

(上接B121版)

60%—95%,债券及其他货币市场工具占基金资产的30%—35%,保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外,本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金潜在的持仓价格风险和,及时可事地进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元				
项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	50,154,168.20	95.06	59,116,399.92	95.47
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,610,897.20	3.05	2,195,039.00	3.54
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	51,765,065.40	98.12	61,311,438.92	99.02

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证300指数以外的其他市场要素保持不变			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币万元)		
		本期末	上年度末	
		2014年6月30日	2013年12月31日	
	1. 深证300指数上升5%		增加约251	增加约293
2. 深证300指数下降5%		减少约251	减少约293	

7.1 期末基金资产组合情况

7.1 期末基金资产组合情况			金额单位:人民币元
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	30,154,168.20	91.96
	其中:股票	30,154,168.20	91.96
2	固定收益投资	1,610,897.20	2.95
	其中:债券	1,610,897.20	2.95
	资产支持证券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	1,719,383.22	3.15
7	其他各项资产	1,044,279.20	1.92
8	合计	54,526,727.82	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元		
代码	行业类别	公允价值
A 农、林、牧、渔业	869,328.68	1.53
B 采矿业	1,141,027.12	2.16
C 制造业	29,210,201.14	53.37
D 电力、热力、燃气及生产和服务供应业	701,423.32	1.33
E 建筑业	883,981.56	1.68
F 批发和零售业	1,835,479.42	3.48
G 交通运输、仓储和邮政业	26,686.59	0.50
H 住宿和餐饮业	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	3,513,394.13	6.66
J 金融业	3,566,228.30	6.76
K 房地产业	3,443,820.57	6.53
L 租赁和商务服务业	747,067.13	1.42
M 科学研究和技术服务业	—	—
N 水利、环境和公共设施管理业	1,072,249.87	2.03
O 住宿、餐饮和其他服务业	—	—
P 教育	—	—
Q 卫生和社会工作	11,021,268	21.01
R 文化、体育和娱乐业	1,095,534.65	2.09
S 综合	326,894.30	0.62
合计	48,723,319.36	92.35

7.2.2 非指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元		
代码	行业类别	公允价值
A 农、林、牧、渔业	—	—
B 采矿业	85,256.00	0.16
C 制造业	782,177.84	1.48
D 电力、热力、燃气及生产和服务供应业	45,322.00	0.09
E 建筑业	—	—
F 批发和零售业	38,976.00	0.07
G 交通运输、仓储和邮政业	—	—
H 住宿和餐饮业	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	237,079.00	0.45
J 金融业	—	—
K 房地产业	—	—
L 租赁和商务服务业	219,586.00	0.42
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 住宿、餐饮和其他服务业	—	—
P 教育	—	—
Q 卫生和社会工作	—	—
R 文化、体育和娱乐业	22,472.00	0.04
S 综合	—	—
合计	1,430,488.84	2.71

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末非指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	194,255	1,608,488.85	3.05
2	000651	格力电器	1,525,126.00	2,869	—
3	000001	平安银行	113,195	1,121,762.45	2.13
4	000333	荣盛石化	41,290	907,189.60	1.53
5	000858	五粮液	40,667	729,139.31	1.39
6	000776	广发证券	69,521	807,189.60	1.53
7	002024	苏宁云商	93,251	611,728.56	1.16
8	000063	中兴通讯	42,578	555,999.36	1.05
9	000895	双发发展	14,371	514,338.09	0.97
10	000538	云南白药	9,777	510,339.40	0.97
11	000625	长安汽车	40,140	494,123.40	0.94
12	002415	海康威视	28,904	489,633.76	0.93
13	002673	西部证券	43,024	464,659.20	0.88
14	002594	比亚迪	9,200	441,627.00	0.84
15	300027	华谊兄弟	18,320	438,214.40	0.83
16	002241	歌尔声学	16,281	434,051.46	0.82
17	000157	中联重科	95,485	422,998.55	0.80
18	000662	金城医药	51,420	422,427.40	0.80
19	000338	潍柴动力	21,680	421,267.20	0.80
20	000725	亚细亚	191,590	415,555.00	0.79
21	000423	岳阳纸业	12,446	414,700.72	0.79
22	001010	TCL集团	176,480	402,192.00	0.76
23	002450	康得集团	16,305	370,938.75	0.70
24	300070	精米源	12,517	366,122.25	0.69
25	002230	科大讯飞	13,700	364,420.00	0.69
26	002353	杰瑞股份	9,030	363,457.50	0.69
27	000669	华邦地产	77,263	362,363.47	0.69
28	000581	金风科技	13,114	353,588.84	0.67
29	002202	威孚高科	35,959	341,250.91	0.65
30	002236	大亚股份	12,399	334,153.05	0.63
31	300124	机器人	11,264	331,161.60	0.63
32	300194	华明钢	7,230	317,397.60	0.60
33	000793	华鲁恒升	26,851	313,499.25	0.60
34	000663	山东铝业	16,176	313,433.00	0.60
35	002008	鲁南钨业	18,013	312,345.42	0.59
36	002665	齐鲁软件	15,224	306,306.88	0.58
37	002304	西部证券	5,951	302,013.25	0.57
38	300558	蓝色光标	11,288	299,553.52	0.57
39	000400	许继电气	14,718	295,095.90	0.56
40	000402	金 融 街	51,712	281,830.40	0.53
41	300117	同智科技	4,398	280,592.40	0.53
42	002038	顺威股份	6,225	277,448.25	0.53
43	002081	金 耀 丰	19,507	276,219.12	0.52
44	000963	华北医药	5,026	271,400.00	0.51
45	000768	中航飞机	25,587	269,431.11	0.51
46	300124	汇川技术	8,573	267,477.60	0.51
47	000039	中集集团	19,856	267,261.76	0.51
48	000009	中国宝安	26,030	263,756.30	0.50
49	000668	沙河实业	16,196	263,259.48	0.50
50	000623	奇安信	16,885	260,641.60	0.49
51	000177	电广传媒	17,122	260,706.00	0.49
52	000024	招商地产	24,635	256,696.70	0.49
53	002190	超图软件	4,240	250,160.00	0.47
54	000831	五矿稀土	11,700	245,466.00	0.47
55	000826	惠德环境	10,659	243,555.15	0.46
56	002142	宁波银行	26,449	243,330.00	0.46
57	000970	中科三环	20,306	241,235.28	0.46
58	002456	欧陆集团	11,202	240,058.86	0.46
59	000539	方正证券	22,875	235,153.00	0.45
60	300059	东方财富	18,720	225,261.60	0.43
61	002022	科华生物	9,459	218,029.95	0.41
62	000792	盛通股份	14,300	215,501.00	0.41
63	002422	科伦药业	5,556	213,456.60	0.40
64	000660	中集集团	30,084	210,147.20	0.40
65	000998	华鲁恒升	7,559	207,722.32	0.39
66	000878	云南铝业	27,087	205,529.27	0.39
67	000598	华鲁恒升	42,940	204,822.80	0.39
68	000661	长安汽车	2,498	203,197.40	0.38
69	002385	太 光 宝	17,782	202,003.52	0.38
70	000728	国发证券	21,012	193,335.28	0.38
71	000977	通源能源	5,630	198,063.40	0.38
72	300088	长信科技	10,000	194,900.00	0.37
73	002570	同智科技	13,569	193,800.00	0.37
74	300012	神开股份	12,200	192,150.00	0.36
75	000661	农产品	20,700	191,061.00	0.36
76	000983	西部矿业	35,600	187,612.00	0.36
77	000112	南 玻 A	27,385	187,039.55	0.35
78	002405	四维图新	11,240	186,808.80	0.35
79	002152	广汇能源	10,824	184,440.96	0.35
80	000729	华鲁恒升	28,300	183,950.00	0.35
81	002007	华鲁恒升	7,034	183,587.40	0.35
82	002352	上海凯宝	21,900	183,570.00	0.35
83	000778	新华传媒	29,960	183,066.24	0.35
84	000629	攀钢钒钛	88,000	183,040.00	0.35
85	300133	华鲁恒升	5,700	182,115.00	0.35
86	000800	一汽轿车	18,934	181,766.40	0.34
87	300273	和顺股份	5,900	181,130.00	0.34
88	002063	远兴软件	8,740	178,733.00	0.34
89	000425	益 丰 源	25,772	176,538.20	0.33
90	002005	德盛润达	20,032	175,200.84	0.32
91	300026	红日药业	5,850	171,405.00	0.32
92	000839	中信国安	22,487	170,901.20	0.32
93	000999	华鲁恒升	9,248	170,070.72	0.32
94	000709	河钢股份	91,300	169,818.00	0.32
95	300013	鲁信集团	8,116	169,624.40	0.32
96	002250	顺光科技	11,881	168,710.20	0.32
97	000212	顺光科技	4,480	163,140.00	0.31
98	002292	金 耀 丰	16,180	161,400.00	0.31
99	300251	通源能源	7,200	159,690.00	0.30
100	000511	通源能源	23,500	158,390.00	0.30

101	000876	新希望	14,000	158,398.70	0.30
102	002104	新华股份	7,819	153,252.40	0.29
103	002219	恒顺股份	9,639	152,519.22	0.29
104	000630	铜陵有色	16,969	152,042.24	0.29
105	002440	国茂股份	8,200	151,700.00	0.29
106	300079	国茂股份	13,569	147,902.10	0.28
107	300077	国茂股份	5,210	143,483.40	0.27
108	002129	中农股份	7,500	143,025.00	0.27
109	000758	中信股份	14,210	141,247.40	0.27
110	000868	华鲁恒升	7,687	140,639.00	0.27
111	002001	新 希 望	11,282	140,651.28	0.27
112	002075	攀钢钒钛	6,185	139,533.60	0.26
113	002073	恒顺股份	14,460	138,382.20	0.26
114	000660	国发证券	11,118	138,307.00	0.26
115	000750	德盛润达	14,880	137,781.00	0.26
116	000997	新 天 能	7,899	137,136.64	0.26
117	002048	宁波华翔	9,200	137,080.00	0.26
118	002092	中农股份	22,111	136,645.98	0.26
119	300146	德盛润达	5,518	136,018.70	0.26
120	000825	太钢集团	9,500	133,826.00	0.25
121	002153	石基信息	2,992	132,609.00	0.25
122	300072	三聚环保	6,600	131,934.00	0.25
123	002146	荣盛发展	13,924	131,260.28	0.25
124	002191	荣盛股份	9,859	131,124.70	0.25
125	002340	格林美	11,630	130,139.70	0.25
126	000988	华工科技	13,708	128,643.00	0.24
127	002030	达安基因	6,525	126,911.25	0.24
128	002500	山西证券	19,400	125,906.00	0.24
129	000541	德盛润达	12,521	124,709.16	0.24
130	002310	德盛润达	7,500	123,826.00	0.23
131	002223	鑫富药业	5,109	123,675.00	0.23
132	000939	凯迪电力	16,676	123,402.00	0.23
133	000028	国药一致	3,065	122,466.75	0.23
134	002294	恒立泰	4,063	122,071.26	0.23
135	002185	北方稀土	9,510	121,911.20	0.23
136	002155	国联证券	16,151	120,809.00	0.23
137	000600	安泰集团	29,200	119,136.00	0.23
138	000829	天普股份	14,070	119,032.20	0.23
139	002004	中农股份	6,400	119,040.00	0.23
140	000666	华鲁恒升	26,393	117,976.71	0.22
141	002344	海正药业	9,423	117,504.81	0.22
142	002051	中工国际	7,182	116,348.40	0.22
143	000669	安泰集团	12,586	115,791.20	0.22
144	000550	江特电机	3,995	115,775.00	0.22
145	002701	泰康金	9,300	114,940.00	0.22
146	000592	华鲁恒升	13,700	114,800.00	0.22
147	300153	爱尔眼科	4,602	112,012.68	0.21
148	002273	水晶光电	6,100	111,630.00	0.21
149	000735	罗 牛 牛	18,230	111,567.60	0.21
150	000887	中农股份	11,541	111,486.06	0.21
151	002299	圣农发展	7,200	111,032.20	0.21
152	000788	北大医药	7,200	109,296.00	0.21
153	000049	康美药业	2,718	109,182.06	0.21
154	000513	国联集团	2,218	108,554.54	0.21
155	002106	国发证券	9,510	107,514.50	0.20
156	002429	金亚股份	13,800	106,812.00	0.20
157	000528	柳 工	18,155	105,662.10	0.20
158	000566	海南医药	9,600	104,448.00	0.20
159	002052	同洲电子	11,530	103,385.00	0.20
160	000762	西藏矿业	9,800	103,292.00	0.20
161	000686	东北证券	14,578	103,096.26	0.20
162	002428	云南铜业	8,422	102,158.86	0.19
163	002050	三花股份	9,360	101,649.60	0.19
164	002296	国联集团	3,600	100,260.00	0.19
165	002368	金亚股份	9,510	100,040.00	0.19
166	002573	国电高新	5,700	100,206.00	0.19
167	000027	深圳能源	17,806	100,060.72	0.19
168	300052	中青宝	3,500	98,670.00	0.19
169	004422	湖北宜化	19,474	97,564.74	0.19
170	000671	阳 光 城	11,100	97,560.00	0.19
171	000652	泰达股份	25,025	96,846.75	0.18
172	000937	冀中能源	16,526	96,346.58	0.18
173	000726	鲁 墨 达	10,245	94,448.55	0.18
174	000161	山东黄金	12,300	93,980.00	0.18
175	002138	顺鑫农业	4,400	93,870.00	0.18
176	002317	众生药业	4,700	93,859.00	0.18
177	000786	北新建材	6,800	93,296.00	0.18
178	300028	宜通科技	1,811	92,650.76	0.18
179	002041	爱康药业	3,300	91,872.00	0.17
180	002367	二六三	7,915	91,259.05	0.17
181	000616	亿诚股份	28,420	90,375.60	0.17
182	002399	海普瑞	4,824	90,112.32	0.17
183	000816	江森自控	20,273	89,739.36	0.17
184	002148	华鲁恒升	4,010	89,260.00	0.17
185	002564	中国通服	10,737	88,484.72	0.17
186	000830	鲁西化工	25,100	88,352.00	0.17
187	000401	冀东水泥	10,851	88,216.63	0.17
188	000488	鸣鹿纸业	20,100	87,636.00	0.17
189	002056	烟台东磁	4,500	87,070.00	0.17
190	002069	豫 子 岛	6,242	87,263.16	0.17
191	000678	海王生物	11,713	86,793.33	0.16
192	000982	中国铝业	11,900	86,275.00	0.16
193	000587	中铝国际	8,300	86,154.00	0.16
194	000877	山东黄金	10,400	86,151.00	0.16
195	000933	光大证券	24,098	85,455.08	0.16
196	002029	七 匹 狼	10,550	85,244.00	0.16
197	002477	德盛农牧	9,900	85,066.40	0.16
198	002028	思源电气	9,041	84,985.40	0.16
199	000926	福星股份	13,000	84,760.00	0.16
200	000540	中天城投	16,327	83,267.70	0.16
201	000731	四川美丰	12,610	82,595.50	0.16
202	002176	江特电机	6,563	82,234.39	0.16
203	000718	苏宁电器	18,186	82,018.86	0.16
204	000550	北方稀土	9,510	81,250.00	0.15
205	000823	海信电子	6,700	81,271.00	0.15
206	002262	思贤药业	3,658	81,244.18	0.15
207	000975	银泰资源	10,046	80,666.62	0.15
208	000888	德 田 油	15,702	79,766.16	0.15
209	000539	鲁电力A	16,800	79,464.00	0.15
210	000772	海马汽车	21,400	79,180.00	0.15
211	002077	文海股份	10,500	79,267.00	0.15
212	000660	国发证券	5,500	77,220.00	0.15
213	002311	海大集团	7,000	77,070.00	0.15
214	001606	宇通客车	16,903	76,570.59	0.15
215	002011	锦安环境	9,600	76,126.00	0.14
216	000900	现代投资	16,483	75,986.63	0.14
217	000979	中弘股份	25,100	74,814.30	0.14
218	000006	中航地产	16,202	74,205.16	0.14
219	002408	中航地产	14,477	73,260.00	0.14
220	000685	中山公用	7,166	72,817.20	0.14
221	002431	桐昆股份	4,080	72,624.00	0.14
222	000031	中粮地产	22,149	72,208.74	0.14
223	002313	国海证券	5,800	71,862.00	0.14
224	002183	怡 达 通	9,260	71,570.80	0.14
225	002140	东华科技	4,235	71,275.05	0.14
226	002025	欧陆集团	4,500	70,608.00	0.13
227	000525	北方稀土	9,500	70,080.00	0.13
228	002079	京洲药业	9,600	69,504.00	0.13
229	002123	荣信股份	8,997	69,006.99	0.13
230	000563	陕西国际	14,477	67,367.11	0.13
231	002242	太阳股份	6,820	67,381.60	0.13
232	000662	深新药业	3,300	67,238.00	0.13
233	002237	德盛股份	5,100	65,127.00	0.13
234	000550	北方稀土	9,510	64,800.00	0.12
235	002151	北方稀土	2,400	64,480.00	0.12
236	002556	顺鑫农业	7,600	64,220.00	0.12
237	000996	中国广核	4,500	64,035.00	0.12
238	000869	新 希 望	2,655	64,012.05	0.12
239	000807	云铝股份	19,440	63,180.00	0.12
240	000417	合肥百货	12,200	63,174.00	0.12
241	002168	国联集团	8,600	63,024.00	0.12
242	000991	江苏国泰	5,300	62,971.00	0.12
243	000501	鲁西化工	5,300	62,010.00	0.12
244	000551	国兴科技	7,200	61,128.00	0.12
245	000889	深圳机场	16,200	61,074.00	0.12
246	002646	普普药业	3,900	60,411.00	0.11
247	002476	安泰集团	7,340	60,188.00	0.11
248	000901	航天科技	3,700	59,755.00	0.11
249	000537	广宇集团	10,699	57,867.27	0.11
250	002598	德盛集团	6,534	56,517.00	0.11
251	000543	国联集团	8,300	56,000.00	0.10
252	002055	同洲电子	5,600	53,816.00	0.10
253	000989	九 芝 堂	4,400	53,680.00	0.10
254	002275	桂林三金	3,500	53,130.00	0.10
255	002203	海康股份	4,800	52,848.00	0.10
256	000506	吉井股份	2,760	52,633.20	0.10
257	002416	爱康药业	3,809	52,000.00	0.10
258	000661	中国通服	7,800	50,934.00	0.10
259	002244	浙江集团	9,800	49,896.00	0.10
260	002128	露天矿业	7,466	48,529.00	0.09
261	002267	航天燃气	5,000	45,500.00	0.09
262	301032	德胜科技	3,715	42,833.95	0.08
263	002095	生 趣 堂	1,700	38,306.00	0.07
264	000552	永和利	4,600	37,352.00	0.07
265	002254	永和利	4,600	36,500.00	0.07
266	000599	华鲁股份	8,800	36,344.00	0.07
267	000667	华鲁股份	20,500	35,055.00	0.07
268	000930	中农生态	9,400	34,874.00	0.07
269	000900	天能集团	4,309	33,222.39	0.06
270	000850	华茂股份	6,300	32,568.00	0.06
271	002526	山东黄金	5,000	30,900.00	0.06
272	002269	华鲁股份	3,700	30,747.00	0.06
273	002122	天华集团	6,534	30,590.00	0.06
274	000927	德 盛 通	2,800	30,540.00	0.06
275	002022	深南光电	2,300	29,854.00	0.06
276	000790	华神集团	3,700	29,467.00	0.06
277	000662	东方创业	2,958	28,919.32	0.06
278	002093	国联科技	4,100	27,101.00	0.05
279	000752	西藏发展	2,600	25,766.00	0.05
280	002479	山东黄金	3,225	24,852.50	0.05
281	000799	山东黄金	2,685	23,466.00	0.05
282	000506	中国通服	5,360	21,073.60	0.04
283	000951	中国一汽	1,787	21,032.99	0.04
284	002020	罗莱家纺	1,000	20,100.00	0.04
285	000043	中航地产	4,100	19,762.00	0.04
286	000042	中航控股	1,700	19,430.40	0.04
287	000780	华鲁股份	4,306	19,329.64	0.04
288	000412	康 希 生	3,150	19,152.00	0.04
289	002134	康 希 生	3,000	19,107.00	0.04
290	002012	苏 泊 尔	1,335	18,276.15	0.03
291	000828	东兴集团	3,940	18,005.80	0.03
292	002378	康源药业	1,000		