

(上接B071版)

日复核了本报表中的财务指标、净值表现和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。

本报表为期2013年7月1日至2013年9月30日。本报表财务资料未经审计师审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 3,100,400,156.58

2 固定收益类投资 3,184,400,156.58

3 其他资产 49,875,000.00

4 其他各项资产 49,875,000.00

5 资产负债差额 -

6 金货币市场基金投资 -

7 合计 3,765,648,746.92

100.00

2、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) 占基金资产净值比例(%)

A 农林、牧业、渔业 -

B 建筑业 -

C 制造业 2,647,225,497.99

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 24,260,070.24

E 建筑业 -

F 批发和零售业 83,746,347.20

G 交通运输、仓储和邮政业 21,812,151.00

H 在线旅游 0.59

I 信息技术服务业 49,713,476.24

J 金融业 30,270,000.00

K 房地产业 72,180,187.00

L 租赁和商务服务业 151,589,959.80

M 科学研究、技术服务与地质勘查业 -

N 水利、环境和公共设施管理业 83,061,903.10

O 食品、饮料、烟草、出版业 -

P 住宿和餐饮业 -

Q 文化、体育和娱乐业 30,546,565.01

R 教育 -

S 综合 3,194,406,156.58

85.82

3、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 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002415 海康威视 10,183,532 268,845,244.80

2 000315 三联虹普 5,326,218 231,211,123.38

3 002570 康美药业 190,352,240.00 5.11

4 600887 伊立特 3,982,375 177,927,912.96

5 000585 浙江永强 10,075,579 150,524,668.26

6 000538 云天化 143,475,374.54

7 000025 万华化学 9,381,000 12,875,917.25

8 000535 万华化学 2,679,750 10,641,100.30

9 002344 南玻A 4,975,944 10,077,094.80

10 000625 长城汽车 9,764,574 10,505,112.20

2.70

4、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

序号 债券代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 130201 13国债(01) 500,000 49,875,000.00

1.34

5、报告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

序号 债券代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 130201 13国债(01) 500,000 49,875,000.00

1.34

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资

序号 代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 黄金 49,875,000.00

1.34

7、报告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

序号 权证代码 期权名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002415 海康威视 1,136,943.08

-

2 000315 三联虹普 -

-

3 002570 康美药业 -

-

4 000585 浙江永强 1,363,576.47

-

5 000538 云天化 238,259.83

-

6 其他 -

-

7 其他 -

-

8 其他 -

-

9 合计 2,938,79.38

(4)报告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。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

(6) 报告期内公告的暂停赎回其他基金份额的公告

由于部分基金的份额持有人提出赎回申请，基金管理人决定暂停该部分基金份额的赎回。

(7) 报告期内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投资。

(8) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(9) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(10) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(11) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(12) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(13) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(14) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(15) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(16) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(17) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(18) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(19) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(20) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(21) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(22) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(23) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(24) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(25) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(26) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(27) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(28) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(29) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(30) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(31) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(32) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(33) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(34) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(35) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(36) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(37) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(38) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(39) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(40) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(41) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(42) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(43) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(44) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(45) 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证投资。

(46) 报告期内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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(47) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

(48) 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(49