基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2013年3月29日

普惠证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月26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。

安永华明会计师事务所注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。

本报告期自2012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	鹏华普惠封闭
基金主代码	184689
交易代码	184689
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年1月6日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	至2014年1月6日止
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年1月27日

注:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,可简称为"基金普惠"。

2.2 基金产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资思路,以宏观经济、政策研究和行业研究作为投资方向的指导,以市场、技术、管理、机制等为主体内容的核心竞争力作为成长性企业的选择标准,同时兼顾具有稳固基础但被市场低估的质优和绩优个股。本基金在投资组合构建中注意引入投资组合理论思想和辅助工具,根据市场变化灵活调整各类财产的投资比例,注重基金财产的流动性,以优化投资组合的风险和收益特征。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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		鹏华基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	裴学敏
	联系电话	0755-82825720	021-32169999
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		4006788999	95559
传真		0755-82021126	021-62701262

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	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司 上海市仙霞路18号交通银行股份有限公司

§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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-199,795,396.85	-57,794,702.01	276,066,379.76
本期利润	63,064,098.54	-549,371,989.61	149,078,591.63
加权平均基金份额本期利润	0.0315	-0.2747	0.0745
本期基金份额净值增长率	3.43%	-22.93%	7.82%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1101	-0.0776	0.1947
期末基金资产净值	1,907,954,571.24	1,844,890,472.70	2,746,262,462.31
期末基金份额净值	0.9540	0.9224	1.3731

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)所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,封闭式基金交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

(3)表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

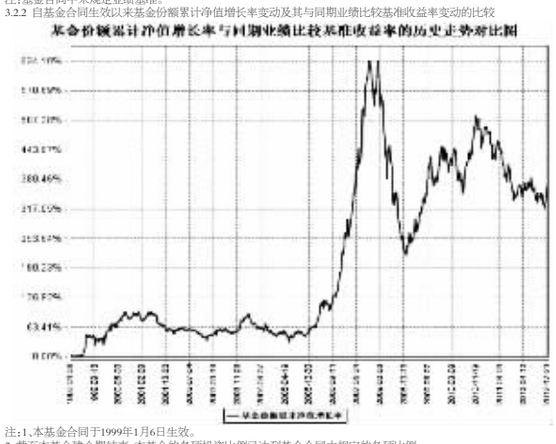
3.2 基金净值表现

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	5.78%	2.19%	-	-	-	-
过去六个月	0.56%	2.31%	-	-	-	-
过去一年	3.43%	2.04%	-	-	-	-
过去三年	-14.06%	2.22%	-	-	-	-
过去五年	-33.37%	2.81%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	367.93%	2.62%	-	-	-	-

注:基金合同中未规定业绩基准。

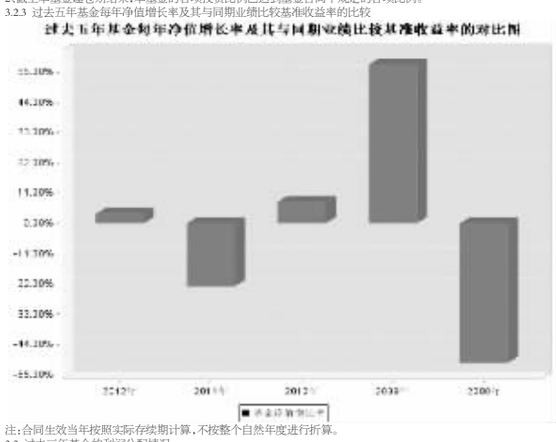
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同于1999年1月6日生效。

2.截至本基金建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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



注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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
2012	-	-	-	-	
2011	1.7600	352,000,000.00	-	352,000,000.00	
2010	5.4000	1,080,000,000.00	-	1,080,000,000.00	
合计	7.1600	1,432,000,000.00	-	1,432,000,000.00	

§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

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日,业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成,公司性质为中外合资企业。公司原注册资本8,000万元人民币,后于2001年9月完成增资扩股,增至15,000万元人民币。截止本报告期末,公司管理2只封闭式基金、31只开放式基金和6只社保组合,经过14年投资管理基金,在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
杨俊	本基金基金经理、研究部总经理	2011年12月10日	-	10	杨俊先生,国籍中国,澳大利亚麦考瑞大学商学硕士,10年证券从业经验。2002年10月加盟鹏华基金管理有限公司,历任行业研究员、社保基金组合投资经理助理、投资经理,现任鹏华基金管理有限公司研究部总经理、投资决策委员会委员,2011年12月起担任鹏华普惠基金基金经理。杨俊先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注:1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会关于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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及本基金基金合同的约定,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。本报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理,在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动,建立对公平交易的执行、监督及审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节:1、公司使用唯一的研究报告发布平台"研究报告管理平台",确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》,执行股票及信用产品出入库及日常维护工作,确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据;3、在公司股票库基础上,各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合;4、严格执行投资权限制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。

在交易执行环节:1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2、针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格自用恒生交易系统中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照"未委托数量"的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,交易系统自动按照"价格优先"原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照"同一指令价格下的公平交易"模式,进行公平委托和交易量分配;3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节:1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制;所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2、将公平交易作为投资组合业绩评估分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由金融工程师进行分析;3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且并对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次,主要原因在于指数成份股交易不活跃导致。

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

2012年,上证指数录得3%的涨幅,上下振幅均在10%左右,在一季度"春季躁动"之后,较差的经济数据和稳健的货币政策,导致市场一路下行,并在11月底跌破2000点,创出行情新低。此后,新一届国家领导人市场化改革的施政方向和回暖的经济数据,终于唤醒了投资者的热情,市场迎来了2012年度最快最迅猛的上涨,全年最终得以阳线报收。

2012年,普惠基金较为保守,我们预判宏观经济复苏需要较长时间,因此,在资产配置上,年初并未大幅加仓。在行业配置上,我们认为证券行业的创新,短期无法带来盈利的恢复,对非银行金融配置较少。个股上,业绩大幅上涨的个股持仓不多。尽管在金融地产、建筑、家电等行业上略有盈利,但全年基金收益仅与基准相当,甚为遗憾。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为3.43%,同期上证综指上涨3.17%,深证成指上涨2.22%,沪深300指数上涨7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预判2013年,中国宏观经济小幅复苏,尤其是名义GDP将高于2012年。考虑到全年通胀水平仍不高,货币政策收紧的可能性不大,加之,市场估值水平仍然处于低位,我们预计市场表现将好于2012年。影响市场最大的变量是新一届政府的施政方针,若能切实开启改革,释放制度红利,市场将稳健上行,并为今后的行情打下坚实基础。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
国信证券	788,908,215.72	15.09%	2,308,274,844.32	26.42%
方正证券	-	-	-	-

7.4.7.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
国信证券	-	-	62,015,830.80	42.15%
方正证券	-	-	-	-

7.4.7.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
国信证券	-	-	660,000,000.00	53.37%
方正证券	-	-	-	-

7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012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
国信证券	697,984.36	15.57%	487,391.98	46.72%
方正证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
国信证券	1,948,105.35	26.57%	259,398.47	16.43%
方正证券	-	-	-	-

注:1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,622,721.68	34,166,086.15

注:支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.5%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,603,786.91	5,694,347.79

注:支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费年费率为0.25%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	9,764,449.56	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	104,456,075.34	-	-	-	-

注:与关联方之间通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易,该类交易均在正常业务中按一般商业条款而订立。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
基金合同生效日(1999年1月6日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
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	7,500,000.00	7,500,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%	0.38%

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.7.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国信证券	15,000,000.00	0.75%	15,000,000.00	0.75%
方正证券	3,750,000.00	0.19%	3,750,000.00	0.19%
安徽国元信托	3,750,000.00	0.19%	3,750,000.00	0.19%

注:(1)"方正证券、安徽国元信托"为本基金发起人;

(2)关联方投资本基金为基金发行期间按统一认购费率认购。

7.4.7.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
交通银行	41,533,990.63	230,811.97	1,384,554.46	202,311.23

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

7.4.8 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600863	内蒙华电	2012年3月21日	2013年3月21日	非公开发行流通受限	7.76	7.50	3,000,000	23,280,000.00	22,500,000.00	-
600027	华电国际	2012年7月5日	2013年7月3日	非公开发行流通受限	3.12	3.54	1,300,000	4,056,000.00	4,602,000.00	-

注:

(1)内蒙古蒙电华能热电股份有限公司2011年度利润分配方案为:向全体股东每10股派发现金1.20元(含税),股权登记日为2012年8月21日,除权除息日为2012年8月22日。

(2)截至本报告期末,本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限债券及权证。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末,本基金没有持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	1,493,998,749.65	77.10
	其中:股票	1,493,998,749.65	77.10
2	固定收益投资	388,135,750.00	20.03
	其中:债券	388,135,750.00	20.03
	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	46,468,986.19	2.40
6	其他各项资产	9,027,013.12	0.47
7	合计	1,937,630,498.96	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	20,509,865.64	1.07
B	采掘业	-	-
C	制造业	598,636,488.58	31.38
C0	食品、饮料	123,897,000.00	6.49
C1	纺织、服装、皮毛	50,183,111.36	2.63
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	29,245,281.00	1.53
C5	电子	8,290,341.60	0.43
C6	金属、非金属	67,103,424.56	3.52
C7	机械、设备、仪表	244,406,920.00	12.81
C8	医药、生物制品	75,510,410.06	3.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	40,565,453.96	2.13
E	建筑业	176,919,096.40	9.27
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	65,474,000.00	3.43
H	批发和零售贸易	53,107,761.78	2.78
I	金融、保险业	356,234,180.79	18.67
J	房地产业	66,356,000.00	3.48
K	社会服务业	116,195,902.50	6.09
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,493,998,749.65	78.30

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	601166	兴业银行	7,999,891	133,518,180.79	7.00
2	600104	上汽集团	4,999,750	88,195,590.00	4.62
3	000069	华侨城A	10,999,987	82,499,902.50	4.32
4	600016	民生银行	10,000,000	78,600,000.00	4.12
5	000651	格力电器	3,000,000	76,500,000.00	4.01
6	601668	中国建筑	16,999,915	66,299,668.50	3.47
7	601169	北京银行	6,000,000	55,800,000.00	2.92
8	600048	保利地产	4,000,000	54,400,000.00	2.85
9	601318	中国平安	1,200,000	54,348,000.00	2.85
10	002065	东华软件	3,400,000	47,804,000.00	2.51

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com.cn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	600048	保利地产	164,359,473.48	8.91
2	601166	兴业银行	127,551,857.72	6.91
3	600030	中信证券	119,765,975.04	6.49
4	000157	中联重科	111,667,383.94	6.05
5	000069	华侨城A	107,691,954.83	5.84
6	601318	中国平安	102,116,117.82	5.54
7	002304	洋河股份	92,577,034.08	5.02
8	002375	亚厦股份	91,773,748.75	4.97
9	600519	贵州茅台	88,927,214.88	4.82
10	000651	格力电器	75,607,311.58	4.10
11	600104	上汽集团	75,137,772.71	4.07
12	002065	东华软件	66,209,446.36	3.59
13	601668	中国建筑	58,528,452.10	3.17
14	000568	泸州老窖	54,830,266.64	2.97
15	600395	盘江股份	53,590,935.02	2.90
16	002029	七匹狼	53,505,808.16	2.90
17	000024	招商地产	51,947,284.10	2.82
18	600518	康美药业	50,966,933.78	2.76
19	601169	北京银行	50,401,378.60	2.73
20	600809	山西汾酒	48,317,507.05	2.62
21	002663	普邦园林	48,126,512.05	2.61
22	600376	首开股份	42,737,607.69	2.32
23	002325	洪涛股份	39,536,180.20	2.14
24	000002	万科A	38,152,405.95	2.07
25	600199	金种子酒	37,721,386.71	2.04

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)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	600048	保利地产	171,386,963.08	9.29
2	600519	贵州茅台	120,517,577.39	6.53
3	000527	美的电器	116,636,740.95	6.32
4	000157	中联重科	94,001,166.14	5.10
5	600030	中信证券	90,763,595.78	4.92
6	002375	亚厦股份	87,529,520.51	4.74
7	002304	洋河股份	81,613,212.73	4.42
8	600050	中国联通	78,319,799.79	4.25
9	000069	华侨城A	76,334,115.85	4.14
10	600016	民生银行	67,430,033.55	3.65
11	000858	五粮液	64,345,353.66	3.49
12	600436	片仔癀	59,066,454.96	3.20
13	000568	泸州老窖	52,322,396.30	2.84
14	000501	鄂武商A	51,542,013.68	2.79
15	600395	盘江股份	49,546,586.11	2.69
16	601318	中国平安	47,370,608.70	2.57
17	601398	工商银行	44,237,014.61	2.40
18	000888	峨眉山A	39,926,422.62	2.16
19	002038	双鹭药业	39,618,215.70	2.15
20	600729	重庆百货	38,200,220.01	2.07
21	000024	招商地产	37,501,141.20	2.03

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)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)	2,675,888,194.73
卖出股票收入(成交总额)	2,598,571,382.40

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)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	59,293,750.00	3.11
2	央行票据	39,948,000.00	2.09
3	金融债券	288,894,000.00	15.14
	其中:政策性金融债	288,894,000.00	15.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	388,135,750.00	20.34

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	120229	12国开29	1,200,000	118,488,000.00	6.21
2	110302	11进出02	500,000	50,225,000.00	2.63
3	110406	11农发06	500,000	50,215,000.00	2.63
4	010308	03国债(8)	484,200	48,589,470.00	2.55
5	120301	12进出01	400,000	40,000,000.00	2.10

8.7 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

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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体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、处罚的证券。

8.9.2

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。

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	596,633.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,430,379.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,027,013.12

8.9.4 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。

8.9.5 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情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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。

§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
28,852	69,319.28	1,523,063,349.00	76.15%	476,936,651.00	23.85%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	197,767,851.00	9.89%
2	中国人寿保险(集团)公司	196,722,798.00	9.84%
3	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001深	129,619,186.00	6.48%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	107,628,235.00	5.38%
5	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002深	101,670,468.00	5.08%
6	太平人寿保险有限公司	68,360,560.00	3.42%
7	新华人寿保险股份有限公司	56,485,072.00	2.82%
8	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	53,807,513.00	2.69%
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	48,490,323.00	2.42%
10	渤海证券股份有限公司	45,500,000.00	2.28%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、