金泰证券投资基金 2006年年度报告摘要

一、重要提示

（一）重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称中国工商银行）根据本基金合同规定，于2007年3月9日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

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。

二、基金简介

（一）基金名称：金泰证券投资基金

基金简称：基金金泰

交易代码：500001

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1998年3月27日

报告期末基金份额总额：2,000,000,000份

基金合同存续期：至2013年3月26日止

基金份额上市交易的证券交易所：上海证券交易所

上市日期：1998年4月7日

（二）基金产品说明

（1）投资目标：本基金是平衡型基金，并以价值型和成长型股票为投资重点；投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求长期稳定的投资收益。

（2）投资策略：本基金投资时，根据宏观经济环境及其对证券市场的影响，决定投资策略；根据货币政策的变化、利率的走势，决定国债在投资组合中的比例；根据对行业及地区经济发展状况的深入研究，决定股票投资重点；根据对上市公司的调查研究，确定具体的股票投资组合。

本基金的股票投资将以中长期投资为主。在充分研究的前提下，主要投资于价值型和成长型股票中被低估的股票，以实现基金资产的稳定增值。

在股票投资组合中，将保留一定比例的短期投资。短期投资主要根据市场变化，相机抉择，灵活投资，在防范风险的前提下，增加基金的收益。

为保证基金资产的流动性和收益性，在国债投资组合中，长期国债和短期国债将保持适当的比例。

在不违反《证券投资基金法》及配套规则等法律法规规定及基金合同有关约定的前提下，基金管理人可根据具体情况，对基金投资组合进行调整。

（3）业绩比较基准：无。

（4）风险收益特征：承担中等风险、获取中等的超额收益。

（三）基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-23060282

传真：021-23060283

电子邮箱：xinxipilu@gtfund.com

（四）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人：蒋松云

联系电话：010-66106912

传真：010-66106904

电子邮箱：custody@icbc.com.cn

（五）信息披露情况

登载年度报告正文的管理人网址：http://www.gtfund.com

年度报告置备地点：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

北京市西城区复兴门内大街55号

三、主要财务指标、基金净值表现和收益分配情况

（一）各主要财务指标

	2006年	2005年	2004年
基金本期净收益	783,456,462.04元	-164,769,051.38元	258,180,968.83元
基金份额本期净收益	0.3917元	-0.0824元	0.1291元
期末可供分配基金收益	632,254,910.76元	-151,201,551.28元	72,304,199.66元
期末可供分配基金份额收益	0.3161元	-0.0756元	0.0362元
期末基金资产净值	4,189,220,186.26元	1,957,501,754.14元	2,072,304,199.66元
期末基金份额净值	2.0946元	0.9788元	1.0362元
基金加权平均净值收益率	26.96%	-8.37%	11.92%
本期基金份额净值增长率	114.00%	-2.27%	-0.59%
基金份额累计净值增长率	249.10%	63.13%	66.93%

注：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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

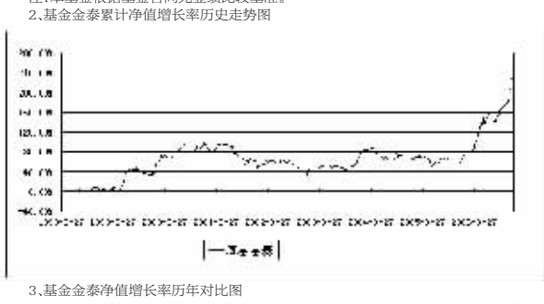
（二）基金净值表现

1、基金金泰净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

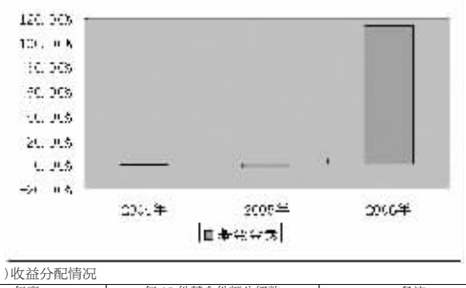
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	30.92%	2.66%	-	-	-	-
过去六个月	36.22%	2.57%	-	-	-	-
过去一年	114.00%	2.82%	-	-	-	-
过去三年	107.92%	2.63%	-	-	-	-
过去五年	116.65%	2.26%				
自基金成立起至今	249.10%	2.28%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、基金金泰累计净值增长率历史走势图



3、基金金泰净值增长率历年对比图



（三）收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2006年		
2005年	0.350元	2004年度收益分配
2004年	-	
合计	0.350元	

四、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人介绍

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京设有分公司。

截至2006年12月31日，本基金管理人共管理4只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛、基金金鼎，以及7只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰金象保本增值混合证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金等。另外，本基金管理人于2004年获得社保基金委托资产管理人资格，目前受托管理社保基金投资组合。

2、基金经理介绍

崔海峰，男，货币银行学硕士，9年证券投资从业经历。1999年4月加盟国泰基金管理有限公司，曾任研究开发部研究员、基金金鑫的基金经理助理，2003年1月－2004年1月任基金金盛的基金经理，2003年12月－2006年7月担任国泰金龙行业精选基金的基金经理，2006年7月起担任基金金泰的基金经理，现兼任基金金鼎的基金经理。

（二）基金管理合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

报告期内本基金未发生任何损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障了投资人的合法权益。

（三）2006年证券市场与投资管理回顾

2006年是惊喜之年，上证指数涨幅超过130%，这样的市场表现已经超出了2005年底所有机构的趋势预测，因此某种意义上看，预测市场是困难的。

本基金2005年底以来一直着重于行业配置和个股选择。2006年3个阶段行情中的表现如下：第一阶段本基金在05年底配置的消费品、有色金属板块、以及机械板块等，取得了良好表现；第二阶段本基金整体表现不够理想；第三阶段本基金积极配置了金融、地产板块，但权重的配置并未超出同业基准，同时本基金在大市值股票上的配置不足，使得净值表现中庸，但本基金持有的二线龙头企业表现良好，并且持有的周期类个股也给本基金带来了良好的收益。

在整体运作中，我们感到本基金主要的问题是集中度不够，而现实的投资环境需要一定的集中度，包括个股和行业的集中度。我们将在2007年中积极改进，在深入研判的基础上，提高具体的个股和行业方面的集中度。

（四）2007年证券市场与投资管理展望

展望2007年，多数机构的预测是乐观的，或许这样的乐观有其理由。下一阶段，有三个因素本基金将继续关注：一是伴随着经济结构调整和消费升级，宏观经济还将持续增长，并刺激制造业的发展，同时，内需增长也一直是大国经济崛起的核心；二是人民币升值因素；三是股权分置改革后股权激励机制的效应，股票市场之外的资源将随着激励的刺激而逐步加大进入这个市场的力度。

本基金在2007年将继续关注四大类行业的投资机会，适度进行波段操作。这四类行业包括消费品、金融地产、优势制造业，以及具有阶段性投资机会的大宗商品行业。

随着行业板块进一步挖掘，本基金还将积极关注具有品牌影响力的制造类企业，比如家电、纺织服装、家具企业等；同时也积极尝试还处于相对低PE的行业板块，例如汽车、交运、煤电、化工、造纸等行业。另外，本基金对事件推动下的拐点型企业将保持关注，并努力尝试可能的投资机会。

总之，2007年对于本基金而言，我们将理性看待可能的投资期望收益率，立足于中长期的投资机会，努力为基金份额持有人获得长期稳定的回报。

五、基金托管人报告

2006年度，本托管人在对金泰证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006年度，金泰证券投资基金的管理人——国泰基金管理有限公司在金泰证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对金泰证券投资基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的金泰证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007年3月8日

六、审计报告

本基金2006年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。

七、财务会计报告

（一）基金会计报表

1、资产负债表

资产负债表

2006年12月31日

单位：元

	2006年12月31日	2005年12月31日
资　产		
银行存款	386,666,020.93	43,971,598.82
清算备付金	7,747,440.76	1,837,591.12
交易保证金	1,098,780.49	848,780.49
应收证券清算款	3,399,920.41	-
应收股利	-	-
应收利息	9,435,086.39	5,660,969.75
股票投资市值	3,345,977,461.62	1,504,411,349.55
其中：股票投资成本	1,803,956,605.86	1,399,425,320.83
债券投资市值	895,190,530.37	535,769,765.03
其中：债券投资成本	889,368,667.65	532,052,488.33
权证投资市值	39,915,681.91	-
其中：权证投资成本	30,793,124.89	-
资产总计	4,689,430,922.88	2,092,500,054.76
负债及持有人权益		
负债：		
应付证券清算款	250,514.65	29,410,232.84
应付管理人报酬	4,939,588.71	2,423,214.67
应付托管费	823,264.78	403,869.13
应付佣金	1,660,806.53	1,448,668.34
应付利息	535,419.99	17,973.68
其他应付款	1,901,141.96	1,594,341.96
卖出回购证券款	489,800,000.00	99,400,000.00
预提费用	300,000.00	300,000.00
负债合计	500,210,736.62	134,998,300.62
持有人权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	1,556,965,275.50	108,703,305.42
未分配收益	632,254,910.76	-151,201,551.28
持有人权益合计	4,189,220,186.26	1,957,501,754.14
负债及持有人权益总计	4,689,430,922.88	2,092,500,054.76

2、经营业绩表

经营业绩表

2006年度

单位：元

项目	2006年度	2005年度
一、收入	838,302,072.74	-129,520,737.24
1、股票差价收入	776,465,131.91	-182,485,684.79
2、债券差价收入	-2,167,347.28	2,120,764.92
3、权证差价收入	16,582,868.16	5,060,317.13
4、债券利息收入	18,386,849.65	13,351,228.85
5、存款利息收入	1,203,891.04	1,284,461.90
6、股利收入	27,826,495.36	31,118,605.03
7、其他收入	4,183.90	29,569.72
二、费用	54,845,610.70	35,248,314.14
1、基金管理人报酬	42,648,556.49	29,598,017.41
2、基金托管费	7,108,092.67	4,933,002.88
3、卖出回购证券支出	4,664,534.87	123,831.68
4、其他费用	424,426.67	593,462.17
其中：上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
三、基金净收益	783,456,462.04	-164,769,051.38
加：未实现利得	1,448,261,970.08	119,966,606.62
四、基金经营业绩	2,231,718,432.12	-44,802,444.76

3、基金收益分配表

基金收益分配表

2006年度

单位：元

项目	2006年度	2005年度
本期基金净收益	783,456,462.04	-164,769,051.38
加：期初基金净收益	-151,201,551.28	83,567,500.86
加：本期损益平准金	-	-
可供分配基金净收益	632,254,910.76	-81,201,550.52
减：本期已分配基金净收益	-	70,000,000.76
期末基金净收益	632,254,910.76	-151,201,551.28

4、基金净值变动表

基金净值变动表

2006年度

单位：元

项目	2006年度	2005年度
一、期初基金净值	1,957,501,754.14	2,072,304,199.66
二、本期经营活动：		
基金净收益	783,456,462.04	-164,769,051.38
未实现利得	1,448,261,970.08	119,966,606.62
经营活动产生的基金净值变动数	2,231,718,432.12	-44,802,444.76
三、本期基金份额交易：		
基金申购款	-	-
基金赎回款	-	-
基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-	-70,000,000.76
五、期末基金净值	4,189,220,186.26	1,957,501,754.14

（二）基金会计报表附注

1、主要会计政策、会计估计及其变更

本基金年度会计报表所采用的会计政策、会计估计除下述变更外与上年度会计报表相一致。

基金资产的估值原则中新增：2006年11月13日之前取得的由于定向增发形成的暂时流通受限股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值。2006年11月13日之后基金新投资的非公开发行股票按《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》的精神进行估值。

2、关联方关系及关联方交易

(1)关联方关系

关联方名称	关联关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
上海国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
上海爱建信托投资有限责任公司	基金发起人、基金管理人的股东
浙江省国际信托投资有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
上海仪电控股（集团）公司	基金管理人的股东

注：经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司，2006年1月13日本基金管理人及时进行了公告，相关工商变更登记已办理完毕。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)通过关联方席位进行的交易（单位：元）

	2006年				2005年			
	股票投资		债券投资		股票投资		债券投资	
	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例
国泰君安	1,062,943,773.42	13.07%	147,862,447.50	29.33%	400,783,797.30	8.41%	9,531,029.18	3.75%
上海爱建	-	-	-	-	154,272,005.34	3.24%	14,050.40	0.01%

	2006年				2005年			
	债券回购		交易佣金		债券回购		交易佣金	
	成交金额	比例	金额	比例	成交金额	比例	金额	比例
国泰君安	624,100,000.00	15.47%	850,897.90	13.02%	-	-	322,706.39	8.39%
上海爱建	-	-	-	-	-	-	123,667.44	3.22%

注：根据本基金管理人与关联方签订的席位租赁协议，对关联方席位发生的交易佣金计算方式等同于其他证券公司，该佣金比例符合并反映了关联方在席位租赁期内为本基金提供证券综合研究和信息服务相对应的水平。

(3)与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易（单位：元）

	2006年			2005年		
	债券投资	债券回购		债券投资	债券回购	
	成交金额	成交金额	利息支出	成交金额	成交金额	利息支出
中国工商银行	78,524,000.00	-	-	-	-	-

(4)基金管理人报酬

①基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应支付的管理费

E为前一日的基金资产净值

②基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

③在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共42,648,556.49元，其中已支付基金管理人37,708,967.78元，尚余4,939,588.71元未支付。2005年共计提管理费29,598,017.41元，已全部支付。

(5)基金托管费

①基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

②基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

③本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共7,108,092.67元，其中已支付基金托管人6,284,827.89元，尚余823,264.78元未支付。2005年共计提托管费4,933,002.88元，已全部支付。

(6)由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为386,666,020.93元（2005年12月31日：43,971,598.82元）。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,097,985.51元（2005年：1,218,104.42元）。

(7)各关联方投资本基金情况

①基金管理人在本报告期末及2005年12月31日持有本基金的情况

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
国泰基金管理有限公司	7,000,000份	0.35%	-	-

截止本报告期末，本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为7,000,000份，较上年度末增持了7,000,000份。

②本基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末及2005年12月31日持有本基金情况如下：

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
国泰君安证券股份有限公司	16,500,000	0.83%	16,500,000	0.83%
中国电力财务有限公司	4,500,000	0.23%	4,500,000	0.23%
上海爱建信托投资有限责任公司	4,500,000	0.23%	4,500,000	0.23%

3、流通转让受限制的基金资产

(1)流通转让受限制的股票

①截至2006年12月31日止基金持有的流通转让受限制的股票资产明细如下：

A、因股权分置改革协商阶段或实施阶段而停牌：

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价(元)	复牌日期	复牌开盘单价(元)	数量(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
方案实施阶段停牌：								
000895	S双汇	06/06/01	31.02	-	-	6,118,499	68,109,070.51	189,795,838.98
600582	天地科技	06/12/14	25.34	07/1/15	30.00	2,280,000	35,937,603.57	57,775,200.00
600258	首旅股份	06/12/21	18.88	07/1/18	18.80	864,757	15,814,881.17	16,326,612.16
合 计							119,861,555.25	263,897,651.14

B、因新股配售或增发流通受限：

股票代码	股票名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
600361	华联综超	2006-5-17	2007-5-17	1,300,000	16,796,000.00	30,108,000.00	定向增发
601988	中国银行	2006-6-28	2007-1-5	353,677	1,089,325.16	1,863,877.79	网下申购
601006	大秦铁路	2006-7-26	2007-2-1	620,350	3,070,732.50	5,018,631.50	网下申购
601588	北辰实业	2006-9-28	2007-1-16	647,127	1,553,104.80	4,361,635.98	网下申购
601333	广深铁路	2006-12-18	2007-3-22	1,113,110	4,185,293.60	7,980,998.70	网下申购
601628	中国人寿	2006-12-28	2007-4-9	330,750	6,244,560.00	6,244,560.00	网下申购
	合计				32,939,016.06	55,577,703.97	

②估值方法

上述A类股票已上市，但本基金持有的部分因股权分置改革实施阶段而停牌。在编制本报表时，根据有关规定，在2006年12月31日按“停牌前估价”进行估值。

上述B类股票为基金网下申购中签、参与定向增发获得的未上市新股。其中网下申购中签部分股票中除“中国人寿”，“广深铁路”外的4只股票均已上市，但本基金持有部分未流通。在编制本报表时，根据有关规定，除“中国人寿”，“广深铁路”按成本估值外，其他股票均在2006年12月31日按市场收盘价进行估值。参与定向增发获得的“华联综超”按市价估值。

③流通受限期限及原因

上述A类股票截至2006年12月31日因股权分置改革而暂时停牌，这些股票将在上市公司股权分置改革规定的程序结束后复牌。

上述B类股票为基金网下申购及参与定向增发中签的新股。除“中国人寿”，“广深铁路”外的4只股票均已上市，但本基金持有部分未流通。“华联综超”的受限期限为一年，“中国人寿”和“广深铁路”的受限期限均为三个月。

(1)流通转让受限制的债券

①本基金截至2006年12月31日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额390,000,000.00元(2005年12月31日：无)，于2007年1月4日、2007年1月5日、2007年1月23日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

②本基金截至2006年12月31日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额998,000,000元（2005年12月31日：99,400,000元），系以如下债券作为抵押：

债券名称	回购到期日	期末估值单价(元)	数量(张)	期末成本总额
01国债01	2007-2-8	105.20	200,000.00	21,040,000.00
01国债04	2007-2-8	117.48	200,000.00	23,496,000.00
01国债05	2007-2-8	108.80	200,000.00	21,760,000.00
00国债07	2007-2-9	104.25	300,000.00	31,275,000.00
01国债09	2007-2-9	105.06	100,000.00	10,506,000.00
合 计				108,077,000.00

八、基金投资组合报告

（一）基金资产组合情况

分　类	市值(元)	占总资产比例
股票	3,345,977,461.62	71.35%
债券	895,190,530.37	19.09%
权证	39,915,681.91	0.85%
银行存款及清算备付金	394,413,461.69	8.41%
其他资产	13,933,787.29	0.30%
合　计	4,689,430,922.88	100.00%

（二）按行业分类的股票投资组合

序号	分　类	市 值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	12,752,818.41	0.30%
2	采掘业	154,294,500.00	3.68%
3	制造业	1,525,113,516.43	36.41%
	其中：食品、饮料	518,320,011.20	12.37%
	石油、化学、塑胶、塑料	195,268,370.02	4.66%
	电子	24,990,000.00	0.60%
	金属、非金属	274,189,141.26	6.55%
	机械、设备、仪表	436,691,030.00	10.42%
	医药、生物制品	75,654,963.95	1.81%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	22,112,500.00	0.53%
5	建筑业	-	-
6	交通运输、仓储业	89,164,761.70	2.13%
7	信息技术业	146,480,758.72	3.50%
8	批发和零售贸易	224,354,742.73	5.36%
9	金融、保险业	627,889,424.29	14.99%
10	房地产业	341,183,635.98	8.14%
11	社会服务业	145,170,012.16	3.47%
12	传播与文化产业	53,636,000.00	1.28%
13	综合类	3,824,791.20	0.09%
	合　计	3,345,977,461.62	79.87%

（三）基金投资的前十名股票明细(按市值占基金资产净值比例排序)

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	600036	招商银行	17,400,000.00	282,402,000.00	6.74%
2	600519	贵州茅台	2,522,400.00	221,466,720.00	5.29%
3	600031	三一重工	6,560,000.00	211,691,200.00	5.05%
4	000895	双汇发展	6,118,499.00	189,795,838.98	4.53%
5	600016	民生银行	15,000,000.00	151,800,000.00	3.62%
6	000002	万 科 A	9,100,000.00	140,777,000.00	3.36%
7	600030	中信证券	4,804,950.00	131,030,986.50	3.13%
8	000063	中兴通讯	2,950,000.00	114,548,500.00	2.73%
9	000069	华侨城 A	4,980,000.00	111,203,400.00	2.65%
10	600299	星新材料	5,800,000.00	105,386,000.00	2.52%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本管理人网站的年度报告正文。

（四）股票投资组合的重大变动

1、累计买入价值超过2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额（元）	占期初净值比例
1	600016	民生银行	135,597,500.61	6.93%
2	600030	中信证券	119,434,553.31	6.10%
3	000069	华侨城 A	108,403,227.94	5.54%
4	600028	中国石化	99,949,643.70	5.11%
5	000002	万 科 A	88,140,880.72	4.50%
6	000063	中兴通讯	85,463,075.66	4.37%
7	600031	三一重工	84,488,079.62	4.32%
8	000060	中金岭南	82,606,684.89	4.22%
9	000898	鞍钢股份	75,604,441.87	3.86%
10	000039	中集集团	67,891,087.89	3.47%
11	600809	山西汾酒	61,774,701.47	3.16%
12	600583	海油工程	61,754,555.67	3.15%
13	600761	安徽合力	59,367,266.56	3.03%
14	600887	伊利股份	58,908,878.93	3.01%
15	600361	华联综超	55,446,123.00	2.83%
16	000006	深振业 A	51,121,865.16	2.61%
17	600582	天地科技	50,224,140.60	2.57%
18	600005	武钢股份	49,661,463.28	2.54%
19	600694	大商股份	48,636,610.82	2.48%
20	600260	凯乐科技	48,575,627.98	2.48%
21	600036	招商银行	48,101,149.05	2.46%
22	600423	柳化股份	47,867,918.83	2.45%
23	600456	宝钛股份	45,066,605.76	2.30%
24	600000	浦发银行	43,466,541.99	2.22%
25	000917	电广传媒	43,056,448.71	2.20%
26	600299	星新材料	42,222,313.13	2.16%
27	000024	招商地产	42,084,133.98	2.15%
28	600298	安琪酵母	41,555,031.64	2.12%
29	600547	山东黄金	40,738,135.88	2.08%
30	002024	苏宁电器	40,307,825.22	2.06%
31	600001	邯郸钢铁	39,242,610.57	2.00%

2、累计卖出价值超过2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	占期初净值比例
1	000060	中金岭南	159,783,038.02	8.16%
2	600320	振华港机	135,072,956.22	6.90%
3	600028	中国石化	120,490,340.80	6.16%
4	600547	山东黄金	95,341,845.60	4.87%
5	600694	大商股份	93,821,747.24	4.79%
6	600269	赣粤高速	82,688,377.64	4.22%
7	600276	恒瑞医药	79,553,236.71	4.06%
8	600879	火箭股份	78,358,295.44	4.00%
9	600887	伊利股份	72,371,032.92	3.70%
10	600031	三一重工	66,302,941.60	3.39%
11	600583	海油工程	66,026,405.86	3.37%
12	000002	万 科 A	65,352,181.26	3.34%
13	000402	金 融 街	65,187,689.41	3.33%
14	600009	上海机场	64,261,719.66	3.28%
15	600729	重庆百货	63,427,012.95	3.24%
16	000039	中集集团	61,805,509.47	3.16%
17	600383	金地集团	61,533,648.35	3.14%
18	600563	法拉电子	56,362,135.06	2.88%
19	600016	民生银行	55,528,679.16	2.84%
20	600832	东方明珠	54,138,364.06	2.77%
21	000069	华侨城 A	50,091,348.16	2.56%
22	000155	川化股份	46,451,435.76	2.37%
23	600015	华夏银行	45,829,466.12	2.34%
24	600260	凯乐科技	44,804,355.06	2.29%
25	600361	华联综超	44,289,059.38	2.26%
26	600628	新世界	42,755,102.29	2.18%
27	002048	宁波华翔	42,501,121.14	2.17%
28	600497	驰宏锌锗	41,949,677.09	2.14%
29	000917	电广传媒	41,725,413.08	2.13%
30	600764	中电广通	40,365,770.90	2.06%
31	002007	华兰生物	39,158,504.56	2.00%

3、报告期内买入股票的成本总额：3,913,277,162.15元

4、报告期内卖出股票的收入总额：4,277,405,286.25元

（五）按券种分类的债券投资组合

序号	债 券 品 种	市 值(元)	占净值比例
1	国家债券	797,076,030.37	19.03%
2	金融债券	65,974,500.00	1.57%
3	企业债券	20,602,000.00	0.49%
4	可转换债券	11,538,000.00	0.28%
	合　计	895,190,530.37	21.37%

（六）　按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债 券 名 称	市 值(元)	占净值比例
1	20国债(4)	160,516,914.50	3.83%
2	02国债(14)	156,722,757.40	3.74%
3	20国债(10)	151,001,697.40	3.60%
4	21国债(3)	109,468,135.60	2.61%
5	银行间00国债07	72,975,000.00	1.74%

（七）报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3、其他资产的构成如下：

分　类	市值(元)
交易保证金	1,000,000.00
权证保证金	98,780.49
证券清算款	3,399,920.41
应收利息	9,435,086.39
合　计	13,933,787.29

4、报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

5、报告期末本基金持有因股权分置改革被动持有的权证及主动投资的权证，明细如下：

权证代码	权证名称	数量(份)
580003	邯钢 JTB1	4,000,000.00
580007	长电 CWB1	100,000.00
580009	伊利 CWB1	500,000.00
031001	侨城 HQC1	649,939.00
030002	五粮 YGC1	900,000.00
合计		6,149,939.00