信息披露 Disclosure

基金管理人:中海基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一二年三月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在成 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚赋记载。误导性殊违改重大遗漏,并对其内容的真实性。准确性和灾整性承担

不明及连带的法律预定。本年度随告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金任意人中国二前银行股份有限公司 以下前称。工商银行,继报本基金合同股业于2012年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现,利润分配增配。财务会计据告,投资组合报告中内家。保证复城内客不存在虚赋记载。误导性殊违或者重大遗漏。基金管理人承证以诚实信用,勤励尽劳的原则管理和应用基金资产。但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其来来表现,投资有风险。投资者在作出投资决策师应户相侧该本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告编要独自年度报告正义。投资者被了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 2011年1月1日起至 2011年12月31日止。

②基金的介

2.2 基金产品说明	
投资目标	在世界能源短峽和中国经济增长模式向节约型转变的背景下,以能源为投资主题,重点关 具备能源竞争优势的行业和企业,精选个股,并结合积极的权重配置,谋求基金资产的长 稳定增值。
投資物格	1、一级对产业器;未准金根据原则和债券结战的相对规划;角壁。 (ASVIM. A S) Socks Valuation Model.) 依据至爱是参与作和股票债券估估比较进行一级资产配置 ASVIM 模型商业对股票比赛和债券市场的对估值申畴;决定股票的债券估价配置,投资 资金员会作为本基金管理人投资债务或产取其现有效。 (基本) 在现代的工程,是实现是实现的关系。 (是是这个为本基金管理人投资债务。) 在现代,对于成功的工程,是实现是实现的工程,是实现是实现的一个企业,是实现是实现的一个企业,是实现的一个企业,是实现是实现的一个企业,是实现是实现的一个企业,是实现是实现,是不是一个企业,是不是一个企业,是不是一个企业,是不是一个企业,是一
业绩比较基准	沪深 300 指数涨跌幅×65%+上证国债指数涨跌幅×35%
风险收益特征	本基金属混合型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种。本基金长期平均的 险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金,货币市场基金。

		PRETHINOSPINALIES I RAZINEE	Were that a for an arrange of the transfer of
2.3 基金管理。	人和悲金托管人		
Ij	ίB	基金管理人	基金托管人
名称		中海基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
	姓名	王莉	赵会军
信息披露负责	联系电话	021-38429808	010-66105799
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9788 021-38789788	95588
传真		021-68419525	010-66105798
2.4 信息披露	方式	·	

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-542,892,893.61	636,317,438.16	1,403,372,403.55
本期利润	-2,284,730,652.12	11,215,290.40	3,645,377,833.09
加权平均基金份额本期利润	-0.3546	0.0013	0.3691
本期基金份额净值增长率	-37.38%	0.49%	61.42%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份額利润	-0.4002	-0.0421	-0.1153
期末基金资产净值	3,665,229,847.76	7,072,600,542.81	8,419,578,465.89
期末基金份额净值	0.5998	0.9579	0.9532

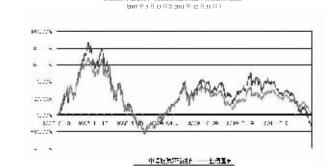
注 2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益) 加除相关费用后的余额。本期利润为本期已实

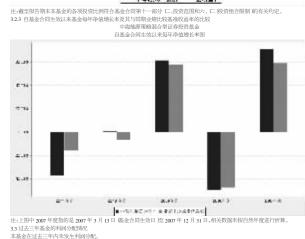
3.2 基金净值表现 3.2.1 基金份额争值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额争值增长率 ①	份额净值增长率 标准差②	业绩比较基准收 益率③	业绩比较基准收益率 标准差④	①-③	2-4
过去三个月	-17.43%	1.45%	-5.49%	0.91%	-11.94%	0.54%
过去六个月	-30.76%	1.23%	-14.70%	0.88%	-16.06%	0.35%
过去一年	-37.38%	1.20%	-15.51%	0.84%	-21.87%	0.36%
过去三年	1.57%	1.41%	24.33%	1.09%	-22.76%	0.32%
自基金合同生效 起至今	-11.96%	1.63%	4.22%	1.38%	-16.18%	0.25%

在上:日本金石四年358年7月 2007年3月13日 城金石町三公日 在2017年12月31日 注之本基金的場所技术基地等分享。2011数 659年上江国南指数 789。我已选取市场认同度很高的产深 300 指数,上证国旗指数作 计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为 30%—95%,在一般市场状况下,本基金股票投资比例会控制在65% 左右,像转投 比例控制在35% 左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重,以使业绩比较更加合

3.2.2 自基金合同生效以来基金份額累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 中海能源策略混合型证券投资基金 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图





4.1 基金管理人及基金经理情况

4.11 旅查管理人及环局理旅遊班經 基金管理人包绍 年 月18日成辽東、始终坚持"陳宋信用·勒德尼弗"的原则,严格履行基金管理人的责任和义务,依靠强大的投研 、规范的业务管理模式,严密科学的风险管理和内部控制体系,为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2011 年 12

§4 管理人报告

任本基金的基金经理 (助理)期 职务 证券从业年限 姓名 陶林健 010-05-05

注 1;上述任职日期,高任日期根据本基金管理人对外按露的任免日期填写。 注 2;证券从业的含文遵从厅业协会 征券业火业人员物管理办法 的相关规定。 註 3;陶林健先生于 2012年 1月 20 日展任本基金差全理。 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 基金管理人任报告期内严格遵守 伊华人民共和国证券投资基金法 及其他有关法律法规、截金合同 的规定、勤勉尽贵地为基金份额 持有人课来和选不存在册准基金的制持有人解述的行为,不存在进法违规或未履行基金合同承诺。 4.3 管理人对报告期公平交易情况的专项说明

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司 2011 年修订了《中海基金公平交易管理办法》,从投资决策内部控制,交易执 2制、行为监控和分析评估、监察稽核和信息披露四个方面对股票、债券的一级市场中购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公

.勿言年。 投资决策内都控制方面:(1)公司研究平台共享,基金经理和专户投资经理通过研究平台平等获取研究信息。(2)公司建立投资组合投资 信息的管理及保密制度,除分管投资副总及投资总监因工作管理的需要外,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.33 异常交易行为的专项说明 本报告期,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4 宮理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.1 报告期内基金的投资策略和业绩券明 2011年市场酸体呈现据落下跌败场局。沪等 20 指数全年下跌 25%。其中食品饮料。金融服务、房地产、公用事业、餐饮旅游跌幅相对较少。有色、电子、机械设备、信息设备、交运设备、商业贸易行业跌幅均超过 30%。从经济层面来看、今年的重要任务是控制通纸、央行调控手段规组、资币政策持续紧缩、宏观经济增速用短回席。 本基金今年的基础仓位主要集中在建筑建材、层药、商业贸易等行业上、对金融行业配置的偏差以及相对高的仓位使得业绩相对比较基准表现不佳。

^{008.718}に 44.2 报告期内基金的业绩表現 截至 20.11年 12月 31日 - 本基金份額浄值 0.5998 元 (常計浄值 0.9098 元)。报告期内本基金浄值増长率为-37.38%。低于业绩比较基准 80.5514.4

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

万过2011年的洗礼,2012年市场机会将明显增加,去年面临的最艰难形势已经开始有所改善。CPI趋势持续回落,虽然期间有可能还 有反复。信贷将有所被免准备全单具备连续下端的空间。这些金线货币把给维持在一个指定的次年,但我们对经济基本的改建的保持证 概念度、目前大部分行业仍处于快速支格存战器中,能否发展出新的经济污染是我们追切关注的。对于配置方面,我们将重点关注联估值的 运筹税款,能取出被制铁金额设计关系公司,对于成长时代中心

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所

中海能源策略混合型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值 的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型。假以及参数的适当性发表神底意见并以具报告。定价服务机构按照通信合同处理模型的 粉条,比中、基金管理人为了确价估值了作的合体程序,建立了而多价值值了作成等成件的信候推算。从,组成人员但任务经长、风险控制 位监监察赔帐负责人及基金会计负责人等,成员均具有多年基金从业经验,且具有风险。合规。会计方面的专业经验。负责估值核算的小组 成员中不包括投资总监及基金经理。但对于非活跃投资品种,投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内,参与估 值旅程各方之间元重大利益和安。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 根据法律法规以及本基金合同的相关规定,本基金在本报告期不满足有关基金分红条件,不进行利润分配。

根据法律法则以及平益至日。中四月10个年代。
\$5.年管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遗埂守信情况申明
2011年,本基金托管人遗埂守信情况申明
2011年,本基金托管人应对中海能源海路混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守 征券投资基金法)及其他法律法规和基金合同
的有关规定,不存在任同则就基金份额特有人利益的行为,完全尽限尽贵地规定了基金长管人应尽的义务。
5.2 托管人对报告期内本基金运作遗址守住。净值计算,利明分配等情况的规则
2011年,中海能波等部基金仓型准税收益金的管理—人一中基金管理有限公司在中海能源等旅混合型证券投资基金的投资运作。基金资产净值计算。基金份衡申畴赎回价格计算。基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作产格按跟基金合同均原定进行。本报告期外,中途能源等或器合型证券投资基金大进行利润分配。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的表录,准确的定理发表意见
本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和波索的中海能源策略混合型证券投资基金之2011年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内等实法、准确和完整。
\$6 审计报告

"第47年年度报告中财务指标,净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内等实法、准确和完整。
\$6 审计报告

§7年度财务报表

资产	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		332,842,087.17	345,659,642
结算备付金		7,318,065.65	4,510,248
存出保证金		10,055,485.83	4,084,677
交易性金融资产		2,801,202,521.56	6,734,256,979
其中:股票投资		2,751,202,521.56	6,395,062,863
基金投资		=	
债券投资		50,000,000.00	339,194,11
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产		-	
买人返售金融资产		385,600,448.40	
应收证券清算款		140,456,097.22	
应收利息		369,764.20	3,380,80
应收股利		-	
应收申购款		30,324.32	1,095,66
递延所得税资产		=	
其他资产		-	
资产总计		3,677,874,794.35	7,092,988,02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		=	
交易性金融负债		=	
衍生金融负债		-	
卖出回购金融资产款		-	
应付证券清算款		=	
应付赎回款		158,133.11	2,611,98
应付管理人报酬		5,016,279.11	9.067.56
应付托管费		836,046.53	1,511,26
应付销售服务费		=	
应付交易费用		3,484,465.07	4.046.17
应交税费		=	
应付利息		=	
应付利润		-	
递延所得税负债		=	
其他负债		3,150,022.77	3,150,48
负债合计		12.644.946.59	20,387,48
所有者权益:			
实收基金		6,111,023,373.59	7,383,204,19
未分配利润		-2,445,793,525.83	-310,603,65
所有者权益合计		3,665,229,847.76	7,072,600,54
负债和所有者权益总计		3,677,874,794.35	7,092,988,02

本 似音朔:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12			单位:人民币:
项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-2,143,990,178.72	186,187,288.74
1.利息收入		16,155,258.16	20,400,571.06
其中:存款利息收入		5,121,117.33	6,362,048.56
债券利息收入		6,814,418.84	12,481,462.93
资产支持证券利息收入		-	=
买人返售金融资产收入		4,219,721.99	1,557,059.57
其他利息收入		-	=
2.投资收益 锁失以 ""填列)		-418.892.641.04	790,499,564.14
其中:股票投资收益		-445,457,190.64	749,441,963.54
基金投资收益		-	=
债券投资收益		-11,099,587.01	4,609,298.73
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	=
股利收益		37,664,136.61	36,448,301.87
3.公允价值变动收益(损失以""号填列)		-1,741,837,758.51	-625,102,147.76
4.汇兑收益 假失以 ="号填列)		-	=
5.其他收入 锁失以 ""号填列)		584,962.67	389+301.30
减:二、费用		140,740,473.40	174,971,998.34
1.管理人报酬		81,683,900.05	113,041,986.70
2.托管费		13.613.983.29	18,840,331.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		44,943,626.31	42,487,120.73
5.利息支出		-	100,188.34
其中:卖出回购金融资产支出		-	100,188.34
6.其他费用		498,963.75	502,371.48
三、利润总额(亏损总额以""号填列)		-2,284,730,652.12	11,215,290.40
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以""号填列		-2,284,730,652.12	11,215,290.40

会计主体:中海能源策略混合型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日			
			单位:人民币
项目	2011:	本期 年1月1日至2011年12月	31日
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	7,383,204,194.89	-310,603,652.08	7,072,600,542.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利 润)	-	-2,284,730,652.12	-2,284,730,652.12
三、本期基金份額交易产生的基金净值变动数 铮值 减少以""号填列)	-1,272,180,821.30	149,540,778.37	-1,122,640,042.93
其中:1.基金申购款	170,636,864.71	-21,348,312.42	149,288,552.29
2.基金赎回款	-1,442,817,686.01	170,889,090.79	-1,271,928,595.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净 值变动 (争值减少以""号填列)	-	=	=
五、期末所有者权益(基金净值)	6,111,023,373.59	-2,445,793,525.83	3,665,229,847.76
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		31 ⊞
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,833,018,722.81	-413,440,256.92	8,419,578,465.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 体期利润)	-	11,215,290.40	11,215,290.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 铮值 减少以""号填列)	-1,449,814,527.92	91,621,314.44	-1,358,193,213.48
其中:1.基金申购款	299,226,040.12	-23,609,237.65	275,616,802.47
2.基金赎回款	-1,749,040,568.04	115,230,552.09	-1,633,810,015.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净 值变动 争值减少以""号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	7,383,204,194.89	-310,603,652.08	7,072,600,542.81

18CIPHCE/別对形成积的34DA的开办。 本报告7.1至74.财务报表由下列负责人签署, 基金管理公司负责人;黄鹏,主管会计工作负责人;宋宇,会计机构负责人;曹伟

7.4.1 基金基本情况
中海能测策级器合型证券投资基金(以下简称 本基金" \(\mathbf{k}\) 本基金管理有限公司依照 中华人民共和国证券投资基金法》,证券投资基金运作管理办法规有关注规规定。经中国证券监管管理委员会证监基金产 \(\mathbf{b}\) (2007 \(\mathbf{k}\)) 1 5 关于问意中海能源策略混合型证券投资基金设立的 批复 | 然准算集。
本基金为契约型开放式,存结期限不定,基金管理系员会证监基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行;有关基金筹集文件已按规 定申申国证券监管理委员会备案。基金合用于 2007 年 3 月 13 日生效,沒日的基金份规能源 9 7.45 102.563.26 份。
不基金的排水相是按照规括部于 2006 年 2 月 15 日颁布的 企业会计准则"从中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的 征券投资基金会计模型。分别为13 本基金信息中国国运会允许的基金行业求务操作的有关规定编制。
7.43 海根金会计准则解释以及其他相关规定(以下合称 企业会计准则"》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的 征券投资基金会计核要业务指引》,本基金信息中国国运会允许的基金行业求务操作的有关规定编制。
7.43 海根金会计准则对的会计根表编辑了企业会计准则对比值在关键。
7.43 海根金会计准则应由计模表编辑了企业会计准则对比值本经验。
7.44 本组和国际公司

7-4.3 建阻企业会计准则及共使有关规定的严明 本基金在本报告期内的会计报表递循了企业会计准则及其他有关规定。 7-4.4 本报告期所采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致的说明 本基金在本报告期所采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

根据财政部、国家税务总局财税字 2002 128号 关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知 3. 财税 2004 78号 关于证券投资基金税收政策的通知 3. 财税 2005 11号 关于调整证券 侵票 交易印花税税率的通知 3. 财税 2005 102号 关于极息红利个人所得税有关政 策的通知入财税 2005]103 号 侯于授权分置试点改革有关税收改策问题的通知入财税 2007 84 号 侯于调整证券 侵票)交易印花税税率的 通知]及其他相关税务法规和实务操作。主要税项列示如下:

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

公司的保证。13年28年28年28日27-2008年4月24日之前按照 0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自 2008年4月24日起至 2008年9月18日止按 0.1%的举缴纳。自 2008年9月19日起版金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不配收股票交易印花税。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司(中海基金")	基金管理人、直销机构
工商银行	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司(中海信托")	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司 (国联证券")	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司(法国洛希尔银行")	基金管理人的股东
华英证券有限责任公司	基金管理人股东的控股子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易			4:1	颁单位:人民i
	本期 2011年1月1日至2011年1:	2月31日	上年度可比期 2010年1月1日至2010年	间
关联方名称	成交金額	占当期股票成 交总额的比例	成交金額	占当期股票 成交总额的 比例
国联证券	391,304,707.34	1.35%	400,138,652.26	1.46
and the same of th				

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。 7.4.8.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券交易。 7.4.8.1.4 债券回购交易

本期 2011年1月1日至2011年12月31日 关联方名称 成交金額 成交金額

7.4.0.13 (92.2.19.2.4)(7.713)	70.00			金额单位:人民币
关联方名称		2011年1月1日	本期 至 2011 年 12 月 31 日	
大联刀石桥	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
国联证券	332,609.54	1.37%	332,609.54	1.37%
关联方名称		上年 2010年1月1日	度可比期间 至 2010 年 12 月 31 日	
大权力名称	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
国群证券	340.113.95	1.48%	_	_

注:1.还用金按市场用金率计算。已非渝中国证券总过结算有限责任公司收取的由券商来和的证券结 沪市古家安全制企业需求企业额。1.16、1—1股票交易经主带。1里交易证管营一证券结算风险基金 浑市求新交易用金。股票成交金额。1.16、1—1股票交易经主带一股票交易证管营一证券结算风险基金 原业业务行会市边基并证券经营机构。使用从简位作为基金专用交易简位的标准。与其签订的简位租 商业条款订立的。其少本基金提供业券投资研究成果市场信息服务。

7.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	81,683,900.05	113,041,986.70
其中:支付销售机构的客户维护费	17,013,697.74	19,905,011.99

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	13,613,983.29	

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Haban 25%(当年天教 4) 为信日应文付的基金长管费。 2)前一日的基金资产净值)基金长管费每日计算。逐日累计至每月月底,接月支付.
7.4.8.3 与庆康方进行银行间间业市场的债券 俭回陶)交易。
本基金在报告期及上年度可比顺间未与关联方进行银行间间业市场的债券 俭回陶)交易。
7.4.8.4 名头康乃救办本基金的情况
7.4.8.4 3人康庆为政办本基金的情况
4.8.4.1 报告期内基金管理人运用围有资金投资本基金的情况
本报告期内及上年度可比则间基金管理人来运用围有资金投资本基金的情况
本报告期内及上年度可比则间基金管理人来应用贴有资金投资本基金的情况
本报告期末及上年度实施基金管理人之外的迁使失败方次投资本基金的情况
本报告期末及上年度实施基金管理人之外的迁使失败方次投资本基金的情况

				単位:人氏	
关联方名称	本 2011年1月1日至		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	期末余額	当期利息收人	期末余額	当期利息收入	
工商银行	332,842,087.17	4,763,204.19	345,659,642.64	6,207,024.	
		行股份有限公司保管,并按银	l行间同业利率计息。		
7.4.8.6 本基金在承	峭期内参与关联方承销证券的	勺情况			

		2011	本期 年1月1日至2011年1	12月31日		
Visiting to the	transfer (b. ett.)	rende da da	at a desirable	基金在承销期内买人		
关联方名称	证券代码	引 证券名称 发行	发行方式	数量(单位:股/张)	总金额	
国联证券	-	-	-	-	-	
国联证券	-	-	-	-	_	
国联证券	-	-	-	-	_	
国联证券	-	-	-	-	-	
		2010	上年度可比期间 年 1 月 1 日至 2010 年 1	12月31日		
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买	ž.	
大联刀石阶	III. SP.1 CHS	HE ST-STATE	2011/JTC	数量 (单位:股/张)	总金额	
国联证券	300094	国联水产	分销	500	7,190.00	
国联证券	601801	皖新传媒	分销	52,792	622,945.60	
国联证券	601288	农业银行	分销	49,157,868	131,743,086.24	
国联证券	601818	光大银行	分銷	87,000	269,700.00	

7.4.9 期末 2011 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券 代码	证券名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 単位:股)	期末 成本总額	期末 估值总額	备注
601336	新华保险	2011-12- 09	2012-03- 16	新股认 购流通 受限	23.25	27.87	34,976	813,192.00	974,781.12	-
7.4.9.2 期末持有的暂时停降等流通受限股票										

本基金本报告期末未持有暂时停弊等流通受限股票。 7.49.3 服式商券正回喷送的中作为抵押的债券 7.49.3 服订前方肠骨连回喷 本基金本报告期末无银行回市场债券正回购余额。因此无抵押债券。 7.49.3 之受易市市场债券正回购余额。因此无抵押债券。 本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。因此无抵押债券。

81期末基金资产组合情况

			金额单位:人民币元
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	2,751,202,521.56	74.80
	其中:股票	2,751,202,521.56	74.80
2	固定收益投资	50,000,000.00	1.36
	其中:债券	50,000,000.00	1.36
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	385,600,448.40	10.48
	其中, 平断式同胞的平人返售金融资产	_	_

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 %)
A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采掘业	84,221,000.00	2.30
С	制造业	949.523.345.38	25.91
C0	食品、饮料	198,803,963.76	5.42
C1	纺织、服装、皮毛	33,693,556.80	0.92
C2	木材、家具	=	-
C3	造纸、印刷	6,226,910.10	0.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	29,695,437.62	0.81
C5	电子	50,134,772.90	1.37
C6	金属、非金属	129,433,323.23	3.53
C7	机械、设备、仪表	221,049,960.99	6.03
C8	医药、生物制品	280,485,419.98	7.65
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,135,588.49	0.41
E	建筑业	206,206,771.36	5.63
F	交通运输、仓储业	18,262,080.00	0.50
G	信息技术业	227,279,349.05	6.20
Н	批发和零售贸易	749,452,299.76	20.45
I	金融、保险业	85,093,328.42	2.32
J	房地产业	43,299,871.83	1.18
K	社会服务业	190,290,078.57	5.19
L	传播与文化产业	59.071.547.20	1.61
M	综合类	123,367,261.50	3.37
	All	2 751 202 521 56	75.06

股票代码 股票名称 123,367,261.50

9,000,000 108,090,000.00 94,841,945.37

8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

	序号	股票代码 股票名称 本期累计买人金额		占期初基金资产净值比(%)	
	1	600519	贵州茅台	512,460,948.60	7
	2	600827	友谊股份	437.833.721.61	6
	3	600970	中材国际	380,799,155.44	5
	4	601899	紫金矿业	350,486,481.50	4
	5	000937	冀中能源	334,765,134.41	4
Ī	6	600511	国药股份	321,928,461.20	4
	7	601992	金隅股份	304,055,894.67	4
Ī	8	000061	农产品	298,236,933.59	4
	9	000799	酒鬼酒	282,969,922.74	4
	10	601857	中国石油	268,468,743.41	3
	11	600831	广电网络	223,539,639.08	3
	12	600631	百联股份	223,529,126.83	3
	13	600778	友好集团	214,051,826.95	3
	14	601117	中国化学	211,791,331.81	2
	15	000786	北新建材	203.923.403.28	2
	16	000962	东方钽业	199,413,550.20	2
	17	000612	焦作万方	199,065,829.81	2
	18	600557	康缘药业	195.986.113.00	2
	19	002161	远望谷	187,087,724.86	2
	20	600157	永泰能源	184,530,019.44	2
	21	002146	荣盛发展	180,131,241.90	2
	22	600655	豫园商城	177,268,090.78	2
	23	600597	光明乳业	171,093,735.37	2
	24	600188	兖州煤业	168,939,546.74	2
	25	000983	西山煤电	164.033.048.40	2
	26	600704	物产中大	163,388,187.47	2
	27	600392	太工天成	156,287,214.77	2
	28	600153	建发股份	152,298,960.61	2
	29	600801	华新水泥	151,599,270.51	2
	30	600779	水井坊	150,373,981.71	2
	31	002106	莱宝高科	146.335.439.79	2
	32	600176	中国玻纤	144,612,101.20	2
	33	000009	中国宝安	143,586,126.21	2
L	34	600581	八一钢铁	142,859,915.91	2
	35	600050	中国联通	141,797,356.31	2

注:本报告期内,累计买人股票金额是以股票成交金额(成交单价乘以成交数量)列示的,不考虑相关交易费用。

股票名称 本期累计卖出金额 用初基金资产净值比例 %) 000983 601899 紫金矿业 277,913,461.89 601699 238,572,116. 202,695,348.0 600831 600547 山东黄金 188,201,199.2 酒鬼酒 165,248,453.4 600704 161,071,223.8 600801 153,788,989. 600655 147,316,921.6

8.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

JOJ COLONIA	HAT WALL MENTIN				14,009,042,900.43
卖出股票的	收人 威交)总额				15,466,353,788.60
	告期内,买人股票成本总额和卖出股票收人总额 按债券品种分类的债券投资组合	都是以股	票成交金額 成交单价乘以成交数量 冽	示的,	不考虑相关交易费用。
					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			-	-
	甘由,政策性全職條			_	_

债券名称 数量 (张)

本基金和民间加末共特有资产支持证券。 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特有权证。

10,055,485.8

6.9.4 纳木环市马克 1.4 在欧洲亚州市农区苏宁亚 本基金本报告期末末特市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

本基金由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

可能存在尾差。 §9 基金份额持有人信息

基金合同生效日 2007年3月13日 基金份額 170,636,864.7

6,111,023,373.59

§11 重大事件揭示

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 本报告期内,本基金管理人免去陈浩鸣先生总经理职务,聘请陈浩鸣先生担任董事长职务,聘请黄鹏先生担任总经理职务。 本报告期内,增聘许定晴女士为本基金基金经理。 本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

金额单位:人民币元

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

1,201,999,767 2,130,503.0 1,198,740. 692,900,784.0 563,277.3 1,612,744,831.4 492,554,889.60 418,669.4 4,694,211,302.1: 798,165,359.7 3,604,290,614.5 3,027,641. 1,949,848,040.6 1,657,361.1 236,206,864.58 200,771.8 1,167,710,853.6 948,768.82 1,845,094,613.3 1,549,514.44

注2. 本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。 注3. 上述佣金按市场佣金率计算,已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的争额列示

生 4;以上数据由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

	(情券交易	b	回购交易		权业交易		
券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金額	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	-	-	2,157,600,000.00	9.76%	=	-	
中信证券	-	-	=	-	=	-	
中银国际	-	-	=	-	=	-	
长江证券	-	-	=	-	=	-	
国联证券	-	-	300,000,000.00	1.36%	=	-	
齐鲁证券	-	-	=	-	=	-	
招商证券	1,207,668.27	0.13%	-	-	-	-	
高华证券	-	-	5,050,000,000.00	22.83%	-	-	
东方证券	-	-	-	-	-	-	
华泰联合证券	4,759,068.90	0.50%	2,500,000,000.00	11.30%	-	-	
光大证券	9,995.54	0.00%	1,750,000,000.00	7.91%	=	-	
安信证券	-	-	700,000,000.00	3.16%	=	-	
中金公司	-	-	5,350,000,000.00	24.19%	=	-	
国泰君安	-	-	=	-	=	-	
平安证券	-	-	-	-	-	-	
国信证券	893,026,291.76	93.80%	4,210,000,000.00	19.03%	=	-	
万联证券	-	-	80,000,000.00	0.36%	=	-	
瑞银证券	-	-	=	-	=	-	
东兴证券	-	-	-	-	-	-	
广发证券	53,015,492.00	5.57%	20,000,000.00	0.09%	-	-	
银河证券	-	-	=	-	=	-	
海通证券	-	-	-	-	-	-	
东吴证券	-	-	-	-	-	-	
渤海证券	-	-	-	-	-	-	
中投证券	-	-	-	-	-	-	
华泰证券	-	-	=	-	=	-	
-A-unutor de							