4,264,582	88,959,180.52	4.02%
2	601699	潞安环能	2,229,499	85,858,006.49	3.88%
3	000423	东阿阿胶	3,303,297	85,225,062.60	3.85%
4	000848	承德露露	4,501,981	83,736,846.60	3.79%
5	000983	西山煤电	1,570,279	78,513,950.00	3.55%
6	600588	用友软件	2,802,627	78,389,477.19	3.54%
7	600479	千金药业	4,050,834	73,441,620.42	3.32%
8	600036	招商银行	3,130,144	73,307,972.48	3.31%
9	601808	中海油服	2,847,156	66,651,921.96	3.01%
10	000651	格力电器	2,065,224	64,641,511.20	2.92%

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

（4）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前20名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	198,729,252.33	6.90%
2	601088	中国神华	173,931,085.06	6.04%
3	600779	水井坊	153,510,012.17	5.33%
4	000983	西山煤电	122,809,069.87	4.26%
5	000651	格力电器	122,029,724.62	4.24%
6	601166	兴业银行	109,949,172.01	3.82%
7	601699	潞安环能	106,904,509.21	3.71%
8	601808	中海油服	88,318,800.11	3.07%
9	000972	新中基	87,099,392.98	3.02%
10	600383	金地集团	73,660,360.72	2.56%
11	000709	唐钢股份	67,327,913.90	2.34%
12	600867	通化东宝	63,309,202.69	2.20%
13	600267	海正药业	63,066,617.64	2.19%
14	600096	云天化	60,942,320.91	2.12%
15	000792	盐湖钾肥	57,279,591.14	1.99%
16	000898	鞍钢股份	55,963,298.88	1.94%
17	000839	中信国安	53,000,241.62	1.84%
18	000401	冀东水泥	44,523,374.43	1.55%
19	000422	湖北宜化	42,822,414.08	1.49%
20	600150	中国船舶	42,614,971.00	1.48%

② 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值前20名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	182,335,049.42	6.33%
2	601166	兴业银行	177,740,106.81	6.17%
3	601088	中国神华	133,739,949.90	4.64%
4	002097	山河智能	73,245,147.65	2.54%
5	000069	华侨城A	60,174,343.82	2.09%
6	000423	东阿阿胶	60,172,249.11	2.09%
7	600867	通化东宝	58,038,302.97	2.02%
8	000983	西山煤电	57,336,106.61	1.99%
9	000422	湖北宜化	49,713,294.04	1.73%
10	000839	中信国安	48,316,238.08	1.68%
11	600383	金地集团	46,096,636.40	1.60%
12	600761	安徽合力	43,269,300.82	1.50%
13	600058	五矿发展	42,305,235.13	1.47%
14	000898	鞍钢股份	42,275,081.39	1.47%
15	600779	水井坊	36,457,423.56	1.27%
16	600150	中国船舶	35,750,777.83	1.24%
17	000538	云南白药	35,560,361.92	1.23%
18	600267	海正药业	35,339,533.13	1.23%
19	600583	海油工程	34,897,656.70	1.21%
20	600479	千金药业	33,571,699.21	1.17%

③ 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额(元)	卖出股票收入总额(元)
2,817,586,699.33	2,287,633,009.97

（5）报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	164,637,012.90	7.44%
金融债	89,892,000.00	4.06%
央行票据	259,443,000.00	11.73%
企业债		
可转换债券	23,096,289.60	1.05%
资产支持证券		
其他		
合计	537,068,302.50	24.28%

（6）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	债券代码	债券简称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	010115	21国债(5)	86,089,933.50	3.89%
2	0801028	08央行票据28	76,864,000.00	3.47%
3	030301	03进出01	70,000,000.00	3.16%
4	0801034	08央行票据34	57,648,000.00	2.61%
5	0801046	08央行票据46	57,648,000.00	2.61%

（7）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	580019	石化CWB1	2,323,707	4,189,643.72	0.19%

（8）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：无

（9）投资组合报告附注

①报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

②本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

③其他资产构成

序号	项 目	期末余额(元)
1	存出保证金	2,074,745.79
2	应收证券清算款	335,230,188.45
3	应收股利	108,964.80
4	应收利息	8,643,061.04
5	应收申购款	946,564.30
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
合计		347,003,524.38

④ 持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	105598	大荒转债	23,096,289.60	1.04%

⑤ 报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	成本总额(元)	类别(被动持有或主动投资)
1	580019	石化CWB1	2,323,707	5,381,308.07	被动持有

7.2 嘉实稳健基金

（1）报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	14,189,069,905.11	63.56%
债券	5,676,209,381.30	25.42%
权证	39,354,873.86	0.18%
买入返售证券		
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	1,834,219,042.64	8.22%
其他资产	585,491,907.62	2.62%
合计	22,324,345,110.53	100.00%

（2）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	326,815.28	0.00%
B 采掘业	3,841,941,541.34	17.26%
C 制造业	8,031,953,194.24	36.09%
C0 食品、饮料	86,261,283.36	0.39%
C1 纺织、服装、皮毛	9,098,185.20	0.04%
C2 木材、家具	90,549,838.50	0.41%
C3 造纸、印刷	382,785,867.85	1.72%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	2,223,781,399.82	9.99%
C5 电子	2,649,346.75	0.01%
C6 金属、非金属	4,626,052,378.21	20.78%
C7 机械、设备、仪表	466,763,064.56	2.10%
C8 医药、生物制品	143,909,279.99	0.65%
C99 其他制造业	102,550.00	0.00%
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	423,348,522.75	1.90%
G 信息技术业	13,527,462.05	0.06%
H 批发和零售贸易	76,198,968.38	0.34%
I 金融、保险业	536,033,268.97	2.41%
J 房地产业	976,325,835.03	4.39%
K 社会服务业	288,930,875.32	1.30%
L 传播与文化产业	483,421.75	0.00%
M 综合类		
合计	14,189,069,905.11	63.75%

（3）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

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	000792	盐湖钾肥	25,206,206	2,221,170,872.72	9.98%
2	601699	潞安环能	47,179,135	1,816,868,488.85	8.16%
3	600019	宝钢股份	147,332,644	1,283,267,329.24	5.77%
4	000983	西山煤电	23,008,437	1,150,421,850.00	5.17%
5	000878	云南铜业	43,928,856	785,447,945.28	3.53%
6	600383	金地集团	77,322,180	701,312,172.60	3.15%
7	000898	鞍钢股份	50,781,969	661,689,056.07	2.97%
8	600348	国阳新能	13,490,473	608,555,237.03	2.73%
9	600569	安阳钢铁	96,824,607	472,504,082.16	2.12%
10	000401	冀东水泥	33,093,891	398,874,942.95	1.79%

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

（4）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前20名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600019	宝钢股份	1,749,514,900.31	4.59%
2	000001	深发展A	1,693,223,018.97	4.44%
3	000878	云南铜业	1,411,233,715.65	3.70%
4	601088	中国神华	1,203,849,082.50	3.16%
5	601186	中国铁建	1,084,035,504.65	2.84%
6	000983	西山煤电	917,754,230.29	2.41%
7	000792	盐湖钾肥	869,686,360.81	2.28%
8	600383	金地集团	775,601,212.75	2.04%
9	600036	招商银行	737,561,362.54	1.94%
10	000898	鞍钢股份	633,082,079.78	1.66%
11	000002	万科A	516,676,098.43	1.36%
12	601699	潞安环能	502,023,761.40	1.32%
13	000932	华菱管线	465,511,065.17	1.22%
14	600717	天津港	373,450,139.58	0.98%
15	600015	华夏银行	359,465,751.83	0.94%
16	600585	海螺水泥	343,044,483.09	0.90%
17	600308	华泰股份	341,021,393.87	0.89%
18	000401	冀东水泥	338,702,856.18	0.89%
19	601318	中国平安	330,733,995.62	0.87%
20	600737	中粮屯河	284,451,911.04	0.75%

②报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值前20名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	2,294,518,585.80	6.02%
2	000792	盐湖钾肥	1,754,265,143.26	4.60%
3	000002	万科A	1,707,233,709.29	4.48%
4	601088	中国神华	1,210,131,108.40	3.18%
5	601186	中国铁建	1,045,461,010.99	2.74%
6	601318	中国平安	866,576,427.05	2.27%
7	000001	深发展A	833,273,129.48	2.19%
8	600019	宝钢股份	771,381,209.45	2.02%
9	000878	云南铜业	681,358,147.16	1.79%
10	601398	工商银行	624,176,498.33	1.64%
11	600737	中粮屯河	561,237,494.03	1.47%
12	601699	潞安环能	521,088,527.56	1.37%
13	600348	国阳新能	517,969,396.99	1.36%
14	600004	白云机场	483,273,575.63	1.27%
15	600104	上海汽车	467,519,698.32	1.23%
16	601390	中国中铁	427,848,221.57	1.12%
17	000729	燕京啤酒	347,343,963.04	0.91%
18	600325	华发股份	336,537,148.68	0.88%
19	000651	格力电器	303,302,022.89	0.80%
20	600795	国电电力	266,617,122.49	0.70%

③ 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额(元)	卖出股票收入总额(元)
18,490,760,931.94	21,376,008,019.42

（5）报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	130,438,332.60	0.58%
金融债	1,290,500,000.00	5.80%
央行票据	4,244,559,000.00	19.07%
企业债	1,876,711.20	0.01%
可转换债券	8,835,337.50	0.04%
资产支持证券		
其他		
合计	5,676,209,381.30	25.50%

（6）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	债券代码	债券简称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	0801007	08央行票据07	644,004,000.00	2.89%
2	0701081	07央行票据81	581,220,000.00	2.61%
3	070302	07进出02	515,788,000.00	2.32%
4	0801004	08央行票据04	499,876,000.00	2.25%
5	0701091	07央行票据91	484,200,000.00	2.18%

（7）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	580019	石化CWB1	19,917,200	35,910,711.60	0.16%
2	580016	上汽CWB1	790,308	3,444,162.26	0.02%

（8）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：无

（9）投资组合报告附注

① 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

② 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

③ 其他资产构成

序号	项 目	期末余额(元)
1	存出保证金	14,833,347.27
2	应收证券清算款	439,011,420.35
3	应收股利	
4	应收利息	120,012,616.95
5	应收申购款	11,634,523.05
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
合计		585,491,907.62

④ 持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	125960	锡业转债	1,440,093.60	0.01%

⑤ 报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	成本总额(元)	类别(被动持有或主动投资)
1	580019	石化CWB1	19,917,200	46,124,829.44	被动持有
2	580023	康美CWB1	489,140	813,756.79	被动持有

7.3 嘉实债券基金

（1）报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	343,872,338.50	6.42%
债券	4,620,795,254.73	86.21%
权证		
买入返售证券		
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	156,082,163.59	2.91%
其他资产	239,151,017.87	4.46%
合计	5,359,900,774.69	100.00%

（2）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	326,815.28	0.01%
B 采掘业	85,172,517.20	1.59%
C 制造业	50,562,854.40	0.94%
C0 食品、饮料		
C1 纺织、服装、皮毛	235,096.40	0.00%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	549,370.00	0.01%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	3,034,457.16	0.06%
C5 电子	2,072,904.34	0.04%
C6 金属、非金属	39,854,477.64	0.75%
C7 机械、设备、仪表	3,950,721.29	0.07%
C8 医药、生物制品	674,996.67	0.01%
C99 其他制造业	190,830.90	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业	24,410,103.12	0.46%
F 交通运输、仓储业	178,627,873.32	3.34%
G 信息技术业	1,010,529.45	0.02%
H 批发和零售贸易	1,074,994.10	0.02%
I 金融、保险业		
J 房地产业	2,033,962.56	0.04%
K 社会服务业	169,267.32	0.00%
L 传播与文化产业	483,421.75	0.01%
M 综合类		
合计	343,872,338.50	6.43%

（3）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

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600026	中海发展	8,980,788	178,627,873.32	3.34%
2	601899	紫金矿业	8,231,374	64,204,717.20	1.20%
3	600449	赛马实业	3,240,000	36,385,200.00	0.68%
4	601186	中国铁建	2,607,917	24,410,103.12	0.46%
5	601898	中煤能源	1,030,000	16,459,400.00	0.31%
6	601088	中国神华	120,000	4,508,400.00	0.08%
7	002244	滨江集团	129,717	2,033,962.56	0.04%
8	002242	九阳股份	47,488	1,920,414.72	0.04%
9	600585	海螺水泥	37,106	1,483,868.94	0.03%
10	002251	步步高	22,142	1,074,994.10	0.02%

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

（4）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前20名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600026	中海发展	297,196,982.48	4.94%
2	601899	紫金矿业	64,878,536.62	1.08%
3	600449	赛马实业	51,766,104.60	0.86%
4	000960	锡业股份	46,024,203.76	0.76%
5	601186	中国铁建	32,651,680.00	0.54%
6	600236	桂冠电力	28,747,847.52	0.48%
7	601898	中煤能源	28,510,020.00	0.47%
8	600585	海螺水泥	15,326,542.00	0.25%
9	002244	滨江集团	4,909,272.27	0.08%
10	002242	九阳股份	2,310,079.52	0.04%
11	002237	恒邦股份	1,581,922.20	0.03%
12	002249	大洋电机	1,557,248.00	0.03%
13	002233	塔牌集团	1,517,508.91	0.03%
14	002241	歌尔声学	1,270,185.30	0.02%
15	002251	步步高	1,242,503.36	0.02%
16	002254	烟台氨纶	1,056,060.72	0.02%
17	002257	立立电子	959,072.94	0.02%
18	002236	大华股份	874,409.52	0.01%
19	002258	利尔化学	826,030.04	0.01%
20	002250	联化科技	589,130.52	0.01%

②报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值前20名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	601088	中国神华	80,146,924.77	1.33%
2	601857	中国石油	79,559,266.79	1.32%
3	601939	建设银行	65,169,778.43	1.08%
4	601919	中国远洋	58,496,253.96	0.97%
5	601601	中国太保	45,643,114.81	0.76%
6	000960	锡业股份	35,400,604.12	0.59%
7	601169	北京银行	34,863,093.33	0.58%
8	601808	中海油服	28,162,289.77	0.47%
9	600236	桂冠电力	27,862,615.76	0.46%
10	600026	中海发展	18,158,487.51	0.30%
11	601899	紫金矿业	12,834,820.00	0.21%
12	601898	中煤能源	12,177,579.68	0.20%
13	601186	中国铁建	11,166,350.00	0.19%
14	600585	海螺水泥	9,209,009.50	0.15%
15	600449	赛马实业	4,585,442.01	0.08%
16	002128	露天煤业	4,488,510.45	0.07%
17	601918	国投新集	4,433,717.77	0.07%
18	002202	金风科技	4,136,880.00	0.07%
19	002244	滨江集团	2,856,000.00	0.05%
20	002242	九阳股份	2,558,732.00	0.04%

③ 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额(元)	卖出股票收入总额(元)
594,232,083.98	572,657,484.11

（5）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
国债	1,543,027,903.60	28.86%
央行票据	894,305,000.00	16.72%
企业债券	533,569,970.80	9.98%
金融债券	1,123,958,000.00	21.02%
可转换债券	525,934,380.33	9.84%
资产支持证券		
其他		
合计	4,620,795,254.73	86.42%

（6）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