基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2012年3月30日

汇添富优势精选混合型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富优势精选混合
基金主代码	519008
前端交易代码	519008
后端交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年8月25日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,460,843,104.93份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	投资具有持续竞争优势的企业，分享其在中国经济持续高速成长背景下的长期优异业绩，为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用适度动态资产配置策略，同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股，并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是精选股票，并且进行积极风险控制的混合型基金，本基金的风险和预期收益比较均衡，在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-192,678,760.00	286,403,368.66	1,430,936,520.17
本期利润	-945,844,660.15	318,211,125.54	2,028,188,222.08
加权平均基金份额本期利润	-0.6276	0.1785	1.0364
本期基金份额净值增长率	-24.32%	8.05%	52.07%
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额利润	-0.1118	0.1717	0.4681
期末基金资产净值	2,835,784,517.79	4,330,420,098.70	5,777,075,321.59
期末基金份额净值	1.9412	2.7207	3.0123

注：1、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）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

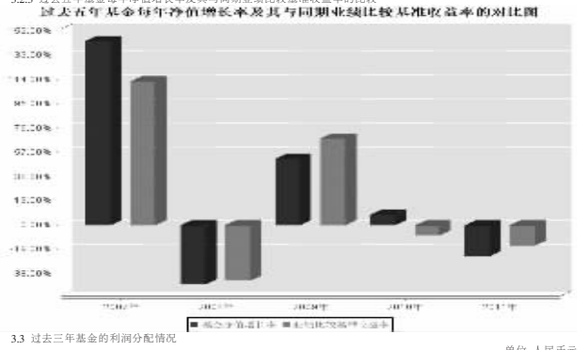
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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	-6.22%	1.06%	-6.02%	0.98%	-0.20%	0.08%
过去六个月	-15.27%	1.04%	-15.40%	0.95%	0.13%	0.09%
过去一年	-24.32%	1.08%	-16.30%	0.91%	-8.02%	0.17%
过去三年	24.36%	1.33%	22.83%	1.17%	1.53%	0.16%
过去五年	63.82%	1.55%	15.84%	1.50%	47.98%	0.05%
自基金合同生效日起至今	324.38%	1.48%	113.11%	1.40%	211.27%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

注：本基金建仓期为本基金的（基金合同）生效之日（2005年8月25日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	1.500	101,471,877.12	134,935,861.04	236,407,738.16	
2010	4.700	440,647,443.86	399,519,460.37	840,166,904.23	
2009	-	-	-	-	
合计	6.200	542,119,320.98	534,455,321.41	1,076,574,642.39	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理有限公司成立于2005年2月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京分公司、南方分公司和汇添富资产管理（香港）有限公司（China Universal Asset Management（Hong Kong）Company Limited）。

截至2011年12月，汇添富资产管理规模接近600亿元人民币，是业内最早一批获得QDII资格、最早一批开展专户业务、首批获得RQFII资格的基金管理公司，同时也是全国社会保障基金的投资管理人。经过七年的发展，公司已成为业务布局完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌日益确立，具有较强综合竞争实力的资产管理公司。

2011年，汇添富大力发展公募基金业务，全年新发7只基金，分别是汇添富保本混合基金、汇添富社会责任股票型基金，汇添富可转换债券基金、汇添富黄金及贵金属基金、汇添富深证300ETF基金及其联接基金，汇添富信用债债券基金。目前，公司共管理19只证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征的产品线。

汇添富始终坚持"以企业基本分析为立足点，挑选高质量的证券，把握市场脉络，做中长期投资布局，以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益"这一长期价值投资理念，并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2011年，汇添富整体投资业绩继续保持行业优秀。

2011年，汇添富专户业务快速发展，在全年市场大幅下跌的背景下，13只专户组合当年实现了正收益，专户业务综合实力和竞争力进一步提升。

2011年，汇添富国际业务取得重大突破，成为业内第一批获得RQFII资格、第一批获得RQFII外汇额度、第一批获得香港证监会产品批文、第一家在港正式发行RQFII产品的基金公司。

2011年，汇添富正式开展社保组合管理，是业内少数几家在权益类和固定收益类产品上同时和社保展开合作的基金公司之一。

2011年，汇添富电子商务业务实现跨越式发展，公司推出全国首张货币市场基金直接支付消费账单的信用卡——"添富信用卡"。该卡集信用卡消费信贷功能和基金投资功能于一体，开创了"货币基金支付消费账单"的新模式，在"2012 WORLD营销大会"中，"添富信用卡"营销项目获得2011年度金赢销奖中的最佳互动创新奖。

2011年，汇添富着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司积极开展"添富通行证升级"、"定投计算器"等活动，得到广大客户的大力支持和踊跃参与。同时，公司进一步大力开展"投资者见面会"、"添富之约"客户沙龙、投资者"走进汇添富"和"走进上市公司"等全方位的投资者服务与教育活动。

2011年，汇添富持续推进社会慈善事业，积极探索企业慈善公益事业新形式，不断丰富公益活动新内容，持续推进公益项目长期建设。在上海汇添富公益基金会的整体平台下，汇添富积极与社会组织、企业团体合作，举办了众多有影响力的活动，提升了基金业的整体社会形象。

展望2012年，基金行业仍将面临巨大的压力和挑战。汇添富全体员工将进一步发扬"正直、激情、团队、客户第一、感恩"的企业价值观，不畏挑战，不惧困难，以更加积极的心态，大力深化变革，全面提升公司核心竞争力，为实现汇添富基金中长期发展目标打下更加坚实的基础，为中国基金业的繁荣发展做出贡献。

2011年，汇添富凭借稳健的经营管理和优秀业绩，荣获权威机构评选的多个奖项：

1、汇添富优势精选混合基金荣获《中国证券报》评选的"2010五年持续优胜混合型金牛基金"。

2、汇添富基金荣获《上海证券报》评选的2010年度"金基金创新公司奖"。

3、汇添富策略回报股票基金荣获《上海证券报》评选的2010年度一年期"金基金主动型股票基金奖"。

4、汇添富基金荣获《证券时报》评选的"2010年度十大明星基金公司奖"。

5、汇添富策略回报股票基金荣获《证券时报》评选的"2010年度股票型明星基金奖"。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏竞	本基金的基金经理、汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2007年10月3日	-	8年	国籍：中国。学历：上海海事大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任北京中国运载火箭技术研究院助理工程师、上海申银万国证券研究所高级研究员、上投摩根基金管理有限公司高级行业研究员、博时基金管理有限公司高级行业研究员。2006年9月加入汇添富基金管理有限公司，任高级行业分析师，2007年3月6日至2007年10月7日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理，2007年10月8日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，2007年12月17日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，2008年7月8日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王栩	本基金的基金经理、汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理	2010年2月5日	-	9年	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004年11月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业研究员，2009年11月30日至2010年2月4日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理，2010年2月5日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，2010年9月21日至今任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为混合型基金，股票投资对象主要是"持续竞争优势企业"，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年对于A股投资者而言是非常困难的一年。宏观方面，国内经济增速见顶回落，GDP增速由2010年的10.4%下降至9.2%，而且呈逐季下滑的态势。居高不下的通胀压力迫使国内货币政策进一步紧缩，M2增速由2010年的19.7%降至13.6%，存、贷款基准利率三次上调。国际方面，欧债危机由希腊、爱尔兰、葡萄牙等欧元区外围国家向意大利、西班牙等核心国家蔓延，并对全球的风险资产价格都产生显著的负面影响。与此同时，A股市场仍继续大规模扩容，2011年的融资总额达到6818亿元，对市场整体的估值水平造成进一步的压力，在多重压力之下，A股市场2011年大幅下跌，沪深300指数下跌了25.0%，中证500指数下跌33.8%，有色金属、机械、汽车、建材等强周期性行业以及IT、农业、医药等估值泡沫严重的成长性行业是下跌的重灾区。

回顾2011年的基金运作，本基金在资产配置和行业配置上都存在较多不足之处。首先是股票资产比例基本上保持在中等偏高的水平，四个季度的仓位分别是90.8%、81.5%、79.3%、77.7%，尤其是二季度欧债危机升级之后减仓力度不足。其次是股票资产中中小盘成长股的总体比例偏高，对于IT、医药、化工等行业中部分估值明显偏高的个股没有及时卖出。2011年比较成功的操作是：一季度大幅增持金融行业；二季度增持煤炭、食品饮料行业，减持有色金属行业；三、四季度减持煤炭行业。总结2011年，本基金较好地贯彻了基金契约和原有的投资理念，致力于自下而上精选具有持续竞争优势的企业做中长期布局，但对于国内外经济、金融环境以及A股市场估值体系所发生的变化应对不足，对基金持有人造成较大亏损，在此深表歉意。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年本基金的年收益率为-24.32%，同期业绩比较基准收益率-16.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2012年，本基金的观点如下：第一，2012年投资者将面临比2011年更为困难的经济环境。中国经济转型势在必行，其困难和持续时间都不可低估，经济增速将从9%以上下降一个台阶，在某些时期内甚至存在向下超调的可能性。第二，政府在财政政策上会趋于积极，但沉重的地方政府债务限制了政府的扩张能力，而货币政策和产业政策的放松程度可能成为A股市场的关键变量。第三，A股市场在经历持续5年的快速扩容之后其估值体系可能会向成熟市场靠拢，目前盈行的追逐基本面趋势的成长股投资方法将面临挑战。综合上述因素，A股市场2012年依然比较困难，但其中蕴含着的投资机会可能会多于2011年。本基金主要关注以下方面的投资机会：

第一，经济波动是企业的试金石，优秀的企业能够利用经济调整期大幅提高自身的竞争力，从而实现更可持续的长期高增长，正在到来的经济转型为投资者提供了发掘这类成长型企业的绝好机会。第二，目前A股市场整体估值水平并不高，货币政策和产业政策如果能够有较大程度放松，价值股有望获得估值提升的机会。第三，经济转型一般意味着会有新的支柱性产业出现，这将为投资者带来板块性的投资机会。

秉承过去六年多的投资理念，本基金在新的投资年度将继续遵循挑选可持续、有质量增长个股的一贯原则，为持有人创造价值，期待交出一份令投资者满意的答卷。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券股份有限公司	1,564,302,934.28	22.18%	3,195,049,303.75	21.09%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券股份有限公司	38,727,477.00	27.00%	43,228,229.90	21.39%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	750,000,000.00	27.17%	-	-

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	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
东方证券股份有限公司	1,304,257.72	22.19%	150,355.11	25.12%

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	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
东方证券股份有限公司	2,627,195.51	20.87%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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	52,379,784.09	68,770,421.64
其中：支付销售机构的客户维护费	5,421,700.91	6,331,668.51

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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	8,729,964.05	11,461,736.88

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金2011年度和2010年度均未与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	51,118,833.51	51,118,833.51
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	51,118,833.51	51,118,833.51
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.50%	3.21%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本年度末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

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

单位：人民币元

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	395,870,674.33	2,609,659.43	243,403,879.16	3,901,174.16

注：由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金2011年度及2010年度在承销期内均未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2011年12月30日	重大事项停牌	34.09	2012年1月4日	34.75	520,000	14,015,054.55	17,726,800.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,208,137,449.91	77.65
	其中：股票	2,208,137,449.91	77.65
2	固定收益投资	220,545,000.00	7.76
	其中：债券	220,545,000.00	7.76
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	397,696,184.41	13.98
6	其他各项资产	17,409,820.77	0.61
7	合计	2,843,788,455.09	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
B	采掘业	175,248,246.32	6.18
C	制造业	966,645,056.59	34.09
C0	食品、饮料	448,025,089.47	15.80
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	39,019,496.11	1.38
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	33,267,915.00	1.17
C7	机械、设备、仪表	82,822,004.19	2.92
C8	医药、生物制品	363,510,551.82	12.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	219,447,623.68	7.74
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	76,807,409.60	2.71
H	批发和零售贸易	245,361,807.44	8.65
I	金融、保险业	393,406,556.04	13.87
J	房地产业	80,078,597.64	2.82
K	社会服务业	51,142,152.60	1.80
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,208,137,449.91	77.87

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000869	张 裕A	1,416,323	152,821,251.70	5.39
2	002081	金 螳 螂	3,720,826	131,307,949.54	4.63
3	000858	五 粮 液	3,699,784	121,352,915.20	4.28
4	600036	招商银行	9,446,912	112,134,845.44	3.95
5	600519	贵州茅台	493,354	95,365,328.20	3.36
6	600079	人福医药	4,202,219	80,976,760.13	2.86
7	000001	深发展A	4,575,261	71,328,318.99	2.52
8	300039	上海凯宝	3,265,305	67,853,037.90	2.39
9	600887	伊利股份	3,091,699	63,163,410.57	2.23
10	601601	中国太保	3,099,957	59,550,173.97	2.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.99fund.com 网站的年度报告正文。

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

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	601288	农业银行	137,208,258.18	3.17
2	601699	潞安环能	105,875,641.72	2.44
3	600016	民生银行	104,096,282.00	2.40
4	600970	中材国际	100,184,462.30	2.31
5	601166	兴业银行	99,759,202.82	2.30
6	600720	祁连山	98,835,587.87	2.28
7	601899	紫金矿业	86,897,265.64	2.01
8	300039	上海凯宝	84,163,189.83	1.94
9	600000	浦发银行	80,134,311.65	1.85
10	000629	攀钢钒钛	77,281,600.50	1.78
11	600688	S上石化	76,157,261.63	1.76
12	000968	煤气化	72,029,469.50	1.66
13	600805	悦达投资	69,549,323.06	1.61
14	601601	中国太保	68,759,620.62	1.59
15	600887	伊利股份	66,929,198.72	1.55
16	600208	新湖中宝	66,865,259.37	1.54
17	000718	苏宁环球	64,455,866.51	1.49
18	600809	山西汾酒	61,831,544.03	1.43
19	000937	冀中能源	61,537,874.44	1.42
20	000708	大冶特钢	59,690,034.77	1.38

注：本项"买入金额"按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：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	000629	攀钢钒钛	217,363,151.24	5.02
2	000937	冀中能源	165,381,009.08	3.82
3	601288	农业银行	113,869,708.54	2.63
4	600016	民生银行	112,120,000.00	2.59
5	600720	祁连山	94,483,339.37	2.18
6	002007	华兰生物	90,297,028.07	2.09
7	600575	芜湖港	89,826,706.84	2.07
8	002215	诺普信	84,937,733.81	1.96
9	002415	海康威视	80,933,757.37	1.87
10	000961	中南建设	73,719,471.57	1.70
11	601808	中海油服	72,205,765.17	1.67
12	600000	浦发银行	69,372,259.02	1.60
13	002326	永太科技	69,115,491.04	1.60
14	600395	盘江股份	67,788,075.68	1.57
15	002128	露天煤业	67,500,037.97	1.56
16	002081	金螳螂	67,387,636.19	1.56
17	600805	悦达投资	63,238,024.92	1.46
18	600251	冠农股份	62,970,435.82	1.45
19	600050	中国联通	59,612,163.82	1.38
20	600688	S上石化	59,201,343.72	1.37

注：本项"卖出金额"按卖出成交金额填列，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

买入股票成本（成交）总额	3,075,426,375.39
卖出股票收入（成交）总额	3,983,903,285.83

注：本项"买入股票成本"和"卖出股票收入"均按买卖成交金额填列，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

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	110,044,000.00	3.88
	其中：政策性金融债	110,044,000.00	3.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,093,000.00	1.06
6	中期票据	-	-
7	可转债	80,408,000.00	2.84
8	其他	-	-
9	合计	220,545,000.00	7.78

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	110015	石化转债	800,000	80,408,000.00	2.84
2	020206	02国开06	600,000	59,934,000.00	2.11
3	110242	11国开42	500,000	50,110,000.00	1.77
4	1181133	11汉江CP01	300,000	30,093,000.00	1.06

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资前十名证券五粮液（000858）于2011年5月27日受到证监会行政处罚，该上市公司于2009年9月被证监会立案调查之初，我司即对其可能产生的影响进行过研究评估，认为此事件并不影响其经营业绩，不会对其投资价值造成较大影响。本基金一直重仓持有该股，并经过合理的投资决策授权审批。

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	存出保证金	1,345,021.31
2	应收证券清算款	12,651,985.82
3	应收股利	-
4	应收利息	3,237,270.31
5	应收申购款	175,543.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,409,820.77

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：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	110015	石化转债	80,408,000.00	2.84

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

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
164,227	8,895.27	256,514,594.60	17.56%	1,204,328,510.33	82.44%

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

|