

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2%或前20名的股票明细

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	000895	双汇发展	231,352,975.30	6.55
2	000069	华侨城A	177,420,843.89	5.02
3	300058	五 浪 液	144,672,595.98	4.10
4	600690	青岛海尔	134,703,455.43	3.81
5	600809	山西汾酒	128,600,596.24	3.61
6	600467	好当家	111,052,968.72	3.14
7	000527	美的电器	109,798,380.26	3.06
8	600858	银座股份	93,897,724.54	2.66
9	002032	齐 尔 尔	93,769,046.33	2.66
10	600104	上汽汽车	90,149,532.45	2.55
11	600655	豫园商城	85,925,346.08	2.43
12	000076	新 希 望	83,012,212.92	2.35
13	002003	伟星股份	82,927,260.56	2.35
14	600519	贵州茅台	82,685,005.77	2.34
15	600600	青岛啤酒	77,268,851.09	2.19
16	600805	悦达投资	74,811,251.09	2.12
17	600887	伊利股份	72,600,439.38	2.06
18	600889	特变电工	72,735,250.14	2.05
19	002154	豫 兴 电 力	69,837,244.27	1.98
20	600415	小商品城	69,162,459.42	1.96

注:1、买入金额不含相关交易费用。
2、“上汽汽车”于2012年1月1日更名“上汽集团”。
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

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	600690	青岛海尔	138,020,467.03	3.91
2	601166	兴业银行	136,120,491.24	3.85
3	600000	浦发银行	103,799,633.90	2.94
4	601899	紫金矿业	96,214,554.15	2.72
5	600809	山西汾酒	89,929,794.63	2.55
6	600887	伊利股份	88,033,310.90	2.49
7	600085	悦达投资	79,330,631.44	2.25
8	600889	特变电工	78,890,815.25	2.23
9	600104	上汽汽车	76,630,368.92	2.17
10	000002	万科 A	75,060,056.32	2.13
11	600570	恒生电子	74,727,713.08	2.12
12	000024	招商地产	74,257,283.59	2.10
13	000028	一致药业	72,151,242.44	2.04
14	600713	南京医药	69,295,956.84	1.96
15	002161	远 望 谷	66,397,381.93	1.88
16	600467	好当家	65,480,612.21	1.85
17	601138	中国平安	64,290,131.66	1.82
18	601888	中国铁建	62,864,161.85	1.78
19	600869	三普药业	60,280,168.18	1.71
20	600694	大商股份	59,869,347.91	1.70

注:1、卖出金额不含相关交易费用。
2、买入股票成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额 4,631,068,309.19
卖出股票收入(成交)总额 4,684,581,048.02

8.5 期末按券种及债券品种分类的股票投资组合

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	31,741,541.00	1.26
2	央行票据	361,587,000.00	14.33
3	金融债券	172,049,000.00	6.81
4	企业债、政策性金融债	172,049,000.00	6.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,729,000.00	0.19
8	其他	-	-
9	合计	570,406,541.00	22.58

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

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值
1	1001047	10央行票据 47	1,000,000	98,890,000.00
2	1001079	10央行票据 79	1,000,000	98,640,000.00
3	1101028	11央行票据 28	1,000,000	96,730,000.00
4	1101082	11央行票据 82	700,000	67,627,000.00
5	080215	08国开债 15	500,000	50,880,000.00

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

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值
1	1001047	10央行票据 47	1,000,000	98,890,000.00
2	1001079	10央行票据 79	1,000,000	98,640,000.00
3	1101028	11央行票据 28	1,000,000	96,730,000.00
4	1101082	11央行票据 82	700,000	67,627,000.00
5	080215	08国开债 15	500,000	50,880,000.00

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

单位:人民币元				
序号	名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,065,681.15	-
2	应收证券清算款	-	9,894,679.50	-
3	应收利息	-	-	-
4	应收股利	-	-	-
5	应收申购款	-	164,361.86	-
6	其他应收款	-	-	-
7	待摊费用	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	18,914,223.83	-

8.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位:人民币元			
序号	债券代码	债券名称	公允价值
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00

8.9.5 期末前十名股票持仓集中度及持仓集中度明细

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	11国债逆回购 01	4,729,000.00	0.19

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位:人民币元		
---------	--	--