

1	000002	万科A	1,273,646,631.74	10.17
2	000651	格力电器	780,120,982.26	17.52
3	600066	宇通客车	717,657,155.66	9.68
4	600048	保利地产	654,115,728.13	8.82
5	600016	民生银行	553,169,016.65	7.46
6	600104	上汽集团	544,760,680.28	7.34
7	600518	康美药业	513,232,722.44	6.92
8	601318	中国平安	464,456,207.17	6.26
9	600383	金地集团	441,509,997.31	5.95
10	600153	建发股份	415,051,330.60	5.60

11	601166	兴业银行	387,031,210.40	5.22
12	000024	招商地产	384,848,925.24	5.19
13	600859	王府井	356,397,546.90	4.80
14	002007	华兰生物	342,517,743.60	4.62
15	000423	东阿阿胶	326,320,912.58	4.30
16	002024	苏宁电器	320,109,658.32	4.32
17	002065	东华软件	297,139,395.86	4.01
18	300070	碧水源	287,256,679.28	3.87
19	002029	七匹狼	281,449,146.71	3.79
20	601669	中国水电	276,064,184.45	3.73

21	600823	世纪股份	272, 542, 440.08	3.67
22	002430	杭泵股份	271, 936, 642.36	3.67
23	600837	海通证券	269, 646, 084.85	3.64
24	002415	海康威视	259, 906, 663.41	3.50
25	600075	中国电建	259, 838, 139.09	3.50
26	600612	老白干酒	254, 719, 162.41	3.43
27	600486	东方电气	234, 689, 516.14	3.16
28	600036	招商银行	229, 576, 348.48	3.10
29	600011	华能国际	223, 592, 792.34	3.10
30	601628	中国人寿	213, 918, 143.31	2.88
31	600685	天力药业	207, 647, 932.22	2.80
32	600177	恒发集团	206, 453, 622.88	2.76
33	600062	华商联合	204, 378, 101.81	2.76
34	002038	双鹭药业	202, 530, 900.44	2.73
35	002304	洋河股份	199, 406, 118.55	2.69
36	600519	贵州茅台	184, 801, 784.42	2.49

38	300058	蓝色光标	182,284,103.39	2.46
39	600585	海康水泥	181,820,329.64	2.45
40	000528	桐 仁	179,607,387.05	2.42
41	000417	合肥百货	172,890,210.61	2.33
42	600208	新康中保	172,576,679.70	2.33
43	000430	张家界	162,892,853.04	2.16
44	000527	美的电器	161,898,698.00	2.18
45	600335	潍柴汽车	152,542,800.87	2.06
46	002269	龙源服饰	151,265,724.67	2.04

期以成交金额填列,不考虑相关交易费用。

600104 于2012年1月9日起,公司股票简称由“海汽车”,改为“上汽集团”。

8.4.3 买入股票的成本/总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本/总额	20,332,853,454.43
卖出股票的收入/总额	21,788,802,283.50

注:“买入金额”或“买入股票成本”、“卖出金额”或“卖出股票收入/总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,840,000.00	1.57
4	其中:政策性金融债	99,840,000.00	1.57

5	企业短期融资券		--	--	--
6	中期票据		--	--	--
7	可转债		--	--	--
8	其他		--	--	--
9	合计		99,840,000.00	1.57	
8.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细					
			金额单位:人民币		
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120245	12国债45	1,000,000	99,840,000.00	1.57
8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细					
基本基金报告期内未有资产支持投资。					

8.8 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。

9. 投资组合报告附注

9.1 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。

9.2 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。

9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,620,689.90
2	应收证券清算款	23,647,154.12
3	应收账款	
4	应收利息	451,186.40
5	应收申购款	745,542.00
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	32,464,572.50

8.9.4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可转换债券。

8.5 期末前十名股票中流通受限情况的说明				
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	323,840,000.00	5.10
注：本基金截至2012年12月31日持有的因公允价值计量可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布重大影响的消除后，经交易所批准复牌。				
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，投资组合报告中数字之和与报告合计可能存在尾差。				
9. 期末基金份额持有人户数及持有人结构				
<p>§ 9.3 基金份额持有人信息</p>				份额单位(亿)

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		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
692,606	9,802.12	255,099,878.07	3.76%	6,533,905,492.62	96.24%
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况					
项目		持有份额占总份额比例		占基金总份额比例	
基金管理人公司所有从业人员持有本基金		162,399.84		0.0024%	
注：期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0					

§ 10 开放式基金份额变动		单位: 份
基金合同生效日(2007年4月13日)基金份额总额	9,884,799,607.98	
本报告期初基金份额总额	8,636,211,911.60	
本报告期基金总申购份额	404,048,958.67	
减:本报告期基金总赎回份额	2,251,255,499.58	
本报告期基金净申购份额		
本报告期末基金份额总额	6,789,005,370.69	

§ 11 重大事件提示

11.1 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

1.1.3基金管理人、基金托管人因下列事项发生诉讼或仲裁的,由基金管理人承担相关法律责任:

基金托管人:

基金托管人、基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

1.1.4基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

1.1.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金无发生改聘为审计的会计师事务所情况。

报告年度应付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为138,000元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限为6年。

1.1.6管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚及处分情况

报告期内,管理人、托管人及其高级管理人员、基金从业人员、托管人的高级管理人员受行政处罚或处分。

1.1.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

1.1.7.1基金租用证券公司交易单元用于股票投资及佣金支付情况

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	
瑞银证券	2	10,067,182,124.05	24.02%	8,475,072.39	23.60%	
东方证券	1	7,988,142,616.96	18.66%	6,981,446.66	19.44%	
中信国际	2	4,905,574,206.33	11.70%	4,254,593.24	11.85%	
中国国际	2	3,748,775,039.95	8.94%	3,212,453.81	8.94%	

中证100	1	3,203,221,972.37	7.64%	2,697,312.10	7.51%
申银万国	1	3,185,877,183.33	7.60%	2,749,580.97	7.66%
中金公司	1	2,544,537,361.66	6.07%	2,097,601.68	5.84%
华泰证券	1	1,151,114,716.81	2.75%	2,012,923.83	5.66%
民生证券	1	1,116,125,968.35	2.66%	900,299.88	2.56%
上海证券	2	1,112,240,243.63	2.65%	938,865.72	2.61%
民生证券	1	314,177,032.01	0.75%	1,007,758.75	2.81%
海通证券	1	236,341,251.71	5.53%	278,015.83	0.77%
华泰联合	1	218,331,005.59	0.62%	219,596.65	0.61%

注：以上数据按市场公允价值计算，以扣除由中证证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券登记结算费用后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：
 (1) 资本金雄厚，信誉良好。
 (2) 财务状况良好，经营行为规范。
 (3) 内部管理规范，严格，具备健全的内控制度。
 (4) 具备基金业务所需的高素质的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
 (5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告和及时有效的信息服务。
 3. 交易单元的选择程序：
 (1) 本基金管理人定期召开评议会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元就选择进行评议，确定选用交易单元名单。
 (2) 本基金管理人定期召开交易单元评议会议，通报基金托管人。
 (3) 2012年度新增和续签券商、海通证券、上海证券、中信证券、民生证券，共计5个席位；无新增席位。
 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况
 金额单位：人民币元

券名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国银证券	9,679,171.00	100.00%	300,000,000.00	50.00%	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银国际	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	300,000,000.00	50.00%	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—

上海证券	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-

上投摩根基金管理有限公司
二〇一三年三月二十九日