

(上接B107版)

| 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 | 601318 | 中国平安 | 1,100,000 | 71,841,000.00 | 6.24 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 18,000,000 | 70,380,000.00 | 6.12 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 10,500,000 | 63,946,000.00 | 5.56 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 8,000,000 | 61,840,000.00 | 5.51 |
| 5 | 600438 | 通威股份 | 4,800,000 | 60,076,000.00 | 4.43 |
| 6 | 000910 | 大秦铁路 | 2,400,000 | 48,432,000.00 | 4.21 |
| 7 | 002250 | 联华科技 | 4,400,000 | 46,776,000.00 | 4.03 |
| 8 | 600121 | 三星医疗 | 2,400,200 | 43,466,540.00 | 3.78 |
| 9 | 600216 | 浙江医药 | 2,550,000 | 38,709,000.00 | 3.36 |
| 10 | 000669 | 新安股份 | 2,900,000 | 38,688,000.00 | 3.36 |

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 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 4 | 其中:政策性金融债 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转换债券 | 3,671,260.00 | 0.32 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 73,716,260.00 | 6.41 |

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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|---------------|
| 1 | 180404 | 18国债04 | 40,000,000 | 40,044,000.00 |
| 2 | 150207 | 15国开07 | 300,000 | 30,000,000.00 |
| 3 | 130010 | 13国债10 | 27,500 | 3,671,260.00 |

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

本基金本报告期末没有资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末没有贵金属投资。

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

本基金本报告期末没有权证投资。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细:

(2) 本基金投资股指期货的投资策略

若本基金投资股指期货,本基金将主要选择流动性好、交易活跃的投资品种,作为本基金股指期货对冲的主要品种,降低股票仓位调整期间的交易成本,并利用股指期货的冲销作用,降低股指期货持仓的代理风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末没有国债期货交易持仓。

11. 投资组合报告附注

(1) 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

(2) 本基金投资的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定股票品种之外的情况。

(3) 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存保证金 | 1,722,894.66 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,769,791.81 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,385,050.94 |
| 5 | 应收申购款 | 3,885,236.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,763,973.10 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:70%沪深300指数+30%上证国债指数。

本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读基金合同及招募说明书。

十三、基金投资组合报告

1. 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 | 601318 | 中国平安 | 1,100,000 | 71,841,000.00 | 6.24 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 18,000,000 | 70,380,000.00 | 6.12 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 10,500,000 | 63,946,000.00 | 5.56 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 8,000,000 | 61,840,000.00 | 5.51 |
| 5 | 600438 | 通威股份 | 4,800,000 | 60,076,000.00 | 4.43 |
| 6 | 000910 | 大秦铁路 | 2,400,000 | 48,432,000.00 | 4.21 |
| 7 | 002250 | 联华科技 | 4,400,000 | 46,776,000.00 | 4.03 |
| 8 | 600121 | 三星医疗 | 2,400,200 | 43,466,540.00 | 3.78 |
| 9 | 600216 | 浙江医药 | 2,550,000 | 38,709,000.00 | 3.36 |
| 10 | 000669 | 新安股份 | 2,900,000 | 38,688,000.00 | 3.36 |

2. 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 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 4 | 其中:政策性金融债 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转换债券 | 3,671,260.00 | 0.32 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 73,716,260.00 | 6.41 |

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五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|---------------|
| 1 | 180404 | 18国债04 | 40,000,000 | 40,044,000.00 |
| 2 | 150207 | 15国开07 | 300,000 | 30,000,000.00 |
| 3 | 130010 | 13国债10 | 27,500 | 3,671,260.00 |

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末没有资产支持证券投资。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末没有贵金属投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末没有权证投资。

7. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细:

(2) 本基金投资股指期货的投资策略

若本基金投资股指期货,本基金将主要选择流动性好、交易活跃的投资品种,作为本基金股指期货对冲的主要品种,降低股票仓位调整期间的交易成本,并利用股指期货的冲销作用,降低股指期货持仓的代理风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

8. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末没有国债期货交易持仓。

9. 投资组合报告附注

(1) 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

(2) 本基金投资的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定股票品种之外的情况。

(3) 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存保证金 | 1,722,894.66 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,769,791.81 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,385,050.94 |
| 5 | 应收申购款 | 3,885,236.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,763,973.10 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:70%沪深300指数+30%上证国债指数。

本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读基金合同及招募说明书。

十三、基金投资组合报告

1. 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 | 601318 | 中国平安 | 1,100,000 | 71,841,000.00 | 6.24 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 18,000,000 | 70,380,000.00 | 6.12 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 10,500,000 | 63,946,000.00 | 5.56 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 8,000,000 | 61,840,000.00 | 5.51 |
| 5 | 600438 | 通威股份 | 4,800,000 | 60,076,000.00 | 4.43 |
| 6 | 000910 | 大秦铁路 | 2,400,000 | 48,432,000.00 | 4.21 |
| 7 | 002250 | 联华科技 | 4,400,000 | 46,776,000.00 | 4.03 |
| 8 | 600121 | 三星医疗 | 2,400,200 | 43,466,540.00 | 3.78 |
| 9 | 600216 | 浙江医药 | 2,550,000 | 38,709,000.00 | 3.36 |
| 10 | 000669 | 新安股份 | 2,900,000 | 38,688,000.00 | 3.36 |

2. 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 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 4 | 其中:政策性金融债 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转换债券 | 3,671,260.00 | 0.32 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 73,716,260.00 | 6.41 |

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五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|---------------|
| 1 | 180404 | 18国债04 | 40,000,000 | 40,044,000.00 |
| 2 | 150207 | 15国开07 | 300,000 | 30,000,000.00 |
| 3 | 130010 | 13国债10 | 27,500 | 3,671,260.00 |

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末没有资产支持证券投资。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末没有贵金属投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末没有权证投资。

7. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细:

(2) 本基金投资股指期货的投资策略

若本基金投资股指期货,本基金将主要选择流动性好、交易活跃的投资品种,作为本基金股指期货对冲的主要品种,降低股票仓位调整期间的交易成本,并利用股指期货的冲销作用,降低股指期货持仓的代理风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

8. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末没有国债期货交易持仓。

9. 投资组合报告附注

(1) 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

(2) 本基金投资的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定股票品种之外的情况。

(3) 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存保证金 | 1,722,894.66 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,769,791.81 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,385,050.94 |
| 5 | 应收申购款 | 3,885,236.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,763,973.10 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:70%沪深300指数+30%上证国债指数。

本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读基金合同及招募说明书。

十三、基金投资组合报告

1. 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 | 601318 | 中国平安 | 1,100,000 | 71,841,000.00 | 6.24 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 18,000,000 | 70,380,000.00 | 6.12 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 10,500,000 | 63,946,000.00 | 5.56 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 8,000,000 | 61,840,000.00 | 5.51 |
| 5 | 600438 | 通威股份 | 4,800,000 | 60,076,000.00 | 4.43 |
| 6 | 000910 | 大秦铁路 | 2,400,000 | 48,432,000.00 | 4.21 |
| 7 | 002250 | 联华科技 | 4,400,000 | 46,776,000.00 | 4.03 |
| 8 | 600121 | 三星医疗 | 2,400,200 | 43,466,540.00 | 3.78 |
| 9 | 600216 | 浙江医药 | 2,550,000 | 38,709,000.00 | 3.36 |
| 10 | 000669 | 新安股份 | 2,900,000 | 38,688,000.00 | 3.36 |

2. 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 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 4 | 其中:政策性金融债 | 70,044,000.00 | 6.09 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转换债券 | 3,671,260.00 | 0.32 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 73,716,260 | |