

上转B045版

报告所列财务数据未经审计。

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	2,408,514,10155	91.64
	其中：股票	2,408,514,10155	91.64
2	固定收益投资	70,427,000000	2.68
	其中：债券	70,427,000000	2.68
3	货币市场基金	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金	97,900,74015	3.73
7	其他资产	61,369,59913	1.96
	合计	2,628,207,40403	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资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	183,591,14235	7.23
C	制造业	330,188,56798	13.00
D	电力、热力、燃气及生产、供应业	107,914,45074	4.25
E	建筑业	197,731,92360	7.76
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	68,246,59771	2.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,796,59902	2.16
J	金融业	1,360,448,79865	5354
K	房地产业	105,597,89360	4.16
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	2,408,514,10155	94.97

(2) 报告期末股权投资按行业分类的投资组合

报告期末，本基金未持有股权投资股票。

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

(1) 报告期末指数投资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

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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组合

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11. 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行人受到过行政处罚、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号

名称

金额(元)

占基金资产净值比例(%)

1

卖出回购金融资产

49,815,929

181,107,06569

7.13

2

卖出回购股票

8,366,881

166,988,01232

6.63

3

卖出回购固定收益证券

16,126,000

160,203,29484

6.31

4

卖出回购权证

1,560,141

127,018,55304

5.00

5

卖出回购股票

6,081,608

118,408,07168

4.66

6

卖出回购权证

5,897,202

101,164,28826

4.00

7

卖出回购股票

11,339,695

93,430,08680

3.68

8

卖出回购股票

11,201,064

93,093,84184

3.06

9

卖出回购股票

12,626,209

89,133,97654

3.51

10

卖出回购股票

16,917,397

82,726,02242

3.26

注：本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票等，成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%。

(2) 报告期末本基金未持有积极股权投资股票。

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

4. 报告期末指数投资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

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组合

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11. 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行人受到过行政处罚、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号

名称

金额(元)

占基金资产净值比例(%)

1

卖出回购金融资产

1,480,99156

26,941,56664

1.53

2

卖出回购股票

8,366,881

166,988,01232

6.63

3

卖出回购固定收益证券

16,126,000

160,203,29484

6.31

4

卖出回购权证

1,560,141

127,018,55304

5.00

5

卖出回购股票

6,081,608

118,408,07168

4.66

6

卖出回购权证

5,897,202

101,164,28826

4.00

7

卖出回购股票

11,339,695

93,430,08680

3.68

8

卖出回购股票

11,201,064

93,093,84184

3.06

9

卖出回购股票

12,626,209

89,133,97654

3.51

10

卖出回购股票

16,917,397

82,726,02242

3.26

注：嘉实基本面50指数（LOF）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图