

（上接D18版）
（四）会计师事务所和经办注册会计师

| | | | |
|-------|-------|-------|-------|
| 名称 | 名称 | 名称 | 名称 |
| 办公地址 | 办公地址 | 办公地址 | 办公地址 |
| 法定代表人 | 法定代表人 | 法定代表人 | 法定代表人 |
| 电话 | 电话 | 电话 | 电话 |
| 经办会计师 | 经办会计师 | 经办会计师 | 经办会计师 |

四、基金名称: 德华优质增长股票型证券投资基金
五、基金类型: 股票型基金
六、基金的投资目标: 本基金的投资目标是:通过投资于兼具优质增长性和估值吸引力的股票,在严格控制投资组合风险的前提下力求取得基金资产的长期快速增长。

七、基金的投资方向
 本基金投资于具有良好流动性的金融工具。在正常市场条件下,投资组合的范围:股票(A股)及监管机构授权投资的其他市场股票等;债券(国债、金融债、企业债、可转债等);短期金融工具(央行票据、债券回购等)以及现金资产;法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种。基金管理人可在履行适当程序后,可以将纳入投资范围。

八、基金的投资策略和投资组合
 在价值创造主导的投资理念指导下,本基金的投资策略以自下而上的股票精选为主,同时也可借助性的主动类资产配置,在投资组合中加入债券资产以降低组合资产组合的系统性风险。本基金充分发挥“自下而上”的主动选股能力,通过定量的业绩归因分析深入发掘主动回报的相关信息,适当加大选股因素的关注度,借助投资组合优化技术实现投资风格与收益的最佳匹配。

本基金与股票型基金,在一般情况下,股票投资在基金资产中将保持相对较高的比例。在投资中,本基金首先通过质地良好、估值合理的公司,并从中精选具备优质增长特征或处于优质增长阶段的公司进行投资;在债券投资中,重点关注到期收益率、流动性较好以及价值被低估的债券。

九、基金的风险收益特征
 目前,我国经济正处于加速化进程阶段,居民消费结构升级,经济全球化和工业化推动的产业结构调整的过程中。本基金管理人认为,在未来较长时期内,我国经济仍将保持稳定、良好的发展趋势。

在宏观经济长期增长的大背景下,将有大量的企业从中受益并获得快速增长。本基金将投资于具有“优质成长性”的上市公司,以分享中国经济成长带来的巨大投资机会。

根据企业生命周期理论,企业在运营和发展过程中将历经产生、成长、成熟和衰退等几个不同质的阶段,同时表现出各自不同的业绩增长特征。不同类型企业的业绩具备不同的中长期发展趋势,长期业绩特征以及同宏观经济和行业属性的联动特征。
 从长期上,企业的成长被划分为“周期类”、“成长类”和“稳定类”等三种类型。在实践中,因该分类考察的维度过于单一,即只考虑了业绩增长与宏观经济、行业景气度的联动性,因而在指导股票投资方面难以达到预期效果。

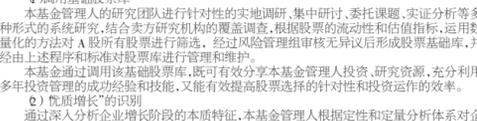
为此,本基金管理人经过长期研究和实践,引入两个维度对企业类型进行划分:①企业生命周期;②宏观经济的联动性。
 从上述两个维度出发,根据稳定性和定量指标,将企业增长划分为以下五类类型:超常增长(反转型)、增长-稳定类、增长-周期类、成熟-周期类、成熟-防御类。

股票价格表现并不完全于企业业绩表现,企业业绩增长也未必相应推动股票价格上升。本基金管理人认为,只有如下四种类型增长方式或增长阶段,才会对股票价格形成实质性的驱动:①超常增长(反转型)企业;②稳定-增长类企业;③成长类企业;④处于高成长阶段中的:⑤增长-周期类企业及⑥成熟-周期类企业。

业绩特征划分,纳入上述增长类型或阶段的企业即被定义为“优质增长”企业。本基金的目标即在于有效识别和选择具备优质增长特征或处于优质增长阶段的企业,准确评估其价值,并在严格控制风险的基础上取得基金资产的长期增值。

本基金在构建投资组合时,在强调企业价值和成长因素的基础上,尤其注重公司增长的优质性和持续性。

本基金股票投资的具体流程图如下图所示:



① 用基础股票库
 本基金管理人的研究团队进行针对性的实地调研、集中研讨、委托课题、实证分析等多种形式的系统研究,结合卖方研究机构的覆盖调查,根据股票的流动性和估值指标,运用数学化的方法对A股所有股票进行筛选,经过风险管理组审核无异议后形成股票基础库,并经由上述程序标准对股票库进行管理维护。

本基金通过调用该基础股票库,既可有效分享本基金管理人投资、研究资源,充分利用多年投资管理的成功经验和技能,又能有效提高股票选择的针对性和投资运作效率。

② 优质增长的识别
 通过深入分析企业增长阶段的本质特征,本基金管理人根据稳定性和定量分析体系对企业增长类型进行划分和划分,包括如下五类:增长-稳定类、增长-周期类、成熟-周期类、成熟-防御类、超常增长(反转型)企业。

在进行企业类型划分时,引入关系企业基本面的两个重要维度:①企业所处的生命周期;②企业业绩同宏观经济的联动性。
 在生命周期维度上,根据稳定性和定量指标评估,企业可被划分为“超常增长(反转型)”、“增长”、“成熟”和“衰退”等四种类型,其中,“衰退”类企业由于不具备投资价值而被排除在研究视野之外。

在联动性维度上,根据稳定性和定量指标评估,企业可被划分为“稳定”、“周期”和“防御”等三种类型。
 通过引入上述两个维度以及相应的分析指标,对企业进行综合评价,确定企业所属的增长类型及所处的增长阶段。

③ 三步曲”式分析和评级,构建基金股票库
 经过识别和选取“优质增长”公司以后,将对其股票投资价值进行定性、定量评估和

评级。
 在该阶段,本基金将严格遵循“基本面(F)→估值(V)→市场预期(E)”层级式分析和研究,即依次经过基本面增长趋势识别和评估、估值分析、市场对本基金管理人评估结论的认可程度三个层次的考察,确认具备优质增长特征或处于优质增长阶段的企业。当然,所考察层次的次序并非一成不变,而是一个动态的、紧密衔接的过程。
 本基金管理人认为,基本面是公司价值的基础,这是任何投资决策的前提,必须做详尽分析;估值是否具有吸引力是投资决策的核心,必须做出合理的评估;之所以选择市场预期这一指标,是因为对基金经理人认为股票价格表现并不同步于企业业绩表现,企业业绩增长也未必相应推动股票价格上升,而其中的关键是谁的评估是否已经对此作出了反应,因此评价市场预期成为衡量公司估值是否到位的先行指标。

本基金管理人将综合这三个指标做投资决策,这样有助于避免“价值陷阱”,即避免因仅根据单一估值指标作出买入或卖出的决策。

④ 构建股票投资组合
 基于基金股票库的确定,本基金将遵循自下而上的选股原则,根据股票增长类别的评估和划分,及其综合评级结果,进行投资组合的构建。本基金将重点投资于增长-稳定类、增长-周期类、成熟周期类和超常增长(反转型)“优质增长”的企业股票。

2. 债券投资策略
 在个券选择方面,本基金将基于对信用质量、期限和流动性等因素的深入研究,重点关注具备以下特征的债券:较高到期收益率、较高当期收入、价值被低估、预期信用质量将改善、期权和债权突出,或者属于创新型品种而价值尚未被市场充分发现。
 本基金在债券投资策略:采取久期调整、收益曲线配置和类属配置等积极投资策略,发现、确认和利用市场失衡所创造的组合增值机会。

① 久期调整
 久期调整的依据是对基准利率水平的预期,当预期基准利率下降时,适当增加组合久期,以有效获得债券的资本利得;当预期基准利率上升时,缩短组合久期,以规避债券价格下降的风险。基于基准利率变动对债券组合投资价值具有决定性的作用,本基金将久期调整作为获取稳定债券收益的重要手段。

本基金将深入分析和研究利率走势和收益曲线结构,为积极债券投资提供依据。市场利率的变化与宏观经济和货币政策息息相关,研究利率走势具有很强的客观性和现实可行性。② 债券投资组合的战略配置思路。

收益-风险曲线配置是指在确定组合久期后,进一步预测未来收益曲线可能的变化形态,进而确定采用集中配置或梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行配置,以在不同期限债券的相对价格变化中获利。一般而言,当预期收益率曲线变陡时,将采用集中策略;而当预期收益率曲线变平时,将采用两端策略;梯形策略则是将组合平均分配在收益曲线不同的点上,一般在预期收益率曲线不变或轻微上移时采用。

③ 类属配置
 类属配置是指各市场估值及各债券种类之间的比例分配和调整。本基金将根据各市场、各券种的相对投资价值、流动性及信用风险,增持相对低估、价格将上升的类属,减持相对高估、价格将下降的类属,借以取得较高的总回报。

债券投资组合构建与调整,包括自上而下确定投资策略和自下而上两个券种选择相互结合的动态过程。

3. 大类资产配置策略
 本基金为股票型基金,以股票投资为主,大类资产配置并非本基金的核心策略。但是,鉴于我国股市仍具备新兴市场成长性仍然较快的特征,本基金将投资于适度的主动型股票资产,在股票类资产系统性风险水平显著变动的及时进行配置调整,以降低股票资产的系统性风险的影响。

在实施大类资产的配置时,考察的因素主要包括:宏观面趋势、股市估值水平、市场预期以及市场因素等。
 除以上考虑因素外,本基金在进行大类资产配置时,也将利用基金管理人在长期投资管理过程中所积累的经验和,有效应对突发事件、财报季节效应以及市场非有效外溢效应所形成的短期市场波动。

④ 风险控制与资产配置
 本基金管理人借鉴国外风险管理成功经验,采用国际通行的风险管理方法实现风险的识别、度量和控制,通过调整风险结构,突出股票选择能力,并将投资管理的主观性风险控制到合理的水平。

本基金在投资中将利用Barra多因子模型优化投资组合,将与行业、投资风格密切相关的非主观的风险因素控制在最低程度,借助主动投资于“优质增长”的企业股票获得超额收益。

九、业绩比较基准
 本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

十、基金的风险收益特征
 本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

十一、投资组合报告
 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。

基金托管人中信银行股份有限公司对本报告说明书中的基金投资组合报告和基金业绩数据进行了复核。

T 投资组合报告所载数据截至2012年3月31日(财务数据未经审计)。
 1.报告期末基金资产组合情况

| 名称 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 4,716,055,389.05 | 78.43 |
| 2 | 固定收益投资 | 4,716,055,389.05 | 78.43 |
| 3 | 金融资产投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 190,000,525.00 | 3.16 |
| 5 | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,104,192,308.52 | 18.36 |
| 7 | 其他资产 | 3,083,439.98 | 0.05 |
| 7 | 合计 | 6,013,331,662.53 | 100.00 |

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| A | 农林、牧、渔 | 83,833,416.45 | 1.42 |
| B | 采矿业 | 227,144,304.43 | 3.84 |
| C | 制造业 | 2,091,757,551.10 | 35.34 |
| D | 食品饮料 | 758,631,512.67 | 12.82 |
| E | 纺织服装 | - | - |
| F | 医药、生物 | - | - |
| G | 信息技术 | - | - |
| H | 房地产业 | - | - |
| I | 公用事业 | - | - |
| J | 有色金属 | - | - |
| K | 其他行业 | - | - |

公司2012-027号公告。
 特此公告。
 江苏霞客环保色纺股份有限公司董事会
 二〇一二年七月二十四日

证券代码:002015 证券简称:霞客环保 公告编号:2012-026
江苏霞客环保色纺股份有限公司关于召开2012年第二次临时股东大会的通知

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
 江苏霞客环保色纺股份有限公司(以下简称“公司”)第四届董事会第二十四次会议,决定于2012年8月8日(星期三)召开公司2012年第二次临时股东大会,审议董事会提交的会议议案,有关事项通知如下:

一、会议召开基本情况:
 1.会议召集人:公司董事会
 2.会议时间:2012年8月8日(星期三)上午10:00时,会期半天。
 3.会议召开方式:现场会议
 4.会议地点:江苏省江阴市徐霞客镇马镇东街7号公司会议室。

二、审议议案事项:
 1.审议《关于变更公司注册地址和经营范围的议案》
 2.审议《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》
 3.审议《关于修改公司章程的议案》
 4.审议《关于参与发行“区域集优中小企业集合票据”的议案》
 4.审议《关于提请股东大会授权董事会全权办理公司发行“区域集优中小企业集合票据”事宜的议案》

三、会议出席人员:
 1.公司董事、监事、高级管理人员、聘请律师、保荐代表人。
 2.截止2012年8月6日下午深圳证券交易所交易收市后,在中国证券登记结算公司深圳分公司登记在册的本公司股东或其授权委托人。
 四、会议登记日期:2012年8月7日(上午9:00时-11:00时;下午13:00时-15:00时)。
 五、会议登记地点:参加本次股东大会,请持本人身份证、股东帐户卡、持股清单等授权证明到公司登记;法人股东持营业执照复印件、法人授权委托书、本人身份证到公司登记。异地股东可用传真或信函方式登记,以上授权委托书委托书必须加盖2小时送达传真或传真公司证券部。
 六、会议登记地点:江苏霞客环保色纺股份有限公司证券部;请语登记地址:江苏省江阴市徐霞客镇马镇东街7号,公司证券部,信函上请注明“股东大会”字样,邮政编码:214406。

联系电话:0510-86520126
 传真:0510-86520112
 联系人:陈霞凤
 7.其他事项:出席会议股东的食宿费及交通费自理。
 附:授权委托书

江苏霞客环保色纺股份有限公司 董事会
 二〇一二年七月二十四日

江苏霞客环保色纺股份有限公司
 2012年第二次临时股东大会授权委托书

兹授权委托 先生/女士/代表本人 单位 出席江苏霞客环保色纺股份有限公司于2012年8月8日召开的2012年第二次临时股东大会,并代表本人对会议审议的各项议案按授权委托书的指示行使投票权,并代为签署本次会议需要签署的相关文件。

| 议案序号 | 议案内容 | 同意 | 反对 | 弃权 |
|------|--|----|----|----|
| 1 | 《关于变更注册地址和经营范围的议案》 | | | |
| 2 | 《关于修改公司章程的议案》 | | | |
| 3 | 《关于参与发行“区域集优中小企业集合票据”的议案》 | | | |
| 4 | 《关于提请股东大会授权董事会全权办理公司发行“区域集优中小企业集合票据”事宜的议案》 | | | |

附注:
 1.如欲对议案投同意票,请在“同意”栏内相应位置填上“√”;如欲对议案投反对票,请在“反对”栏内相应位置填上“√”;如欲对议案投弃权票,请在“弃权”栏内相应位置填上“√”。

2.授权委托书须复印,复印或扫描以上格式无效;每位委托须加盖单位公章。
 委托人签名: 受托人身份证号码:
 受托人股东帐户卡: 受托人持股数量:
 受托人签名: 受托人身份证号码:
 受托有效期限: 年 月 日至 年 月 日
 委托日期: 年 月 日

江苏霞客环保色纺股份有限公司
 2012年第二次临时股东大会授权委托书
 二〇一二年七月二十三日

证券代码:002015 证券简称:霞客环保 公告编号:2012-026
江苏霞客环保色纺股份有限公司第四届董事会第二十四次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
 江苏霞客环保色纺股份有限公司(以下简称“公司”)第四届董事会第二十四次会议于2012年7月16日在江阴市及无锡市同时召开,会议于2012年7月21日上午在公司会议室召开,会议应出席董事9名,实际出席董事9名,公司全体董事均亲自出席了本次会议,部分董事和高管列席了会议。会议由董事长陈建强先生主持,会议符合《公司法》和《公司章程》的有关规定,会议决议有效。会议经表决形成如下决议:

一、审议通过了《关于变更公司注册地址和经营范围的议案》,该议案需提交股东大会审议。
 根据江苏省人民政府文件《关于同意将江阴市霞客镇更名为徐霞客镇的公告》,公司注册地址由江苏省江阴市霞客镇马镇东街7号,变更为:江苏省江阴市徐霞客镇马镇东街7号。

二、审议通过了《关于变更公司经营范围的议案》,该议案需提交股东大会审议。
 根据江苏省环保厅《关于变更公司经营范围增加增加项目;进口可用作原料的固体废物;增加一般经营项目;利用自有资产对再生资源、环保、资源类项目的对外投资》(苏环办[2012]100号)的有关规定,公司董事会授权经营负责办理公司注册地址和经营范围工商变更事宜的具体事宜。
 表决结果:同意票9票,反对票0票,弃权票0票。

三、审议通过了《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》
 根据议案一及中国证监会《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》(证监发[2012]37号)和中国证监会上市公司监管局《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》(证监监管字[2012]276号)的有关规定,对公司章程注册地址和经营范围增加增加项目;进口可用作原料的固体废物;增加一般经营项目;利用自有资产对再生资源、环保、资源类项目的对外投资》(苏环办[2012]100号)的有关规定,公司董事会授权经营负责办理公司章程工商变更事宜的具体事宜。
 表决结果:同意票9票,反对票0票,弃权票0票。

四、审议通过了《关于修改公司章程的议案》,该议案需提交股东大会审议。
 本议案的详细内容,请见同日巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)披露的《公司章程修正案》。
 三、审议通过了《关于参与发行“区域集优中小企业集合票据”的议案》。
 本议案需提交股东大会审议。
 为优化公司资产负债结构,拓宽融资渠道,降低公司融资成本,促进公司主营业务稳健快速增长,公司拟申请参与发行“区域集优中小企业集合票据”。

发行计划如下:
 1.发行规模:本次拟发行集合票据的规模不超过人民币2亿元(含2亿元),且待偿还余额不超过公司最近一期净资产(不含“本公司”)的40%;
 2.发行对象:面向全国银行间债券市场的机构投资者(但法律法规禁止的购买者除外)公开发行,不向社会公众发行。
 3.发行期限:本次拟发行集合票据的期限不超过3年(含3年)。
 4.募集资金用途:用于公司业务运营资金及置换银行借款。
 5.发行利率:交易商协会每周召开一次定价联席会,主要投资机构根据市场利率以投票方式确定未来一年信用等级区域集优中小企业集合票据的发行利率,未来一年承销商和发行人按不低于发行利率下限限价确定招标利率区间,最终发行利率按竞争性招标方式由各承销商确定。
 6.发行方式:承销机构采用包销方式全额一次性发行。
 7.担保方式:第三方担保,由中诚信用增进投资股份有限公司为本公司提供第三方增信。本公司与其他发行人之间不存在互保。
 8.决议有效期:本次拟发行集合票据决议的有效期为自股东大会审议通过之日起24个月。
 如决议成功发行集合票据,公司将及时公告集合票据发行公告。
 表决结果:同意票9票,反对票0票,弃权票0票。

四、审议通过了《关于提请股东大会授权董事会全权办理公司发行“区域集优中小企业集合票据”事宜的议案》,该议案需提交股东大会审议。
 本议案拟提请股东大会批准公司关于“区域集优中小企业集合票据”的发行并授权董事会在上述发行计划范围内,根据公司实际需要,业务情况及市场环境,全权决定和办理本次发行的具体事宜,包括:

1.确定本次发行的集合票据的具体金额、期限、面值、票面利率、发行价格、发行方式、承销方式及发行日期等具体发行方案;
 2.确定本次发行的具体募集资金用途及负责根据公司实际情况情况进行调整;
 3.确定与本次发行相关的担保及反担保事宜;
 4.决定聘请为本次发行提供服务的承销商及其他中介机构;
 5.在上述授权范围内,指定任何一名或数名董事负责办理、修订、签署和申报与本次发行有关的一切协议和法律文书。
 表决结果:同意票9票,反对票0票,弃权票0票。

五、审议通过了《关于召开公司2012年第二次临时股东大会的通知》
 董事会决定于2012年8月8日(星期三)召开公司2012年第二次临时股东大会,审议董事会提交的相关议案。
 表决结果:同意票9票,反对票0票,弃权票0票。
 本议案的详细内容,请见同日巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)和《中国证券报》、《证券时报》上披露的

证券代码:600597 证券简称:光明乳业 编号:临2012-020号
光明乳业股份有限公司公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。
 光明乳业股份有限公司(下称“本公司”)于2012年6月21日就有媒体报道安徽滁县6名小学生饮用本公司牛奶发生不适发布了公告(详见2012年6月21日中国证券报、上海证券报、证券时报、上海证券交易所网站)。

本公司在第一时间对工厂“出厂”产品进行了再次检测,同时将同批次产品也送交第三方检测机构进行检测,检测结果符合合格。
 目前经安徽省疾病预防控制中心对学校牛奶产品进行检测,结果为合格产品。
 衷心感谢和真诚欢迎消费者、投资者、媒体、监管部门和社会各界对本公司的持续监督。
 特此公告。

光明乳业股份有限公司
 二〇一二年七月二十三日

证券代码:600597 证券简称:光明乳业 编号:临2012-021号
光明乳业股份有限公司公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。
 其中,2月20日,广州市工商管理局2012年第二季度二次循环抽检乳制品及含乳食品抽检异常情况,其中该公司2月23日生产的50%减糖的酸奶油及4月23日生产的125g黄油抽检个别指标异常。本次抽查的该批被抽检400g 50%减糖的酸奶油,其中含有2个菌落超标,10块黄油,其中1块菌落超标。
 接到抽查报告后,本公司非常重视,本着为消费者负责的宗旨,立即对市场上的同批次产品进行了下架回收,并对市场上的同批次产品进行了第三次抽检,结果均为合格。同时进行了原因分析,经落总数检测的原因是因为长途运输过程中挤压变形,加上销售环境的温度不稳定所致。
 本公司已经采取相应的措施,进一步加强运输过程中的监管控制,防止类似情况的发生。
 发生以上事件我们深表歉意,进一步拉近我们与消费者的距离,投资者、媒体、监管部门和社会各界对我们持续进行严格监督,并给我们提出的宝贵意见!

光明乳业股份有限公司
 二〇一二年七月二十三日

| C3 | 通信、电子 | - | - |
|----|-----------------|------------------|-------|
| G4 | 纺织、服装、鞋帽、服饰 | 218,287,029.51 | 3.69 |
| CS | 食品饮料 | 45,344,398.98 | 0.77 |
| GL | 黄金、贵金属 | 73,425,864.53 | 1.25 |
| CG | 机械、设备、仪器 | 507,466,599.25 | 8.58 |
| CS | 医药、生物制品 | 488,102,146.18 | 8.24 |
| C9 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤炭、天然气生产和供应业 | 43,348,291.50 | 0.73 |
| E | 建筑业 | 77,562,634.87 | 1.31 |
| F | 交通运输、仓储业 | 64,260,000.00 | 1.09 |
| G | 信息技术业 | 674,267,743.55 | 11.39 |
| H | 批发和零售业 | 445,124,190.95 | 7.52 |
| I | 金融、保险业 | 546,928,521.24 | 9.24 |
| J | 房地产业 | 281,520,000.00 | 4.76 |
| K | 社会服务业 | 180,308,734.96 | 3.05 |
| L | 传播与文化业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 4,716,055,389.05 | 79.67 |

3.报告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

| 代码 | 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 | 600406 | 国电南瑞 | 13,649,628 | 49,918,755.96 | 7.28 |
| 2 | 600267 | 海正药业 | 12,449,806 | 311,120,651.94 | 4.76 |
| 3 | 000002 | 万科A | 34,600,000 | 281,520,000.00 | 5.26 |
| 4 | 600998 | 九州通 | 13,148,809 | 147,661,125.07 | 2.49 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 12,430,520 | 144,073,510.51 | 2.43 |
| 6 | 002344 | 海宁皮革城 | 6,084,425 | 143,105,676.00 | 2.42 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 5,533,163 | 141,704,304.63 | 2.39 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 709,494 | 139,741,938.24 | 2.36 |
| 9 | 601939 | 建设银行 | 25,599,649 | 125,578,304.67 | 2.12 |
| 10 | 000061 | 格力电器 | 4,407,596 | 124,796,539.44 | 2.11 |

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
 注:本基金本报告期末未持有债券。

5.报告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
 注:本基金本报告期末未持有债券。

6.报告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.本基金本报告期末未持有资产支持证券。
 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.1.本基金投资的前十名证券中中海正药业 股票代码:600267 发行主体浙江海正药业股份有限公司于2012年1月5日发布公告,国家环境保护部正在对海正药业环境违法案件挂牌督办。海正药业及遇到的问题为:外排废水COD超标排放,电氨沟污泥含高浓度污水,抗生素类物质等危险废物擅自出售给无资质的企业;与环境保护部门联网的在线监测数据弄虚作假。

上述公告发布后,本基金管理人就海正药业环保问题进行了及时的跟踪分析研究,认为海正药业环保问题得到了妥善解决,对该公司的投资价值进行了实事求是的评估。本基金管理人将继续对该公司进行持续跟踪研究。

报告期末,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.2.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之外的情况。
 8.3.其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,447,769.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 352,517.19 |
| 6 | 其他流动资产 | 283,153.49 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,083,439.98 |

8.4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 注:本基金本报告期末未持有可转换债券。