

(上接B006版)

基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益品种。

十一、基金投资组合报告

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。
本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同的约定对本报告的内容进行复核,对报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担连带责任。

2.报告分析期间为2013年9月1日至2013年9月30日。

3.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权证投资	26,577,247.00	12.03
2	固定收益投资	184,106,038.90	83.36
3	货币市场基金	184,106,038.90	83.36
4	衍生品投资	-	-
5	股票投资	-	-
6	其他各项资产	5,557,952.65	2.52
7	合计	220,866,046.76	100.00

4.报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,420,800.00	0.71
B	采掘业	9,073,887.00	4.51
D	电力、热力、燃气及水生产、供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,456,000.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,455,100.00	1.72
K	房地产业	1,577,300.00	0.78
L	租赁和商务服务业	7,102,000.00	3.53
M	科学研究、技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、研究和其他服务业	-	-
P	金融业	-	-
Q	卫生和社会工作	2,492,160.00	1.24
R	文化、体育和娱乐业	85,000.00	0.04
S	综合类	26,577,247.00	13.21

5.报告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

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000038	深赤湾A	102,000.00	0.53
2	600597	光明乳业	202,300.00	1.02
3	600637	百视通	66,000.00	0.35
4	300027	华谊兄弟	32,000.00	0.16
5	002415	海康威视	60,000.00	0.79
6	601006	大秦铁路	200,000.00	1.45
7	600598	北大荒	120,000.00	1.42
8	002385	北大农	85,000.00	0.54
9	600000	浦发银行	90,000.00	100.00
10	000672	一汽轿车	175,000.00	0.40

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122078	11东阳光	162,760.00	16.29%
2	110023	11华纺债	108,000.00	11.42%
3	110003	11重机债	88,500.00	11.25%
4	110003	11重机债	100,000.00	11.33%
5	121309	12工行投债	-	5.03

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权证投资	26,577,247.00	12.03
2	固定收益投资	184,106,038.90	83.36
3	货币市场基金	184,106,038.90	83.36
4	衍生品投资	-	-
5	股票投资	-	-
6	其他各项资产	5,557,952.65	2.52
7	合计	220,866,046.76	100.00

8.报告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

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100023	11华纺债	11,427,480.00	5.68
2	110003	11重机债	88,500.00	11.25
3	110003	11重机债	100,000.00	11.33
4	121309	12工行投债	-	5.03
5	122078	11东阳光	162,760.00	8.08
6	110023	11华纺债	108,000.00	11.42
7	110003	11重机债	88,500.00	11.25
8	110003	11重机债	100,000.00	11.33
9	121309	12工行投债	-	5.03
10	100023	11华纺债	11,427,480.00	5.68

9.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100023	11华纺债	10,001,000.00	4.97
2	国家债券	-	-	-
3	企业债	-	-	-
4	公司债	-	-	-
5	短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	中小企业私募债	-	-	-
8	资产支持证券	-	-	-
9	其他	-	-	-
10	100023	11华纺债	10,001,000.00	4.97

10.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证投资	26,577,247.00	12.03
2	固定收益投资	184,106,038.90	83.36
3	货币市场基金	184,106,038.90	83.36
4	衍生品投资	-	-
5	股票投资	-	-
6	其他各项资产	5,557,952.65	2.52
7	合计	220,866,046.76	100.00

11.报告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

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122078	11东阳光	162,760.00	16.29%
2	110023	11华纺债	108,000.00	11.42%
3	110003	11重机债	88,500.00	11.25%
4	110003	11重机债	100,000.00	11.33%
5	121309	12工行投债	-	5.03
6	122078	11东阳光	162,760.00	8.08
7	110023	11华纺债	108,000.00	11.42
8	110003	11重机债	88,500.00	11.25
9	110003	11重机债	100,000.00	11.33
10	121309	12工行投债	-	5.03

12.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细