泰和证券投资基金 2006年年度报告摘要

§1 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年3月29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。

本报告中的财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留审计意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本资料

（1）基金名称	泰和证券投资基金
（2）基金简称	基金泰和
（3）基金交易代码	500002
（4）基金运作方式	契约型封闭式
（5）基金合同生效日	1999年4月8日
（6）报告期末基金份额总额	20亿份
（7）基金合同存续期	15年
（8）基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
（9）上市日期	1999年4月20日

2.2 基金产品说明

（1）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。
（2）投资策略	本基金采用“自上而下”的资产配置与“自下而上”的股票选择相结合的投资方法。在综合宏观经济发展情况、政策取向、证券市场走势等多种因素的基础上，确定基金在股票、国债上的投资比例。坚持以基本分析为基础，重视数量分析，系统考察上市公司的投资价值，最终确定所投资的股票，并以技术分析辅助个股投资的时机选择。
（3）业绩比较基准	无
（4）风险收益特征	无

2.3 基金管理人

（1）名称	嘉实基金管理有限公司
（2）注册地址	上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室
（3）办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层（100005）
（4）互联网网址	http://www.jsfund.cn
（5）法定代表人	王忠民
（6）总经理	赵学军
（7）信息披露负责人	胡勇钦
（8）联系电话	（010）65188866
（9）传真	（010）65185678
（10）电子邮箱	service@jsfund.cn

2.4 基金托管人

（1）名称	中国建设银行股份有限公司
（2）注册地址	北京市金融大街25号
（3）办公地址	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼（100032）
（4）互联网网址	http://www.ccb.cn
（5）法定代表人	郭树清
（6）托管部门总经理	罗中涛
（7）信息披露负责人	尹东
（8）联系电话	（010）67595104
（9）传真	（010）66275865
（10）电子邮箱	yingdong@ccb.cn

2.5 信息披露

（1）信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
（2）登载年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
（3）基金年度报告置备地点	（1）北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司 （2）北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行基金托管部

§3 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

3.1 主要财务指标

单位：元

序号	项目	2006年	2005年	2004年
1	基金本期净收益	1,309,936,101.80	-69,018,426.80	110,732,179.08
2	基金份额本期净收益	0.6550	-0.0345	0.0554
3	期末可供分配基金份额收益	0.5257	0.0007	-0.0063
4	期末基金资产净值	4,339,002,641.39	2,106,650,405.24	1,987,402,459.21
5	期末基金份额净值	2.1695	1.0533	0.9937
6	本期基金份额净值增长率	125.67%	6.00%	-7.33%

上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金份额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	47.40%	2.51%				
过去六个月	59.23%	2.62%				
过去一年	125.67%	2.62%				
过去三年	121.67%	2.52%				
过去五年	150.90%	2.31%				
自基金合同生效起至今	255.64%	2.32%				

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额净值变动情况，及与同期业绩比较基准的变动比较

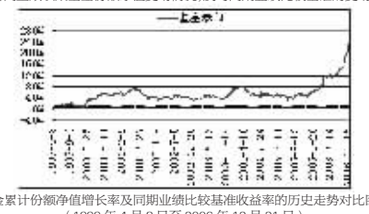

图1：泰和基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（1999年4月8日至2006年12月31日）

注：因本基金合同未规定业绩比较基准，所以基金净值表现未与同期业绩比较基准进行比较。

3.2.3 本基金自基金合同生效以来每年的净值增长率，并与同期业绩比较基准的收益率比较

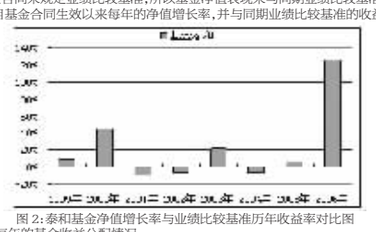

图2：泰和基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

3.3 过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数（元）	备注
2006年	1.300	2006年中期收益分配
2005年	0	
2004年	0	
合计	1.300	

§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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，注册资本1亿元，注册地上海，公司总部设在北京，并在深圳、成都设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人资格。2005年公司引入新股东德意志资产管理（亚洲）有限公司，成为中外合资基金管理公司。

截止2006年12月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、11只开放式证券投资基金，具体包括基金泰和、基金丰和、嘉实成长收益基金、嘉实增长基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金、嘉实服务增值行业基金、嘉实浦安保本基金、嘉实货币市场基金、嘉实300指数基金、嘉实超短债基金、嘉实主题精选基金和嘉实策略增长基金，其中嘉实增长基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金3只开放式基金属于嘉实理财通系列系列基金。同时，管理多个全国社保基金、企业年金基金投资组合。

4.1.2 基金经理简介

刘天君先生，经济学硕士，5年证券从业经历。2001年至2003年任招商证券研究发展中心研究员，2003年至今任嘉实基金管理有限公司研究部副总监，2006年8月至今任本基金基金经理。

4.2 报告期内基金运作的遵规守信情况说明

在报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规、规章、行业监管规则和《泰和证券投资基金基金合同》的规定和约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

截至报告期末本基金份额净值为2.1695元，本报告期基金份额净值增长率为125.67%。

报告期内，中国证券市场经历了股权分置改革带来的制度性变革，同时宏观经济强劲稳健增长，这些因素共同推动股票市场大幅上涨。其中，股改效应、人民币升值、股权激励等因素成为市场关注的焦点，而充裕的流动性则直接推动市场估值上升。

报告期内，我们较好地把握了证券市场的战略性机遇，重点投资于优质蓝筹股，取得了较好的收益。在投资策略上，本基金采用行业轮动和个股精选相结合的策略，始终投资于估值相对偏低的行业和个股，较好地平衡了收益和风险。

4.4 宏观经济、证券市场及行业走势等简要展望

展望2007年，随着更多的大盘蓝筹股上市A股市场，市场的供求关系将趋于平衡。我们认为中国宏观经济将保持稳健增长的态势，较多的优质企业将分享行业整合、产业转移等历史性机遇带来的盈利超预期增长。

我们认为，中国的传统制造业具备较强的国际竞争力，其中机械行业在政策扶持下将取得很好的发展机遇，而钢铁、水泥等原材料行业则有可能通过行业整合取得更稳定的盈利。另外，金融、地产、商业等以内需为主的行业也将保持很强的内生性增长。

从投资策略上，本基金将以个股选择为主，而具备完善治理结构的优秀民营企业将成为本基金考察的重点。另外，部分国有企业的行业前景广阔，或者有可能实行整体上市，都有可能带来超额收益的机会。

§5 托管人报告

中国建设银行根据《泰和证券投资基金基金合同》和《泰和证券投资基金托管协议》，托管泰和证券投资基金（以下简称“基金泰和”）。

本报告期，中国建设银行在基金泰和的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了基金泰和运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金

管理人——嘉实基金管理有限公司在基金泰和投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

由基金泰和管理人——嘉实基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

泰和证券投资基金2006年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计、注册会计师汪棣、魏珣签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字（2007）第20472号）。

§7 财务会计报告

7.1 基金会计报表

7.1.1 资产负债表

单位：元

资产	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
银行存款	6.2.7（十四）	317,766,402.06	139,019,567.71
清算备付金		10,561,513.82	4,317,167.55
交易保证金	6.2.7（十四）	2,243,161.91	943,726.10
应收证券清算款		153,277,533.45	
应收股利			
应收利息	6.2.7（一）	7,464,065.95	13,080,407.58
应收申购款			
其他应收款			
股票投资市值		3,326,095,082.56	1,522,032,201.96
其中：股票投资成本		2,075,808,812.37	1,417,552,149.57
债券投资市值		960,242,238.90	444,453,170.10
其中：债券投资成本		937,712,683.67	444,618,738.58
权证投资市值		14,785,752.84	870,960.00
其中：权证投资成本			
买入返售证券			
待摊费用	6.2.7（二）		
其他资产			
资产总计		4,792,435,751.49	2,124,717,201.00
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		113,190,317.45	13,159,555.32
应付赎回款			
应付赎回费			
应付管理人报酬		4,938,601.40	2,559,766.06
应付托管费		823,100.23	426,627.70
应付佣金	6.2.7（四）	3,359,961.81	602,017.22
应付利息		599,257.00	
应付收益			
未交税金			
其他应付款	6.2.7（五）	1,221,872.21	1,218,829.46
卖出回购证券款		329,200,000.00	
短期借款			
预提费用	6.2.7（六）	100,000.00	100,000.00
其他负债			
负债合计		453,433,110.10	18,066,795.76
持有人权益			
实收基金	6.2.7（七）	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	6.2.7（八）	1,287,601,578.26	105,185,443.91
未分配收益		1,051,401,063.13	1,464,961.33
持有人权益合计		4,339,002,641.39	2,106,650,405.24
负债及持有人权益总计		4,792,435,751.49	2,124,717,201.00
附注：基金份额净值		2.1695	1.0533

7.1.2 经营业绩表及收益分配表

（一）经营业绩表

单位：元

项目	附注	2006年度	2005年度
一、收入			
1.股票差价收入	6.2.7（九）	1,292,326,112.65	-95,001,037.53
2.债券差价收入	6.2.7（十）	6,002,766.41	3,574,533.11
3.权证差价收入	6.2.7（十四）	19,355,203.53	7,426,612.25
4.债券利息收入		16,401,798.76	12,511,174.41
5.存款利息收入		1,424,921.21	981,918.88
6.股利收入		28,618,117.51	36,719,809.76
7.买入返售证券收入		0.00	31,600.00
8.其他收入	6.2.7（十一）	32,073.19	29,253.85
收入合计		1,364,160,993.26	-33,726,135.27
二、费用			
1.基金管理人报酬	6.2.6（二）	41,897,510.29	29,586,160.36
2.基金托管费	6.2.6（二）	6,982,918.42	4,931,026.66
3.卖出回购证券支出		3,966,278.89	280,283.18
4.利息支出		0.00	
5.其他费用	6.2.7（十二）	1,378,183.86	494,821.33
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		300,000.00	300,000.00
审计费用		160,000.00	100,000.00
费用合计		54,224,891.46	35,292,291.53
三、基金净收益		1,309,936,101.80	-69,018,426.80
加：未实现利得	6.2.7（八）	1,182,416,134.35	188,266,372.83
四、基金经营业绩		2,492,352,236.15	119,247,946.03

（二）收益分配表

单位：元

项目	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		1,309,936,101.80	-69,018,426.80
加：期初基金净收益		1,464,961.33	70,483,388.13
可供分配基金净收益		1,311,401,063.13	1,464,961.33
减：本期已分配基金净收益		260,000,000.00	
期末基金净收益		1,051,401,063.13	1,464,961.33

7.1.3 基金净值变动表

单位：元

项目	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		2,106,650,405.24	1,987,402,459.21
二、本期经营活动			
基金净收益		1,309,936,101.80	-69,018,426.80
未实现利得		1,182,416,134.35	188,266,372.83
经营活动产生的基金净值变动数		2,492,352,236.15	119,247,946.03
三、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		-260,000,000.00	
四、期末基金净值		4,339,002,641.39	2,106,650,405.24

7.2 年度会计报表附注

7.2.1 本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.2.2 重大会计差错的内容和更正金额

本报告期本基金无重大会计差错的内容和更正金额。

7.2.3 关联方关系及关联方交易

（一）关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
中诚信托投资有限责任公司	基金发起人、基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
吉林省信托投资有限责任公司	基金发起人、基金管理人原股东
北京证券有限责任公司	基金发起人、基金管理人原股东
广发证券股份有限公司	基金发起人

（二）关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

1. 通过关联方席位进行的交易

关联方	2006年度									
	股票		债券		债券回购		权证		佣金	
	成交金额(元)	占成交总额比例	成交金额(元)	占成交总额比例	成交金额(元)	占成交总额比例	成交金额(元)	占成交总额比例	佣金(元)	占佣金总量比例
广发证券	434,206,367.63	2.96%	86,973,992.80	9.91%	30,000,000.00	0.90%	1,830,946.56	9.46%	354,868.99	3.01%

关联方	2005年度							
	股票		债券		债券回购		佣金	
	成交金额（元）	占股票成交总额比例	成交金额（元）	占债券成交总额比例	成交金额（元）	占债券回购成交总额比例	佣金（元）	占佣金总量比例
吉林省信托投资有限责任公司	119,060,353.64	2.82%					93,165.65	2.75%
北京证券有限责任公司	42,527,542.53	1.01%					34,872.26	1.03%
广发证券股份有限公司	101,544,670.10	2.41%	11,042,397.60	1.44%			83,154.53	2.45%
国都证券有限责任公司	882,388,085.77	20.92%	363,992,759.20	47.38%	231,000,000.00	22.38%	717,641.73	21.17%
合计	1,145,520,652.04	27.16%	375,035,156.80	48.82%	231,000,000.00	22.38%	928,834.17	27.40%

上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2. 关联方报酬

(1)基金管理人报酬

支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5％／当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬41,897,510.29元(2005年：29,586,160.36元)。

(2)基金托管费

支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.25％／当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费6,982,918.42元(2005年：4,931,026.66元)。

3. 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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317,766,402.06元(2005年：139，019,567.71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1,295,467.79元(2005年：931,677.64元)。

4. 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：元

项目	2006年度	2005年度
卖出债券结算金额	101,813,301.37	
卖出回购证券结算金额	1,768,612,000.00	119,415,000.00
卖出回购证券利息支出	728,083.21	22,360.70

5.关联方投资本基金情况

（1）基金管理人投资本基金情况

项目	2006年度			2005年度		
	数量（份）	占基金总份额比例	适用费率	数量（份）	占基金总份额比例	适用费率
报告期期初持有基金份额	10,000,000	0.50%		10,000,000	0.50%	
报告期间买入基金份额	5,858,600	0.29%		-	-	
报告期间卖出基金份额	-	-		-	-	
报告期末持有基金份额	15,858,600	0.79%		10,000,000	0.50%	

注：（1）基金管理人作为本基金发起人，于本基金1999年4月2日发行日认购本基金份额10,000,000份，每份发行价格为1.01元，其中：面值为1.00元；发行费用为0.01元。（2）报告期内基金管理人通过二级市场买入本基金基金份额5,858,600份，交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

（2）基金管理人主要股东及其控制的机构投资本基金情况

①基金管理人主要股东中诚信托投资有限责任公司投资本基金情况

持有人名称	2006年度		2005年度	
	期末持有基金份额（份）	占基金总份额的比例	期末持有基金份额（份）	占基金总份额的比例
中诚信托投资有限责任公司	6,250,000	0.31%	6,250,000	0.31%

注：中诚信托投资有限责任公司（原中煤信托投资有限责任公司）作为本基金发起人，于本基金1999年4月2日发行日认购本基金份额12,500,000份，每份发行价格为1.01元，其中：面值为1.00元；发行费用为0.01元。截止2006年12月31日，持有本基金6,250,000份。

②基金管理人主要股东中诚信托投资有限责任公司控制的机构投资本基金情况：无

7.2.4 报告期末流通转让受到限制的基金资产

（1）截至2006年12月31日本基金持有因股权分置改革而暂时停牌的股票　单位：元

序号	股票代码	股票简称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	年末估值总额
1	000423	S阿胶	2006-12-04	13.72	未公告	未公告	15,786,494	216,590,697.68
2	000895	S双汇	2006-06-01	31.02	未公告	未公告	207,120	6,424,862.40

（2）截至2006年12月31日，本基金持有非公开发行的股票：无

（3）截至2006年12月31日，本基金持有其他流通受限的股票

单位：元

序号	股票代码	股票简称	数量（股）	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	转让守限期限
1	601006	大秦铁路	1,555,438	7,699,418.10	12,583,493.42	市价（均价）	自上市日起锁定期为6个月	2006.8.1-2007.2.1
2	601333	广深铁路	2,254,400	8,476,544.00	16,164,048.00	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.12.22-2007.3.22
3	601398	工商银行	4,493,008	14,018,184.96	27,092,838.24	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.10.27-2007.1.29
4	601628	中国人寿	723,240	13,654,771.20	13,654,771.20	成本	自上市日起锁定期为3个月	2006.1.9-2007.4.9
5	601988	中国银行	1,886,281	5,809,745.48	9,940,700.87	市价（均价）	自上市日起锁定期为6个月	2006.7.5-2007.1.5
6	002070	众和股份	53,328	471,419.52	733,793.28	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	200.6.10.12-2007.1.12
7	002080	中材科技	50,455	453,085.90	984,881.60	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.11.20-2007.2.26
8	002081	金螳螂	36,846	471,628.80	887,251.68	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.11.20-2007.2.26
9	002084	海鸥卫浴	71,104	570,965.12	1,594,151.68	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.11.24-2007.2.26
10	002088	鲁阳股份	38,917	428,087.00	1,048,813.15	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.11.30-2007.2.28
11	002093	国脉科技	25,125	253,762.50	509,283.75	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.12.15-2007.3.15
12	002094	青岛金王	55,377	425,849.13	658,986.30	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.12.15-2007.3.15
13	002095	网盛科技	17,772	250,407.48	992,388.48	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.12.15-2007.3.15
14	002097	山河智能	51,885	518,850.00	1,689,894.45	市价（均价）	自上市日起锁定期为3个月	2006.12.22-2007.3.22

(4)报告期末流通受限制不能自由转让的债券

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329,200,000.00元(2005年：无)，于2007年1月4日到期。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。

§8 投资组合报告

8.1 报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	3,326,095,082.56	69.40%
债券	960,242,238.90	20.04%
银行存款及清算备付金合计	328,327,915.88	6.85%
应收证券清算款	153,277,533.45	3.20%
权证	14,785,752.84	0.31%
资产支持证券		
其他资产	9,707,227.86	0.20%
合计	4,792,435,751.49	100%

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	3,413,350.48	0.08%
B 采掘业	6,646,152.61	0.15%
C 制造业	2,161,395,797.30	49.83%
C0 食品、饮料	6,424,862.40	0.15%
C1 纺织、服装、皮毛	733,793.28	0.02%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	350,493,164.44	8.08%
C5 电子		
C6 金属、非金属	1,177,404,796.30	27.14%
C7 机械、设备、仪表	408,650,626.40	9.42%
C8 医药、生物制品	217,029,568.18	5.00%
C99 其他制造业	658,986.30	0.02%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业	887,251.68	0.02%
F 交通运输、仓储业	109,760,234.36	2.53%
G 信息技术业	13,094,446.39	0.30%
H 批发和零售贸易	286,408,461.61	6.60%
I 金融、保险业	406,585,382.76	9.37%
J 房地产业	226,491,752.88	5.22%
K 社会服务业	111,412,252.49	2.56%
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	3,326,095,082.56	76.66%

8.3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的的前十名股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600019	宝钢股份	45,090,525	384,171,273.00	8.85%
2	600585	海螺水泥	12,360,096	370,432,077.12	8.54%
3	000898	鞍钢股份	35,884,172	359,559,403.44	8.29%
4	600036	招商银行	21,755,951	353,099,084.73	8.14%
5	600143	金发科技	8,518,875	348,762,742.50	8.04%
6	600859	王府井	11,820,407	286,408,461.61	6.60%
7	600150	沪东重机	7,321,494	232,384,219.56	5.36%
8	000423	S阿 胶	15,786,494	216,590,697.68	4.99%
9	000002	万 科 A	13,736,232	212,499,509.04	4.90%
10	000069	华侨城 A	4,989,353	111,412,252.49	2.57%

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

（一）报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	000898	鞍钢股份	454,191,351.63	21.56%
2	000002	万 科 A	349,147,310.68	16.57%
3	600016	民生银行	312,575,736.01	14.84%
4	600036	招商银行	261,714,212.18	12.42%
5	600019	宝钢股份	252,625,265.45	11.99%
6	600585	海螺水泥	248,770,885.04	11.81%
7	600143	金发科技	188,315,714.57	8.94%
8	000423	S阿 胶	184,713,571.67	8.77%
9	600859	王府井	175,860,282.02	8.35%
10	600009	上海机场	171,357,968.60	8.13%
11	600150	沪东重机	170,266,341.69	8.08%
12	601398	工商银行	148,363,216.03	7.04%
13	600418	江淮汽车	140,057,806.58	6.65%
14	600519	贵州茅台	132,070,739.55	6.27%
15	600028	中国石化	118,416,204.17	5.62%
16	000069	华侨城 A	118,310,175.41	5.62%
17	600050	中国联通	111,819,993.03	5.31%
18	600048	保利地产	100,536,734.48	4.77%
19	600660	福耀玻璃	98,716,440.90	4.69%
20	000829	赣南果业	92,134,520.49	4.37%
21	600031	三一重工	91,510,238.45	4.34%
22	600315	上海家化	86,855,106.81	4.12%
23	600037	歌华有线	79,623,503.04	3.78%
24	000039	中集集团	79,271,457.07	3.76%
25	600299	星新材料	77,879,225.34	3.70%
26	600320	振华港机	76,650,375.73	3.64%
27	000063	中兴通讯	75,417,850.61	3.58%
28	600029	S南航	72,436,142.21	3.44%
29	600590	泰豪科技	71,995,853.21	3.42%
30	601111	中国国航	71,815,193.60	3.41%
31	002024	苏宁电器	70,996,438.97	3.37%
32	600900	长江电力	59,990,327.35	2.85%
33	000758	中色股份	59,464,466.76	2.82%
34	600456	宝钛股份	58,615,529.58	2.78%
35	600012	皖通高速	57,231,082.04	2.72%
36	600694	大商股份	56,472,412.51	2.68%
37	000410	沈阳机床	55,764,877.96	2.65%
38	000768	西飞国际	55,192,512.06	2.62%
39	000488	晨鸣纸业	54,250,802.56	2.58%
40	000970	中科三环	50,755,688.62	2.41%
41	000858	五粮液	49,857,647.20	2.37%
42	600887	伊利股份	47,270,684.69	2.24%
43	601006	大秦铁路	44,846,384.39	2.13%
44	000933	神火股份	44,277,041.75	2.10%
45	000538	云南白药	43,244,975.38	2.05%
46	600685	广船国际	42,635,966.03	2.02%

（二）报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	600016	民生银行	415,146,339.32	19.71%
2	000002	万 科 A	335,801,008.55	15.94%
3	600694	大商股份	321,619,948.89	15.27%
4	600009	上海机场	242,507,676.42	11.51%
5	601398	工商银行	193,018,861.67	9.16%
6	600418	江淮汽车	191,124,053.16	9.07%
7	600028	中国石化	185,024,949.71	8.78%
8	000063	中兴通讯	163,672,156.33	7.77%
9	000630	铜都铜业	159,464,131.34	7.57%
10	600519	贵州茅台	156,253,280.79	7.42%
11	600036	招商银行	154,489,407.69	7.33%
12	000898	鞍钢股份	154,384,779.58	7.33%
13	600795	国电电力	147,603,827.96	7.01%
14	000069	华侨城 A	145,437,579.72	6.90%
15	600660	福耀玻璃	140,539,170.27	6.67%
16	600050	中国联通	133,136,056.35	6.32%
17	000858	五粮液	121,984,440.92	5.79%
18	600048	保利地产	108,314,469.39	5.14%
19	600299	星新材料	102,418,802.94	4.86%
20	002024	苏宁电器	101,063,128.24	4.80%
21	600315	上海家化	95,229,394.47	4.52%
22	000829	赣南果业	95,018,933.83	4.51%
23	000088	盐田港	88,809,321.16	4.22%
24	600037	歌华有线	85,784,608.17	4.07%
25	000488	晨鸣纸业	84,783,425.75	4.02%
26	600012	皖通高速	82,705,209.87	3.93%
27	600900	长江电力	80,678,722.54	3.83%
28	600423	柳化股份	78,740,511.70	3.74%
29	600717	天津港	78,408,252.06	3.72%
30