

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	90,287,380.10	0.66
B	采矿业	9,253,545.91	6.71
C	制造业	7025,613,088.35	55.28
CD	食品饮料	1,843,774,993.38	13.40
CE	纺织服装/皮毛	-	-
CF	木材家具	-	-
C3	造纸印刷	24,721,724.13	0.18
C4	石油/化学/塑胶/塑料	438,452,214.70	3.19
C5	电子	551,557,277.57	4.01
C6	金属/非金属	1,545,187,623.50	11.23
C7	机械/设备/仪表	2,460,107,735.34	17.88
C8	医药/生物制品	762,259,892.71	5.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力/煤气及水的生产和供应业	103,533,351.25	0.75
E	建筑业	110,503,096.00	0.80
F	交通运输/仓储业	-	-
G	信息技术业	280,395,165.70	2.04
H	批发和零售贸易	449,743,722.52	3.27
I	金融、保险	1,283,332,131.52	9.31
J	房地产业	1,498,580,400.13	10.24
K	社会服务业	207,234,283.90	1.51
L	传播与文化产业	167,892,899.84	1.22
M	综合类	267,596,217.18	1.95
合计		12,989,140,847.60	94.62

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	000002	万科 A	102,016,463	589,989,738.09	6.25
2	000858	五粮液	21,093,301	715,062,903.50	5.20
3	000651	格力电器	26,632,795	569,449,137.10	4.14
4	000157	中联重科	48,014,754	493,187,179.48	3.61
5	000001	平安银行	36,915,441	485,599,130.33	3.55
6	002284	江河股份	2,425,069	353,136,128.00	2.57
7	002024	苏宁电器	58,573,937	352,815,282.78	2.56
8	000568	泸州老窖	8,296,770	315,965,640.00	2.30
9	000779	广发证券	19,626,885	266,925,636.00	1.94
10	000423	东阿阿胶	6,362,016	246,337,259.52	1.79

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	212,714,000.00	1.55
3	金融债券	488,688,000.00	3.57
4	其中:政策性金融债	488,688,000.00	2.97
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	中期票据	-	-
8	其他	-	-
9	合计	621,402,000.00	4.52

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120222	12国债22	4,100,000	408,688,000.00	2.97
2	110108	11国债18	1,200,000	116,000,000.00	0.84
3	110196	11央行票据96	1,000,000	96,710,000.00	0.70

序号	证券代码	证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120222	12国债22	4,100,000	408,688,000.00	2.97
2	110108	11国债18	1,200,000	116,000,000.00	0.84
3	110196	11央行票据96	1,000,000	96,710,000.00	0.70

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120222	12国债22	4,100,000	408,688,000.00	2.97
2	110108	11国债18	1,200,000	116,000,000.00	0.84
3	110196	11央行票据96	1,000,000	96,710,000.00	0.70

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	927,550.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	279,475.57
4	应收股利	4,483,968.58
5	其他应收款	97,509.42
6	其他流动资产	-
7	持有待售资产	-
8	其他	8,660,500.84
9	合计	23,922,021.99

阶段	净值增长率	净值增值率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2009年度	4.19%	0.59%	5.38%	0.82%	-1.19%	-0.34%
2010年度	-5.56%	1.11%	-6.69%	1.07%	-2.96%	-0.07%
2011年度	-1.47%	1.17%	-3.89%	1.14%	2.38%	0.07%
2012年度	117.23%	1.48%	120.91%	1.43%	-3.70%	0.05%
2009年度	151.54%	2.27%	168.53%	2.30%	-16.99%	-0.03%
2010年度	-66.61%	2.87%	-61.08%	2.89%	-0.47%	-0.02%
2011年度	103.78%	2.02%	107.59%	2.04%	-3.81%	-0.02%
2012年度	-3.66%	1.64%	-2.94%	1.64%	-0.72%	0.00%
2012年度	-29.66%	1.34%	-28.57%	1.34%	-1.09%	0.00%
2012上半年	6.00%	1.42%	6.76%	1.43%	-0.76%	-0.01%

阶段	净值增长率	净值增值率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2012年度	4.60%	0.32%	1.64%	0.89%	2.96%	-0.57%
2012年度	-0.46%	0.83%	-12.21%	1.02%	11.75%	-0.19%
2012年度	9.10%	1.00%	-10.67%	1.09%	19.77%	-0.03%
2012年度	83.08%	0.99%	96.36%	1.01%	-3.28%	-0.11%
2012年度	111.95%	1.76%	114.9%	1.72%	-2.95%	0.00%
2012年度	-69.65%	1.82%	-50.30%	2.29%	-0.70%	-0.47%
2012年度	59.59%	1.50%	74.01%	1.49%	-23.44%	0.01%
2012年度	-6.01%	1.07%	-8.57%	1.19%	2.56%	-0.12%
2012年度	-1.90%	0.82%	-1.83%	0.98%	-0.86%	-0.16%
2012上半年	2.36%	0.96%	4.62%	1.00%	-2.26%	-0.04%

序号	费用名称	金额(元)
1	销售服务费	245,805,000.00
2	基金管理人管理费	99,680,000.00
3	基金托管费	9,680,000.00
4	基金持有人管理费	-
5	基金持有人托管费	-
6	基金持有人销售服务费	-
7	基金持有人赎回费	-
8	基金持有人申购费	-
9	基金持有人赎回费	-
10	基金持有人申购费	-
11	基金持有人赎回费	-
12	基金持有人申购费	-
13	基金持有人赎回费	-
14	基金持有人申购费	-
15	基金持有人赎回费	-
16	基金持有人申购费	-
17	基金持有人赎回费	