

		单位:人民币元	
买入股票成本(成交)总额		1,649,783,033.23	
卖出股票收入(成交)总额		2,695,972,695.56	
注:买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额(成交价款乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。			
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合			
债券品种		公允价值	金额单位:人民币元 占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	267,844,000.00	3.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	528,219,000.00	6.98
	其中:政策性金融债	528,219,000.00	6.98
4	企业债券	80,804,000.00	1.07
5	企业短期融资券	449,988,000.00	5.94

6	中期票据	-	-	-
7	可转债	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	1,326,855,000.00	-	17.53

7.6 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：人民币元

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	120021	12附息国债21	1,000,000	100,200,000.00	1.32
2	120314	12进出14	1,000,000	99,680,000.00	1.32
3	130201	13国开01	1,000,000	99,450,000.00	1.31
4	100028	10附息国债28	1,000,000	98,750,000.00	1.30
5	120221	12国开21	900,000	90,846,000.00	1.20

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货，本期未持有股指期货。

7.1.0 投资组合回报附注

7.1.0.1 本报告期基金投资的前十名证券除中恒集团外，其他证券的发行主体未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。

广西柳州中恒集团股份有限公司于2012年7月2日受到上海证券交易所的公开谴责，决定给予广西柳州中恒集团股份有限公司公开谴责纪律处分，给予公司董事长郑建廷通报批评等公开谴责纪律处分。

本基金管理人相信，中国集团是一家愿意面对良好的公司，该处并不影响公司长期投资价值，而且公司估值水平相对具有一定的吸引力。本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序在较低价格区域对该公司股票进行了投资。

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,115,803.06
2	应收证券清算款	5,208,020.94
3	应收股利	3,934,961.24
5	应收利息	21,009,088.08
5	应收申购款	38,762.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,411.43
8	其他	-
9	合计	31,357,047.30

7.10.4 期末持有待于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

注：本基金所持前十名股票未存在流通受限的情况。

7.10.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

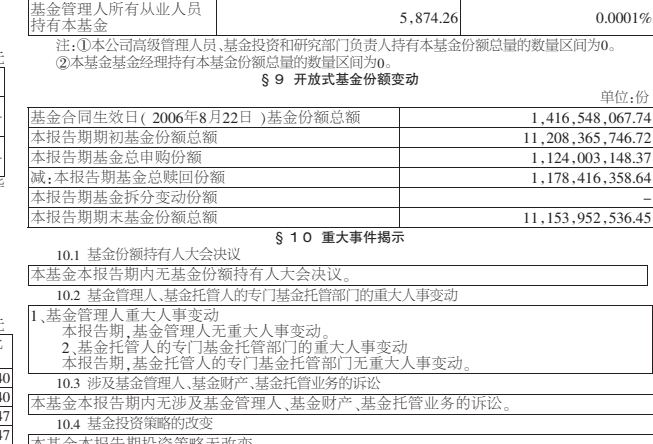
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位,单位

持有人户数 (户)	人均持有的基 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
568,632	19,615.41	1,404,790,610.98 12.59%	9,749,161,925.47 87.41%

8.2 期末基金管理人从业从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额(份)	占基金总份额比例
基金管理人从业人员持有本基金		



10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。					
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚或处罚等情况 本基金本期基金期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何行政处罚。					
10.7 基金运用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 基金运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 数量	成交金额	股票交易 成交占总额的比例	应付该券商的佣金	备注
华泰证券	1	865,416,773.51	19.98%	787,875.62	20.12%
光大证券	1	668,299,699.11	15.43%	608,417.08	15.54%
中信证券	1	338,675,463.63	12.23%	318,208.19	12.01%
中银证券	1	327,072,958.88	8.20%	318,208.69	8.65%

06	中信证券	2	363,669,668.58	8.40%	326,320.21	8.33%	--
06	长城证券	3	360,145,232.95	8.31%	327,875.32	8.37%	--
02	国信证券	2	318,024,249.90	7.34%	288,776.29	7.38%	--
01	民族证券	1	228,418,138.79	5.27%	202,127.56	5.16%	--
00	招商证券	2	223,481,061.82	5.16%	203,456.50	5.20%	--
00	长江证券	1	212,676,685.30	4.93%	194,532.31	4.97%	--
99	信达证券	1	115,888,708.58	2.68%	105,504.32	2.69%	新增
99	中金公司	1	67,684,343.83	1.56%	61,619.78	1.57%	--
00	渤海证券	1	--	--	--	--	--
00	方正证券	1	--	--	--	--	--
00	嘉德证券	1	--	--	--	--	--
00	华安证券	1	--	--	--	--	--
00	中银国际	1	--	--	--	--	--
00	东兴证券	1	--	--	--	--	新增
00	东方证券	1	--	--	--	--	--
02	国泰君安	2	--	--	--	--	--
00	国盛证券	1	--	--	--	--	--
00	中航证券	1	--	--	--	--	--

世纪证券	1	--	--	--	--
中信建投	1	--	--	--	--
申银万国证券	1	--	--	--	--
高华证券	1	--	--	--	--

注：1、报告期内租用证券公司席位的具体情况：
 本报告期內共新增2个交易单元，减少0个交易单元，截止本报告期末共计34个交易单元。
 2、专用席位的選擇標準和程序
 基金專人負責選擇代理本基基金買賣的證券經營機構，使用其席位作為基金的專用交易席位。選擇程序如下：

- 1、實力雄厚、信譽良好，註冊資本不少於3億元人民幣；
- 2、財務狀況良好，各項財務指標顯示公司經營狀況優良；
- 3、經營行為規範，最近兩年未发生重大违规行为，并得到中国证监会好评；
- 4、對簿管理規範，嚴格，具備健全的內控制度，并能滿足基金投資高度保密的要求；
- 5、準備基金運作所需的高效、安全的通訊系統，交易設施符合代理本基基金進行證券交易的需要，並能為本基提供全面的信息服务。

6 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准参考询价记录,基金管理人和其他证券经营机构签订委托协议,并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定,将询价记录及成交记录向所选定证券经营机构的有关机构、基金通迅处及该证券经营机构买卖证券的决策、支付的费用等进行书面披露。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

		债券交易		债券回购交易		权证交易	
		占当期债券成交总额的比例		占当期债券成交总额的比例		占当期权证成交总额的比例	
券商名称	成交金额		成交金额		成交金额		
华西证券	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-

金额单位:人民币元

银河证券	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-
长城证券	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-

华宝证券	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-