

年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值3%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	600720	祁连山	185,457,890.28	3.83
2	600028	中国石化	182,745,608.95	3.77
3	600628	中国人寿	177,524,325.04	3.66
4	600031	三一重工	170,726,779.61	3.53
5	600019	宝钢股份	170,890,547.06	3.53
6	601398	工商银行	168,246,437.79	3.47
7	601061	中国太保	158,187,678.54	3.27
8	000898	被服股份	144,806,970.52	2.99
9	600030	中信证券	138,205,001.97	2.85
10	000401	冀东能源	128,754,511.99	2.66
11	601857	中国石油	125,664,381.90	2.59
12	000983	西山煤电	125,434,437.47	2.59
13	600837	海通证券	119,621,458.35	2.47
14	600858	海螺水泥	115,616,395.09	2.39
15	600005	武钢股份	112,343,539.22	2.32
16	600117	西宁特钢	109,565,748.36	2.26
17	600808	马钢股份	105,569,735.88	2.18
18	000157	中联重科	98,411,324.38	2.03
19	601669	中国电力	95,701,568.13	1.98
20	601100	恒立液压	81,675,066.64	1.69

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

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	376,758,564.92	7.78
2	600448	保利地产	322,290,722.86	6.65
3	600883	金隅股份	311,708,863.24	6.43
4	002146	荣盛发展	283,681,429.53	5.86
5	000718	苏宁环球	249,463,684.19	5.15
6	600675	中华企业	208,291,889.43	4.30
7	000031	中粮地产	173,775,421.91	3.59
8	000932	华菱钢铁	167,874,511.01	3.47
9	601398	工商银行	163,065,260.87	3.38
10	000019	宝钢股份	162,449,047.38	3.35
11	600028	中国石化	158,194,679.21	3.27
12	000761	宝钢股份	129,266,732.09	2.67
13	600010	包钢股份	127,559,618.69	2.63
14	000918	凯撒旅	123,604,209.85	2.55
15	000898	被服股份	122,315,250.51	2.52
16	600688	S·石化	120,104,104.75	2.48
17	601857	中国石油	119,544,953.97	2.47
18	600808	马钢股份	103,627,681.42	2.14
19	600173	卧龙电气	103,583,403.69	2.12
20	600005	武钢股份	102,125,384.02	2.11

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

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(成交)总额	5,027,566,020.98
卖出股票的收入(成交)总额	5,470,032,380.34

注：“买入金额”或“买入股票成本”，“卖出金额”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金报告期内苏宁环球股份有限公司（简称：苏宁环球，股票代码：000718）于2011年12月28日公布其收到中国证监会《调查通知书》，《调查通知书》主要内容为公司涉嫌内幕信息披露违规。根据《证券法》有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。随后，苏宁环球于2011年12月29日对被中国证监会立案调查的情况进行公告说明，公司因为“广州高新区白鹤潭合作开发项目信息未及时公告、内幕信息披露违规”事项。2012年8月29日，苏宁环球收到中国证监会立案调查的《调查终结告知书》，主要内容为：调查事项已经调查终结。决定对公司涉嫌信息披露违法违规案结案处理，对公司及有关当事人不予行政处罚。对对上述股票投资决策程序的说明：本基金管理人及投资苏宁环球前严格执行了对上市公司的调研、内部研究等程序，投资计划审批符合投资决策流程，上述股票根据股票审批流程进行买入，未发现内幕交易，由研究员跟踪并分析。上述事件发生后，本基金管理人及上市公司进行了进一步了解和沟通，认为上述事项未对上市公司财务状况、经营成果和现金流量产生重大的实质性影响，因此，没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

其余九名证券的发行主体均未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。

8.9.2 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范围。

8.9.3 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	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.08		
5	应收申购款	2,440,300.58		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	3,761,881.95		

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

8.9.6 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。

9.1 期末本基金份额持有人户数及持有本基金的情况

份额单位：份				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	-		
2	应收证券清算款	1,205,822.29		
3	应收股利	-		
4	应收利息	115,759.		