



信息披露 Disclosure

2012年6月7日 星期四

D39

第(D38)页

十一、基金的投资组合报告 (未经审计)

本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责任。
本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定,已于2012年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中所有财务数据截至2012年3月31日 (未经审计)。
1.截至2012年3月31日基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,878,547,992.36	92.26
	其中:股票	3,878,547,992.36	92.26
2	固定收益投资	3,000,300.00	0.07
	其中:债券	3,000,300.00	0.07
	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	227,237,148.92	5.41
6	其他资产	95,105,380.70	2.26
7	合计	4,203,480,821.98	100.00

截至2012年3月31日按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农林牧渔、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,027,391,463.96	48.44
C0	食品、饮料	647,284,865.72	15.47
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	435,878,274.90	10.42
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	214,824,772.26	5.13
C7	机械、设备、仪表	478,244,354.94	11.43
C8	医药、生物制品	251,159,196.14	6.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	267,030,915.20	6.38
H	批发和零售业	270,437,086.78	6.46
I	金融、保险业	190,974,995.81	4.56
J	房地产业	972,859,889.33	23.25
K	社会服务业	138,134,010.08	3.30
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	11,719,531.20	0.28
	合计	3,878,547,992.36	92.68

截至2012年3月31日按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600143	金发科技	28,396,161	335,538,661.41	8.01
2	600048	保利地产	28,003,202	316,156,150.58	7.55
3	000869	张裕A	3,076,449	289,863,024.78	6.93
4	000527	美的电器	20,700,000	271,584,000.00	6.49
5	000002	万科A	30,000,000	248,400,000.00	5.94
6	600498	烽火通信	8,725,755	233,152,173.60	5.57
7	600694	大商股份	7,660,841	216,648,583.48	5.18
8	002152	广电运通	9,688,718	206,660,354.94	4.94
9	000858	五粮液	5,499,872	180,615,796.48	4.32
10	002146	荣盛发展	17,246,444	178,328,230.96	4.26

截至2012年3月31日按券种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	010203	02国债(3)	30,000	3,000,300.00	0.07

注:上述债券为本基金本报告期末持有的全部债券。
4.截至2012年3月31日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。
5.截至2012年3月31日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
本基金本报告期末未持有权证投资。
8.报告期末投资组合报告附注
4.1.报告期内,本基金投资的前十名证券之一五粮液股份有限公司,因涉及多个信息披露事项被深交所公开谴责并记入诚信档案,曾于2011年5月28日受到中国证监会的行政处分。本报告期内,五粮液股份有限公司未再披露违法违规事项。
对于该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为五粮液白酒估值合理,成长长期稳定且业绩有保证,该股票进入到符合风控标准价值内,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和内部制度的规定。
报告期内本基金投资的前十名证券中的其它证券中没有发生涉及被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。
4.2.报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
4.3.报告期内本基金

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	110012	存出保证金	-	1,930,270.48	-
2	110013	应收证券清算款	-	92,915,712.92	-
3	110014	应收股利	-	-	-
4	110015	应收利息	-	138,160.01	-
5	110016	应收申购款	-	121,237.29	-
6	110017	其他应收款	-	-	-
7	110018	其他负债	-	-	-
8	110019	其他	-	-	-
9	110020	合计	-	95,105,380.70	-

8.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
9.报告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的情况。
4.4.报告期内报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,投资组合报告中数字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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来业绩,投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
1.本基金基金合同生效后,投资组合偏离度与跟踪误差的监控报告如下表所示。(投资组合偏离度按照基金合同约定计算)

	净值增长率1	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
2007年4月28日至2007年12月31日	44.90%	1.78%	31.54%	1.70%	13.36%	0.08%
2008年1月1日至2008年12月31日	-53.07%	2.25%	-53.40%	2.27%	0.33%	-0.02%
2009年1月1日至2009年12月31日	75.48%	1.66%	67.59%	1.54%	7.89%	0.12%
2010年1月1日至2010年12月31日	-6.57%	1.43%	-8.46%	1.19%	1.89%	0.24%
2011年1月1日至2011年12月31日	-21.70%	1.20%	18.00%	0.98%	-3.70%	0.22%
2012年1月1日至2012年3月31日	-1.26%	1.51%	3.80%	1.14%	-5.06%	0.37%
自基金合同生效至2012年3月31日	-13.80%	1.70%	-19.97%	1.59%	6.17%	0.11%