

## § 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	387,023,265.47	54.20
	其中：股票	387,023,265.47	54.20
2	固定收益投资	200,449,240.00	28.07
	其中：债券	200,449,240.00	28.07
	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	120,434,933.49	16.87
6	其他各项资产	6,196,570.01	0.87
7	合计	714,104,008.97	100.00

截至2010年6月30日，上投摩根双核平衡混合型证券投资基金资产净值为709,421,953.95元，基金份额净值为1.0605元，累计基金份额净值为1.1105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	5,598,000.00	0.79
B	采掘业	6,799,244.15	0.96
C	制造业	283,737,843.03	40.00
C0	食品、饮料	50,503,142.50	7.12

C1	纺织、服装、皮毛	7,048,942.50	0.99
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,335,282.60	0.47
C4	石油、化学、塑胶、塑料	33,816,981.77	4.77
C5	电子	13,885,736.54	1.96
C6	金属、非金属	5,441,164.50	0.77
C7	机械、设备、仪表	104,063,150.74	14.67
C8	医药、生物制品	54,150,441.88	7.63
C99	其他制造业	11,493,000.00	1.62
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	3,465,000.00	0.49
G	信息技术业	12,992,077.99	1.83
H	批发和零售贸易	37,318,879.40	5.26
I	金融、保险业	7,021,500.00	0.99
J	房地产业	3,030,000.00	0.43
K	社会服务业	20,433,096.14	2.88
L	传播与文化产业	6,627,624.76	0.93
M	综合类	-	-
	合计	387,023,265.47	54.55

### 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	600298	安琪酵母	800,000	27,968,000.00	3.94
2	600458	时代新材	785,409	23,483,729.10	3.31
3	600673	东阳光铝	1,699,898	17,899,925.94	2.52
4	000400	许继电气	606,321	15,934,115.88	2.25
5	600809	山西汾酒	379,750	15,581,142.50	2.20
6	002123	荣信股份	376,098	12,035,136.00	1.70
7	600054	黄山旅游	599,917	11,050,471.14	1.56
8	000423	东阿阿胶	299,953	10,426,366.28	1.47
9	600315	上海家化	337,883	10,302,052.67	1.45
10	002266	浙富股份	399,920	9,830,033.60	1.39

#### 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	89,119,000.00	12.56
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	41,579,298.40	5.86
5	企业短期融资券	60,351,000.00	8.51
6	可转债	9,399,941.60	1.33
7	其他	-	-
8	合计	200,449,240.00	28.26

#### 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	0901034	09央行票据34	600,000	58,896,000.00	8.30
2	0801065	08央行票据65	200,000	20,406,000.00	2.88
3	0981160	09二滩CP02	200,000	20,098,000.00	2.83
4	122033	09富力债	130,000	13,656,500.00	1.93
5	122020	09复地债	120,000	12,660,000.00	1.78

#### 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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

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	1,908,103.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	45,000.00
4	应收利息	3,674,186.77
5	应收申购款	569,279.41

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,196,570.01

#### 5.8.4 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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110008	王府转债	5,611,741.20	0.79

#### 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。