

2012 年度 报告摘要

证券投资基金													
报告摘要													
月31日													
7.4.5.3 受限证券类别：债券 本期末(2012年12月31日)，本基金未持有流通受限的债券。 7.4.5.3.1 受限证券类别：其他 本期末(2012年12月31日)，本基金无持有流通受限的其他证券。 7.4.5.4 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			
000002	万 科 A	2012年12月26日	重大资产重组停牌	10.12	2013年1月21日	11.13	19,670,547	192,487,615.85	199,065,935.64	-			
000527	美的电器	2012年8月27日	重大资产重组停牌	9.69	未知	未知	13,817,707	139,161,409.18	133,893,580.83	-			
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 本期末(2012年12月31日)，本基金未银行间市场债券正回购余额。 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 本期末(2012年12月31日)，本基金无交易所市场债券正回购余额。 8.1 期末投资组合报告													
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		5,559,290,274.78	84.75									
2	其中：股票		5,559,290,274.78	84.75									
3	固定收益投资		359,091,000.00	5.48									
4	其中：债券		359,091,000.00	5.48									
5	资产支持证券		-	-									
6	金融衍生品投资		-	-									
7	买入返售金融资产		370,000,000.00	5.64									
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产		-	-									
9	银行存款和结算备付金合计		139,532,560.41	2.13									
10	其他各项资产		130,799,213.81	1.99									
11	合计		6,559,331,049.00	100.00									
8.1 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	占基金总资产比例(%)									
A	农、林、牧、渔业		-	-									
B	采矿业		403,210,641.67	6.18									
C	制造业		2,856,585,500.91	43.82									
D	食品、饮料		498,153,803.22	7.64									
E	纺织服装、皮毛		54,178,147.52	0.83									
F	木材、家具		-	-									
G	造纸、印刷		-	-									
H	石油、化学、塑胶、塑料		-	-									
I	电子		107,350,442.32	1.63									
J	金属、非金属		393,461,917.32	6.01									
K	机械、设备、仪表		1,106,451,883.70	16.67									
L	医药、生物制品		696,985,306.83	10.69									
M	其他制造业		-	-									
N	电力、煤气及水的生产和供应业		29,765,420.16	0.46									
O	建筑业		360,441,768.88	5.53									
P	交通运输、仓储业		63,532,839.08	0.97									
Q	信息技术业		286,236,096.54	4.39									
R	批发和零售贸易		144,203,863.24	2.21									
S	金融、保险业		778,087,406.16	11.93									
T	房地产业		376,960,836.35	5.78									
X	社会服务业		-	-									
Y	传播与文化产业												

2013年3月28日