

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	002038	双鹭药业	79,833,735.87
2	600068	葛洲坝	72,609,105.72
3	600079	人福医药	71,576,857.30
4	600292	九龙电力	66,164,130.59
5	600997	开滦股份	59,842,252.15
6	000639	西王食品	50,047,281.70
7	600320	振华重工	46,283,510.34
8	600009	上海机场	41,037,197.34
9	000983	上海煤电	39,252,724.17
10	000629	攀钢钒钛	38,489,611.76

11	000800	中国平安	37,237,314.25	1.78
12	002029	七匹狼	35,923,053.97	1.70
13	601166	兴业银行	34,587,013.39	1.64
14	601808	中海油服	33,619,722.00	1.59
15	002415	海康威视	33,048,640.46	1.57
16	000157	中联重科	32,920,736.09	1.56
17	600583	海油工程	32,230,187.82	1.53
18	600036	招商银行	32,058,288.76	1.52
19	600518	康美药业	29,670,348.27	1.41
20	600559	老白干酒	29,476,031.93	1.40

				金额单位:人民币
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	000422	湖北宜化	103,006,147.11	3.98
2	600031	三一重工	84,017,242.10	4.88
3	000037	冀中能源	83,416,099.47	3.98
4	600875	东方电气	66,007,818.91	3.27
5	000085	双汇发展	66,788,296.87	3.16
6	600535	天士力	54,574,313.65	2.59
7	600188	中国神华	49,496,606.50	2.34
8	600036	招商银行	49,050,664.63	2.32
9	600009	上海机场	41,312,189.43	1.96
10	600016	民生银行	39,009,223.64	1.85
11	600219	南山铝业	36,534,403.18	1.73
12	600348	阳光乳业	34,892,626.44	1.63
13	600157	永泰能源	34,373,445.67	1.65
14	000858	五粮液	32,005,792.32	1.52
15	000983	西山煤电	31,887,872.31	1.51
16	601117	中国化学	24,715,005.20	1.17
17	002336	人人乐	23,988,050.26	1.14

19	600600	青岛啤酒	22,918,933.45	1.09
20	600717	天津港	22,304,421.85	1.06

注：卖出金额按卖出成交金额/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	1,553,482,067.81
卖出股票的收入(成交)总额	1,569,057,936.00

注：买入股票成本、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

1	国家债券	48,785,000.00	2.97
---	------	---------------	------

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	中期票据	-	-		
7	可转换债	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	68,109,000.00	4.15		
8.6. 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					
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	119904	11贴现国债	500,000	48,785,000.00	2.97
2	1101084	11央行票据84	200,000	19,324,000.00	1.18
8.7. 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名的前五名权证投资明细					
本基金本报告期末未有权证。					
8.9. 投资组合报告附注					
8.9.1. 报告期末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半年受到公开谴责、处罚的情况。					
8.9.2 基金投资的前十名股票，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。					
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	买入返售资产	1,000,000.00			

2	应收证券清算款		51,190,289.67	
3	应收股利		-	
4	应收利息		890,740.26	
5	应收申购款		33,107.97	
6	其他应收款		-	
7	待摊费用		-	
8	其他		-	
9	合计		33,114,137.90	

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未持有流通受限的情况。

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
79,036	25,541.30	426,852,476.98 21.15%	1,591,829,838.10 78.85%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
----	-----------	----------

开放式基金	175,517.74	0.01%
单位:元		
基金合同生效日(2006年9月29日)基金份额总额	1,248,974,112.75	
本报告期初基金份额总额	2,025,612,005.96	
本报告期基金总申购份额	258,743,412.99	
减:本报告期基金总赎回份额	265,673,103.87	
本报告期基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	2,018,682,315.08	

**11. 重大事件揭示**

11.1. 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2. 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人重大人事变动如下:

2011年4月21日,中国证劵报、中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了 国泰基金管理有限公司高级管理人员变动的公告,经本基金管理人第七届董事会第九次审议通过,同意副总经理王斌先生自2011年10月离职。

2011年10月20日,本基金管理人于《中国证券报、上海证券报、证券时报》刊登了 国泰基金管理有限公司高级管理人员变动的公告,经本基金管理人第七届董事会第九次审议通过,同意副总经理李荣先生自2011年9月离职。

报告期内基金托管人的基金托管部门的重大人事变动如下:

2011年11月,根据证监会核准,中国银行股份有限公司受委托担任本基金高级管理人员高级管理人员职责,李荣先生不再担任本基金管理人中国银行股份有限公司受委托担任高级管理人员职责。

11.3. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼  
报告期内,本基金无涉及及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4. 基金投资策略的改变  
报告期内,本基金投资策略无改变。

11.5. 为基金进行审计的会计师事务所情况  
报告期内,为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为100,000.00元,目前的审计机构提供审计服务的年限为6年。

报告期内，基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总额比例	
申银万国	1	399,095,927.37	13.21%	339,996.73	13.45%	--
银河证券	1	38,511,311.08	1.27%	32,734.72	1.29%	--
中信建投	1	218,882,808.51	7.23%	177,843.51	7.03%	--
德邦证券	2	84,205,797.74	2.78%	68,417.61	2.71%	新增
高华证券	1	461,260,401.79	15.24%	392,069.78	15.51%	--
万联证券	1					--
中金公司	1	255,562,369.81	8.44%	207,646.77	8.21%	--
华泰证券	1					--
中航证券	1	939,132,261.62	31.02%	798,259.60	31.57%	--
瑞银证券	1	639,576,908.69	20.80%	511,533.40	20.23%	新增

4) 资质雄厚、信誉良好；

5) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

6) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；

40) 内部管理制度严格，具备健全的风险控制，并能满足基金运作高度保密的要求；

41) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，及时提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见，调整券商与调整原因，并经公司批准。

17.2.2 基金用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	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
申银万国	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—

德邦证券	-	-	-	-
高华证券	7,906,145.80	20.86%	80,000,000.00	4.49%
万联证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-
中航证券	29,988,000.00	79.14%	1,702,600,000.00	95.51%
瑞银证券	-	-	-	-

---