

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,022,468,067.95	65.78
	其中：股票	6,022,468,067.95	65.78
2	固定收益投资	693,055,000.00	7.57
	其中：债券	693,055,000.00	7.57
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,118,737,727.80	23.14
6	其他各项资产	321,171,444.65	3.51
7	合计	9,155,432,240.40	100.00

截至2010年6月30日，上投摩根内需动力股票型证券投资基金资产净值为9,034,811,109.81元，基金份额净值为0.9981元，累计基金份额净值为1.1781元。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,732,078,416.78	52.38

C0	食品、饮料	414,502,504.87	4.59
C1	纺织、服装、皮毛	375,115,331.03	4.15
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	65,665,229.46	0.73
C4	石油、化学、塑胶、塑料	283,005,473.25	3.13
C5	电子	5,712,797.75	0.06
C6	金属、非金属	362,003,329.42	4.01
C7	机械、设备、仪表	1,150,992,099.31	12.74
C8	医药、生物制品	2,075,081,651.69	22.97
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	113,044,959.45	1.25
F	交通运输、仓储业	28,294,621.74	0.31
G	信息技术业	123,723,017.62	1.37
H	批发和零售贸易	435,833,628.48	4.82
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	588,504,976.08	6.51
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	988,447.80	0.01
	合计	6,022,468,067.95	66.66

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600518	康美药业	60,001,986	736,824,388.08	8.16
2	601607	上海医药	26,000,000	425,880,000.00	4.71
3	600517	置信电气	21,800,000	377,358,000.00	4.18
4	000999	华润三九	14,773,927	339,061,624.65	3.75
5	000400	许继电气	11,770,800	309,336,624.00	3.42
6	000559	万向钱潮	22,744,990	235,638,096.40	2.61
7	000858	五粮液	8,800,000	213,224,000.00	2.36
8	600859	王府井	5,601,462	190,449,708.00	2.11
9	000888	峨眉山A	10,316,191	175,581,570.82	1.94
10	002123	荣信股份	5,199,926	166,397,632.00	1.84

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	693,055,000.00	7.67
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	693,055,000.00	7.67

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001031	10央行票据31	2,000,000	199,140,000.00	2.20
2	0901036	09央行票据36	1,500,000	147,255,000.00	1.63
3	0901046	09央行票据46	1,500,000	147,210,000.00	1.63
4	0801020	08央行票据20	1,000,000	101,440,000.00	1.12
5	0901070	09央行票据70	1,000,000	98,010,000.00	1.08

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形：

报告期内本基金投资的000858五粮液于2009年9月9日公告其受到中国证监会调查。根据2009年9月9日宜宾五粮液股份有限公司（下称：五粮液，股票代码：000858）《宜宾五粮液股份有限公司第四届董事会公告》，中国证券监督管理委员会决定根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，就五粮液涉嫌违反证券法律法规对该公司进行立案调查。

对该股票投资决策程序的说明：本基金管理人在投资该股票前严格执行了对该上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等的相关投资决策流程。该股票根据股票池审批流程后进入本基金备选库，由研究员跟踪并分析。该调查事件发生

后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析,认为此事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对该上市公司的投资判断。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,974,450.09
2	应收证券清算款	290,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,732,250.15
5	应收申购款	7,464,744.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	321,171,444.65

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。