

# 信息披露 disclosure

## 易方达积极成长证券投资基金

### 【2014】第一年度报告

基金管理人：易方达基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一四年七月二十一日

基金管理人及董事承诺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法律责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金简称	易方达积极成长混合
基金代码	110006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月9日
报告期末基金份额总额	6,221,116,422.54份
投资目标	本基金主要投资股票超成长公司，以实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采取主动投资管理策略，一方面主动规避行业配置，以控制市场系统性风险；另一方面通过自上而下的选股策略，主要投资于具有“成长”或“成长+价值”特征、业绩优秀、具有良好成长性和估值合理的上市公司，其中投资的重点是“超成长+公司”的股票，力争取得可能的高额投资回报。
业绩比较基准	上证指数
风险收益特征	本基金属于股票基金，理论上其风险收益水平高于股票型基金，高于债券型基金和货币型基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-5,112,315.00
2.本期利润	178,664,622.22
3.期末基金份额净值	0.9277
4.期末基金资产净值	4,351,694,985.41
5.期末基金净值增长率	0.09%

注：1.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据。

2.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。

3.本基金于2007年2月7日进行份额拆分，份额拆分比例为252.51248538，折算后基金份额净值为1.0000人民币元。

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率基准②	超额收益③	①-③	②-④
过去三个月	4.26%	0.99%	0.75%	0.77%	3.51%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

易方达积极成长证券投资基金  
基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2004年9月9日至2014年6月30日)

注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第五部分（二）投资范围、（五）投资组合限制和（七）基金投资策略）的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为330.86%，同期业绩比较基准收益率为56.16%。

**§4 管理人报告**

4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
魏琦峰	基金经理	2008-01-01	10年	博士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究员、基金经理，现任易方达基金管理有限公司基金经理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公司公告的聘任日期和离任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及基金合同，基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以诚实守信、勤勉尽责为基本原则，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。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 关联交易事项

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人建立了严格的投资研究管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并严格执行各环节的公平交易制度，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以确保确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的交易共有4次，为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生反向交易所致。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2014年上半年，全球经济增长仍将低迷，凭借强大的科技创新能力和大众消费市场，美国经济增长将保持持续强劲。中国经济在稳增长和结构性改革的框架下，短期经济增速仍将面临较大压力，需求拉动稳增长措施的逐步启动和落地，中期仍需在改革红利释放。

从估值角度看，A股市场经历持续大幅调整后，不同行业的估值分化显著。而随着IPO的重启，中小市值股票供给压力将显著增加，预计成长行业内部分化有可能加剧，核心价值和业绩的持续成长能力将是决定长期投资价值的关键。大部分个股由于基于其估值和无法兑现的业绩增长预期未来可能面临较大的股价回调压力，而部分成长性较强、核心竞争优势明显的优秀成长股则可能继续吸引市场资金青睐，中长期投资价值凸显。本基金将保持积极的投资理念及自下而上的发掘能力，重点挖掘具备持续成长能力、估值合理、具有成长能力的“超成长+公司”，同时努力捕捉操作机会，争取为投资者带来满意的回报。

截至报告期末，本基金份额净值为0.9277元，本报告期基金份额净值增长率为0.09%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.3 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

回顾2014年上半年，全球经济增长仍将低迷，凭借强大的科技创新能力和大众消费市场，美国经济增长将保持持续强劲。中国经济在稳增长和结构性改革的框架下，短期经济增速仍将面临较大压力，需求拉动稳增长措施的逐步启动和落地，中期仍需在改革红利释放。

从估值角度看，A股市场经历持续大幅调整后，不同行业的估值分化显著。而随着IPO的重启，中小市值股票供给压力将显著增加，预计成长行业内部分化有可能加剧，核心价值和业绩的持续成长能力将是决定长期投资价值的关键。大部分个股由于基于其估值和无法兑现的业绩增长预期未来可能面临较大的股价回调压力，而部分成长性较强、核心竞争优势明显的优秀成长股则可能继续吸引市场资金青睐，中长期投资价值凸显。本基金将保持积极的投资理念及自下而上的发掘能力，重点挖掘具备持续成长能力、估值合理、具有成长能力的“超成长+公司”，同时努力捕捉操作机会，争取为投资者带来满意的回报。

截至报告期末，本基金份额净值为0.9277元，本报告期基金份额净值增长率为0.09%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.5 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

回顾2014年上半年，全球经济增长仍将低迷，凭借强大的科技创新能力和大众消费市场，美国经济增长将保持持续强劲。中国经济在稳增长和结构性改革的框架下，短期经济增速仍将面临较大压力，需求拉动稳增长措施的逐步启动和落地，中期仍需在改革红利释放。

从估值角度看，A股市场经历持续大幅调整后，不同行业的估值分化显著。而随着IPO的重启，中小市值股票供给压力将显著增加，预计成长行业内部分化有可能加剧，核心价值和业绩的持续成长能力将是决定长期投资价值的关键。大部分个股由于基于其估值和无法兑现的业绩增长预期未来可能面临较大的股价回调压力，而部分成长性较强、核心竞争优势明显的优秀成长股则可能继续吸引市场资金青睐，中长期投资价值凸显。本基金将保持积极的投资理念及自下而上的发掘能力，重点挖掘具备持续成长能力、估值合理、具有成长能力的“超成长+公司”，同时努力捕捉操作机会，争取为投资者带来满意的回报。

截至报告期末，本基金份额净值为0.9277元，本报告期基金份额净值增长率为0.09%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

**§5 投资组合报告**

5.1 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	3,986,076,668.13	91.30
2	固定收益投资	3,986,076,668.13	91.30
3	货币资金	202,334,864.80	4.63
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	92,514,446.26	2.12
6	银行存款和结算备付金合计	66,023,274.96	1.51
7	其他资产	18,321,060.51	0.43
8	合计	4,365,870,294.66	100.00

**5.2 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、渔业	-	-
B	采矿业	30,411,373.76	0.70
C	制造业	3,245,243,086.03	74.57
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	385,679,448.13	7.92
E	建筑业	2,459,590.00	0.06
F	批发和零售业	361,826,254.40	8.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	125,484,766.80	2.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	88,095,000.00	2.02
L	租赁和商务服务业	29,496,000.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,974,000.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,068,057.00	1.22
Q	卫生和社会工作	41,930,044.14	0.96
R	文化、体育和娱乐业	88,500.00	0.00
S	综合	-	-
合计		3,986,076,668.13	91.60

**5.3 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	000963	华鲁能源	6,700,000	361,809,000.00	8.31
2	002008	大康地产	19,000,000	329,460,000.00	7.92
3	600088	攀钢钒钛	385,679,448	315,479,448.13	7.92
4	600895	双汇发展	4,500,000	232,635,000.00	5.38
5	600887	伊泰股份	6,899,928	228,525,615.36	5.25
6	600049	德盛银行	4,900,000	196,833,000.00	4.52
7	600600	青岛啤酒	4,300,000	172,258,000.00	3.96
8	000651	格力电器	5,700,000	167,865,000.00	3.86
9	000538	云南白药	2,570,000	134,154,000.00	3.08
10	600276	诺和诺德	4,019,380	133,282,640.80	3.06

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	195,133,500.00	4.48
4	企业债券	195,133,500.00	4.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	202,334,864.80	4.65

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130043	13国债03	1,050,000	105,115,500.00	2.42
2	130026	13国债06	900,000	90,018,000.00	2.07
3	130232	13国开02	62,960	7,201,364.80	0.17

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

序号	证券代码	证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130023	13国债03	1,050,000	105,115,500.00	2.42
2	130026	13国债06	900,000	90,018,000.00	2.07
3	130232	13国开02	62,960	7,201,364.80	0.17

**5.7 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	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130023	13国债03	1,050,000	105,115,500.00	2.42
2	130026	13国债06	900,000	90,018,000.00	2.07
3	130232	13国开02	62,960	7,201,364.80	0.17

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130023	13国债03	1,050,000	105,115,500.00	2.42
2	130026	13国债06	900,000	90,018,000.00	2.07
3	130232	13国开02	62,960	7,201,364.80	0.17

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

5.9.1 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中没有出现基金合同规定的备选股票。

5.11.3 其他资产构成

基金管理人：易方达基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一四年七月二十一日

基金管理人及董事承诺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法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金简称	易方达价值成长混合
基金代码	110010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月2日
报告期末基金份额总额	11,164,080,851.38份
投资目标	通过自上而下的资产配置以及对成长性价值个股的主动投资，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据宏观经济和微观经济、市场因素和政策因素，进行大类资产的战略性配置。在投资过程中，本基金遵循三个投资步骤：一是进行行业与风格配置；二是进行行业与风格配置；三是进行行业与风格配置。本基金采取主动投资管理策略，一方面主动规避行业配置，以控制市场系统性风险；另一方面通过自上而下的选股策略，主要投资于具有“成长”或“成长+价值”特征、业绩优秀、具有良好成长性和估值合理的上市公司，其中投资的重点是“超成长+公司”的股票，力争取得可能的高额投资回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币型基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益	6,458,589.47
2.本期利润	267,734,399.91
3.期末基金份额净值	0.0236
4.期末基金资产净值	12,983,499,804.18
5.期末基金净值增长率	1.1630

注：1.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据。

2.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。

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率基准②	超额收益③	①-③	②-④
过去三个月	2.09%	0.98%	0.93%	0.61%	1.16%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

易方达价值成长混合型基金  
基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2007年4月2日至2014年6月30日)

**§4 管理人报告**

4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
魏琦峰	基金经理	2007-04-02	12年	博士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究员、基金经理，现任易方达基金管理有限公司基金经理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公司公告的聘任日期和离任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及基金合同，基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以诚实守信、勤勉尽责为基本原则，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。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 关联交易事项

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人建立了严格的投资研究管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并严格执行各环节的公平交易制度，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以确保确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的交易共有4次，为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生反向交易所致。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2014年上半年，全球经济增长仍将低迷，凭借强大的科技创新能力和大众消费市场，美国经济增长将保持持续强劲。中国经济在稳增长和结构性改革的框架下，短期经济增速仍将面临较大压力，需求拉动稳增长措施的逐步启动和落地，中期仍需在改革红利释放。

从估值角度看，A股市场经历持续大幅调整后，不同行业的估值分化显著。而随着IPO的重启，中小市值股票供给压力将显著增加，预计成长行业内部分化有可能加剧，核心价值和业绩的持续成长能力将是决定长期投资价值的关键。大部分个股由于基于其估值和无法兑现的业绩增长预期未来可能面临较大的股价回调压力，而部分成长性较强、核心竞争优势明显的优秀成长股则可能继续吸引市场资金青睐，中长期投资价值凸显。本基金将保持积极的投资理念及自下而上的发掘能力，重点挖掘具备持续成长能力、估值合理、具有成长能力的“超成长+公司”，同时努力捕捉操作机会，争取为投资者带来满意的回报。

截至报告期末，本基金份额净值为0.0236元，本报告期基金份额净值增长率为1.1630%，同期业绩比较基准收益率为0.9822%。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.3 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

回顾2014年上半年，全球经济增长仍将低迷，凭借强大的科技创新能力和大众消费市场，美国经济增长将保持持续强劲。中国经济在稳增长和结构性改革的框架下，短期经济增速仍将面临较大压力，需求拉动稳增长措施的逐步启动和落地，中期仍需在改革红利释放。

从估值角度看，A股市场经历持续大幅调整后，不同行业的估值分化显著。而随着IPO的重启，中小市值股票供给压力将显著增加，预计成长行业内部分化有可能加剧，核心价值和业绩的持续成长能力将是决定长期投资价值的关键。大部分个股由于基于其估值和无法兑现的业绩增长预期未来可能面临较大的股价回调压力，而部分成长性较强、核心竞争优势明显的优秀成长股则可能继续吸引市场资金青睐，中长期投资价值凸显。本基金将保持积极的投资理念及自下而上的发掘能力，重点挖掘具备持续成长能力、估值合理、具有成长能力的“超成长+公司”，同时努力捕捉操作机会，争取为投资者带来满意的回报。

截至报告期末，本基金份额净值为0.0236元，本报告期基金份额净值增长率为1.1630%，同期业绩比较基准收益率为0.9822%。

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.5 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

回顾2014年上半年，全球经济增长仍将低迷，凭借强大的科技创新能力和大众消费市场，美国经济增长将保持持续强劲。中国经济在稳增长和结构性改革的框架下，短期经济增速仍将面临较大压力，需求拉动稳增长措施的逐步启动和落地，中期仍需在改革红利释放。

从估值角度看，A股市场经历持续大幅调整后，不同行业的估值分化显著。而随着IPO的重启，中小市值股票供给压力将显著增加，预计成长行业内部分化有可能加剧，核心价值和业绩的持续成长能力将是决定长期投资价值的关键。大部分个股由于基于其估值和无法兑现的业绩增长预期未来可能面临较大的股价回调压力，而部分成长性较强、核心竞争优势明显的优秀成长股则可能继续吸引市场资金青睐，中长期投资价值凸显。本基金将保持积极的投资理念及自下而上的发掘能力，重点挖掘具备持续成长能力、估值合理、具有成长能力的“超成长+公司”，同时努力捕捉操作机会，争取为投资者带来满意的回报。

截至报告期末，本基金份额净值为0.0236元，本报告期基金份额净值增长率为1.1630%，同期业绩比较基准收益率为0.9822%。

**§5 投资组合报告**

5.1 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	10,935,052,931.73	40.90
2	固定收益投资	10,935,052,931.73	40.90
3	货币资金	2,184,270,516.60	8.43
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	12,637,287,824.34	46.79
6	银行存款和结算备付金合计	485,738,432.10	1.87
7	其他资产	25,901,885,115.59	100.00

**5.2 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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,973,932,243.43	8.20
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	1,933,943,529.79	8.04
E	建筑业	20,057,665.00	0.08
F	批发和零售业	8,601,003,040.40	35.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		10,935,052,931.73	44.03

**5.3 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	130023	13国债03	1,050,000	105,115,500.00	2.42
2	130026	13国债06	900,000	90,018,000.00	2.07
3	130232	13国开02	62,960	7,201,364.80	0.17

**5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130023	13国债03	1,050,000	105,115,500.00	2.42
2	130026	13国债06	900,000	90,018,000.00	2.07
3	130232	13国开02	62,960	7,201,364.80	0.1