

8.3 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

1	000001	浦发银行	100,000	1,561,000.00	0.13
3	600309	烟台万润	100,000	1,561,000.00	0.13
3	601633	长城汽车	30,000	771,000.00	0.06
4	000538	云南白药	10,000	680,000.00	0.06
5	000963	华东医药	20,000	680,000.00	0.06
6	601117	中国化学	80,000	659,200.00	0.05
7	600585	海螺水泥	30,000	553,500.00	0.04
8	600108	亚盛集团	80,000	546,400.00	0.04
9	000783	长江证券	50,000	470,000.00	0.04
10	002428	云南铜业	60,000	469,200.00	0.04

注：以上数据来源于东方财富网，截至本财务报表批准报出之日。因四舍五入原因，可能导致合计金额与个别数据之和存在微小差异，以披露数据为准。
<http://www.csfund.com.cn/站点>

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动			
8.4.1 买入成本总额大于卖出证券收入总额且占期末资产净值2%以上的前20名的股票明细			
序号	股票代码	股票名称	金额单位:人民币元
		本期买入成本	占期初基金资产净值的比例(%)
1	601328	交通银行	20,739,000.00
2	000001	平安银行	18,077,668.66
3	601166	兴业银行	17,602,831.10
4	600000	浦发银行	16,299,984.69
5	601318	中国平安	15,694,555.70
6	000088	五粮液	15,636,826.80
7	600038	中国太保	6,764,261.29

8	600309	烟台万华	6,337,797.19	0.30
9	000519	烟台莱州	5,597,046.66	0.26
10	000002	万科A	4,811,946.89	0.22
11	600031	三一重工	4,276,081.14	0.20
12	601088	中国神华	4,081,199.63	0.19
13	000937	冀中能源	4,037,658.46	0.19
14	600858	银禧股份	3,859,952.46	0.18
15	601006	大秦铁路	3,746,000.00	0.18
16	601628	中国人寿	3,402,249.60	0.16
17	600123	兰花科创	3,336,298.12	0.16

18	000050	江铃汽车	3,174,803.00	0.15
19	600837	海通证券	2,474,255.72	0.12
20	002304	中联重科	2,357,719.94	0.13

8.4.2 基金累计买入金额超出前次基金净资产或期末净资产的股票明细

		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	占期初基金净资产净值的比例(%)
1	601328	交通银行	18,406,500.00	0.86
2	000001	平安银行	16,353,859.80	0.76
3	000858	五粮液	14,773,729.78	0.69
4	601318	中国平安	13,057,099.00	0.64
5	600900	浦发银行	13,369,000.00	0.62

6	601166	兴业银行	12,078,875.50	0.56
7	601601	中国太保	5,981,653.20	0.28
8	600519	贵州茅台	5,432,853.80	0.25
9	600002	万 华	5,358,500.00	0.25
10	600309	烟台万华	4,648,090.00	0.22
11	600031	三一重工	4,027,452.37	0.19
12	601008	中国神华	3,880,639.53	0.18
13	000937	冀中能源	3,665,587.59	0.17
14	600858	银禧股份	3,041,299.00	0.14
15	601628	中国人寿	3,093,921.15	0.14

16	000500	江汽汽车	3,091,554.49	0.14
17	601056	大秦铁路	2,985,000.00	0.14
18	600123	兰花科创	2,796,000.00	0.13
19	002304	洋河股份	2,564,006.65	0.12
20	600837	海通证券	2,551,000.00	0.13

8.4.1 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
买入股票成本(成交总额)	254,573,641.66
卖出股票收入(成交总额)	222,010,034.06

“买入股票成本(成交总额)”和“卖出股票收入(成交总额)”的金额按照买入、卖出股票的数量乘以买入、卖出股票的“买入金额”和“卖出金额”均摊计算,股票过户费按照成交金额乘以0.1%考虑,不考虑其他交易费用。

8. 期末按投资品种分类的债券投资组合			金额单位: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	70,035,000.00	5.67
3	其中:政策性金融债	70,035,000.00	5.67
4	企业债券	1,018,376,818.17	82.40
5	企业短期融资券	30,076,000.00	2.43
6	中期票据	111,780,000.00	9.04
7	可转换债券	131,201,400.00	10.62

8	其他	-	-	-	-
9	合计	-	1,361,469,218.17	-	110.16

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：人民币元					
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	126011	08石化债	1,280,000	122,880,000.00	9.94
2	110015	08石化转债	1,000,000	102,910,000.00	8.33
3	126008	08上汽债	804,130	77,992,568.70	6.31
4	120405	12农发05	700,000	70,035,000.00	5.67

[illegible]

		单位:人民币元
序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	21,605,698.28
3	应收股利	-
4	应收利息	20,242,532.50
5	应收申购款	72,326.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细			42,170,557.55	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	110015	石化转债	102,910,000.00	8.33
2	113002	广转转债	25,203,400.00	2.04

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

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋取最大利益,但承诺不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

9.1 期末基金份额持有人户数及持有结构		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		个人投资者	
		持有份额 比例	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
11,702	103,429.19	45,323	132.74%	1,165,005	109.86%
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		持有份额总数(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		519,907.49		0.04%	

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究岗位负责人持有本基金份额总量的数量区间为0份。		
2、本基金基金持有人持有本基金份额总量的数量区间为0份。		
§ 10 开放式基金份额变动		
基金合同生效日(2011年5月24日)基金份额总额	3,033,151,617.30	单位:份
本报告期初基金份额总额	2,092,059,351.04	
本报告期基金总申购份额	9,904,156.70	
减:本报告期基金总赎回份额	892,626,175.14	
本报告期基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	1,210,328,332.60	
§ 11 重大事件揭示		

11.1 基金管理人持有本基金份额的情况

11.2 基金管理人、基金管理人的专门基金托管部门的人事变动

11.3 基金管理人高级管理人员及重大人事变动情况

11.4 基金管理人于 2012 年 6 月 16 日发布关于基金托管人变动的公告，系因前任个人原因辞职，经董事会决议解聘其公司副总经理职务，并已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

11.5 基金托管人的变动情况

11.6 基金本期基金基金托管人曾变动

11.7 基金管理人、基金管理人的专门基金托管部门的人事变动情况

11.8 基金管理人、基金管理人的专门基金托管部门的人事变动

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作布置，肖遂宁先生辞去中国银行股份有限公司董事兼行长。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日上述事。

（四）基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼

11.4 本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。		
11.5 基金投资策略或策略有效。		
11.6 本报告期基金投资策略有效。		
11.7 为基金财产进行审计的会计师事务所情况		
11.7.1 基金管理人报告期内聘请的会计师事务所为普华永道会计师事务所有限公司,本报告期内无会计师事务所变更会计师事务所,本报告期无应付给会计师事务所的报酬为100,000.00元,已计提为基金服务业务。		
11.8 管理人、托管人及其高级管理人员有无妥善处理有关异常情况。		
基金管理人、托管人及其高级管理人员无违法违规情形/相关事宜。		
11.9 基金租用证券交易单元的有关情况		
11.7.1 基金租用证券交易单元并签订股票交易的情况		

券商名称	成交量	成交金额	占当期融资融券交易总额	佣金	占当期佣金总额
华泰联合证券	1	313,607,395.47	65.79%	272,491.03	66.51%
光大证券	1	102,240,107.26	21.45%	87,800.06	21.43%
华融证券	1	60,808,117.92	12.76%	49,407.24	12.06%

11.7.2 基金和信用证券交易与交易所进行债券和债券回购交易的情况

券商名称	交易金额 占当期 成交量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券交易总额	成交总额	占当期债券回购交易总额
华泰联合证券	1	1,486,963,280.46	75.79%	100,350,800,000.00	84.61%

金额单位：人民币元

中证大证券	1	35,663,615.82	22.20%	11,003,674,000.00	9.28%
中证中债	1	39,445,138.42	24.20%	7,244,753,000.00	6.11%

注：1、本计划选择投资经理的主要理由如下：

- ①研究实力较强，有固定的研究团队和研究人员，能及时了解并能为本计划提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向报告、个股分析报告等，并能根据基金投资的需要，提供专门研究报告；
- ②资历深厚，信誉良好；
- ③研究风格稳健，各项业务指标显示公司经营业绩优良；
- ④经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行的处罚；
- ⑤内部管理规范，严格，具备健全的内控制度，并能通过基金托管人实施有效监督；
- ⑥基金与基金托管人之间不存在任何利益冲突，交易清晰符合基金托管人基金托管行为证券投资基金提供全面、优质的信息服务。

本公司采用双易网交易系统的程序如下：

1. 研究机构和客户签订《双易网服务协议》并委托相关研究报告；
2. 研究机构和客户在需要有一定的时效性。及时性视服务情况和研究报告评价结果而定；
3. 研究报告完成后，双易网管理部门及时将研究机构的研究报告后，按照研究报告等级后，我司研究机构进行综合评价；
4. 及时性前，双易网符合考核条件，双方认为有必要继续合作时，经公司研究部审核后，我司研究机构和客户签订《双易网交易单元服务协议》，并办理基金交易单元交易单元使用手续。评价报告如不符合条件则不予签订；
5. 本公司每个月对客户签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能达到要求，则通知该机构限期整改，若整改后仍不能达到要求，则通知该机构停止使用该机构的双易网交易单元；
6. 交易单元使用协议期满后一年，到期若双方没有异议可自动顺延一年。
7. 我处向客户收取的交易单元交易单元的费用如下：

1) 本基金报告期内新增租用交易单元: 无

2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华创证券	深圳	1