

7	其他各项资产				919,312.98	
8	合计				532,645,258.63	100.00
8.2 期末投资目标基金明细					金额单位：人民币元	
序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	上证180金融交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	国泰基金管理有限公司	494,025,608.52	93.62
8.3 期末按行业分类的股票投资组合						
					金额单位：人民币元	
代码	行业类别			公允价值	占基金资产净值比例(%)	
A	农林、牧、渔			-	-	
B	采掘业			-	-	
C	制造业			-	-	
C0	食品、饮料			-	-	
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			-	-	

C6	金属、非金属				
C7	机械、设备、仪表				
C8	医药、生物制品				
C9	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				
I	金融、保险业	626,390.84		0.12	
J	房地产业				
K	社会服务业				
L	传播与文化产业				
M	综合类				
	合计	626,390.84		0.12	
8.4 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					
				金额单位：人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	8,778	68,995.08	0.01
2	600306	招商银行	4,756	65,395.00	0.01
3	601318	中国平安	1,280	57,971.20	0.01
4	601166	兴业银行	2,927	48,851.63	0.01
5	601528	交通银行	9,071	44,810.74	0.01
6	600000	浦发银行	4,316	42,814.72	0.01
7	600030	中信证券	2,670	35,671.20	0.01
8	600837	海通证券	3,110	31,877.50	0.01
9	601398	工商银行	6,994	29,025.10	0.01
10	601288	农业银行	9,730	27,244.00	0.01

注：投资者欲了解本投资组合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的年度报告正文。

A.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细			金额单位：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	600016	民生银行	38,600,979.78	4.12
2	601318	中国平安	37,192,717.42	3.97
3	600036	招商银行	36,022,170.69	3.84
4	601328	交通银行	27,988,479.20	2.99
5	601166	兴业银行	26,632,229.23	2.84
6	600000	浦发银行	24,717,516.70	2.64
7	600030	中信证券	21,278,497.10	2.27
8	600837	海通证券	19,812,988.55	2.11
9	601398	工商银行	19,539,807.20	2.09
10	601288	农业银行	16,788,834.43	1.79
11	601601	中国太保	16,142,485.79	1.72
12	601939	建设银行	12,579,612.43	1.34
13	601169	北京银行	11,306,012.07	1.21
14	601818	光大银行	9,027,716.95	0.96
15	600015	华夏银行	8,568,936.60	0.91
16	601628	中国人寿	7,567,924.54	0.81
17	600099	招商证券	6,828,884.81	0.73
18	601009	南京证券	4,777,339.75	0.51
19	601788	光大证券	4,344,058.45	0.46
20	601688	华泰证券	3,973,495.61	0.42

A.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票无异常交易。

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	600016	民生银行	87,559,078.99	9.34
2	600036	招商银行	85,485,803.60	9.12
3	601318	中国平安	81,345,046.14	8.63
4	601328	交通银行	64,086,697.57	6.84
5	601166	兴业银行	60,729,489.20	6.48
6	600000	浦发银行	58,000,403.61	6.19
7	600030	中信证券	49,344,850.61	5.27

9	600837	海通证券	45,249,145.42	4.83
10	601601	中国人保	36,373,786.85	3.88
11	601288	农业银行	34,815,995.30	3.72
12	601939	建设银行	29,585,361.37	3.16
13	601169	北京银行	25,639,780.52	2.74
14	601818	光大银行	20,986,713.26	2.24
15	600015	华夏银行	20,495,581.35	2.19
16	601098	中国人寿	16,370,868.36	1.75
17	600629	招商证券	16,204,381.53	1.73
18	601009	南京银行	11,001,221.30	1.17
19	601788	光大证券	10,423,150.87	1.11
20	601688	华泰证券	9,180,439.14	0.98

注：以上金额按照实际成交金额、成交资产净值以成交金额3%计算，不考虑相关交易费用。

8.5.3 计入当期损益的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本(成交)总额	371,538,748.36
卖出股票的收入(成交)总额	840,796,144.53

注：买入股票成本、卖出股票收入均按股票公允价值(成交资产净值以成交金额3%计算，不考虑相关交易费用)计算。

8.6 期末公允价值计量资产组合

本基金期末公允价值计量资产组合	
8.7 期末公允价值计量公募基金资产组合前十大持仓的前五名资产支持证券明细	
本基金期末未持有资产支持证券。	
8.8 期末公允价值计量公募基金资产组合前十大持仓的前五名资产支持证券投资明细	
本基金期末未持有资产支持证券。	
8.9 期末公允价值计量公募基金资产组合前十大持仓的前五名权证投资明细	
本基金期末未持有权证。	

8.10.2 本基金及目标基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、重大行政处罚。

8.10.3 本基金及目标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股票库之外的情况。

8.10.4 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利				
4	应收账款				9,401.37
5	应收申购款				910,111.61
6	其他应收款				
7	待摊费用				
8	其他				
9	合计				919,512.98

8.10.4期末持有的处于转股期的可转换债券余额

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.10.5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不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有本开放式基金的情况

份数单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
7,606	71,459.36	172,416,018.39	31.72%	371,103,889.70	68.28%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总额(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	3,081,928.56	0.57%

注：1. 基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究人员(含持有本基金份额最多的数量区间为100万份以上)；

§ 10 开放式基金净值披露		单位:份
基金合同生效日(2011年3月31日)	基金份额总额	983,766,043.70
本报告期间基金份额总额		1,149,947,637.14
本报告期间基金总申购份额		568,696,373.06
减:本报告期间基金总赎回份额		1,175,124,102.11
本报告期间基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额		543,519,908.09

§ 11 重大事项揭示	
11.1 基金份额持有人大会决议	
报告期内,本基金无基金份额持有人大会决议。	
11.2 报告期内基金管理人及基金托管人的重大人事变动	
2012年09月28日,本基金管理人为了顺应基金管理行业向综合型资产管理公司转变的趋势,经本基金管理人第五届董事会第十五次决议通过,同意将基金管理人人力资源部工作职能划转,林仲清先生任公司总协调。	
2012年10月1日起,基金管理人人力资源部划转至基金管理公司人力资源部管理,基金管理人人力资源部,经本基金管理人第五届董事会第十次决议审议通过,由林仲清先生任总协调职务,向陈勇先生任公司总协调。	
2012年10月1日起,基金管理人人力资源部划转至基金管理公司人力资源部管理,基金管理人人力资源部,由陈勇先生任总协调职务。	
2013年1月1日起,根据国家金融工作会议部署,肖贵生先生于中国银行股份有限公司、中国银行股份有限公司已于2013年3月27日正式上市。	
11.3 投资决策委员会、基金财产、基金托管业务的变动	
报告期内,本基金涉及及基金管理人、基金财产、基金托管业务的有关事项。	
11.4 基金投资策略的变动	
报告期内,本基金投资策略无实质变动。	
11.5 为基金提供审计的会计师事务所情况	
报告期内,本基金聘请了德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)会计师事务所无关联情况,报告年度支付给担任设计会计师事务所的报酬为40,000.00元,目前的审计机构为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。	
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚或刑事处罚情况	
报告期内,管理人、托管人及其高级管理人员无受行政处罚及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。	
11.7 基金管理人运用基金财产买卖关联方的情况	

金耀资产·人民币元						
券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	
光大证券	1	1,052,875,918.06	86.85%	921,650.80	86.88%	—
中国国际	1	159,458,974.83	13.15%	139,207.96	13.12%	本所新增
国信证券	1	—	—	—	—	—

注：除金耀资产位的选择标准外：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；
- 2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3) 经营行为规范，最近一年无重大违规行为；
- 4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能提供该业务运作流程说明的要求；
- 5) 公司有良好的研究开发人员及信息资源，并能提供具有相应资质的证券研究报告分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的数据以及丰富的金融信息产品，能根据基金投资需要，提供及时、准确、全面的研究支持。

选择程序是：根据各券商提供的各项投资、研究报告等的综合评价，符合各券商标准的，由公司研究部提出席位首份的完整意见，经基金经理和交易部同意后，并经过公司审批。

11.2.3 其他证券经纪券商交易单元选择其他证券经纪券商的情况

金耀资产·人民币元								
券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额或权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例	
光大证券	—	—	—	—	—	37,479,273.28	99.97%	
中国国际	—	—	—	—	—	10,728.60	0.03%	
国信证券	—	—	—	—	—	—	—	