

上证50交易型开放式指数证券投资基金

华夏平稳增长混合型证券投资基金

【2011】第一季度报告

【2011】第一季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证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2011年4月19日复核了本报告中的财务指标、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。

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。投资有风险,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2011年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|----------------|
| 基金简称 | 上证50ETF |
| 基金主代码 | 510050 |
| 交易代码 | 510050 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年12月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 9,633,566,757份 |

投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略:本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

业绩比较基准:上证50指数

风险收益特征:本基金属股票基金,风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证50指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

基金管理人:华夏基金管理有限公司
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(2011年1月1日至2011年3月31日) |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -235,478,829.46 |
| 2.本期利润 | 1,020,436,974.16 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1016 |
| 4.期末基金资产净值 | 19,968,817,155.83 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.073 |

注:①所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 基金净值表现

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的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益③ | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|-----------|--------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 5.12% | 1.28% | 5.38% | 1.28% | -0.26% | 0.00% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证50交易型开放式指数证券投资基金
(2004年12月30日至2011年3月31日)

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金管理人)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理时间 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-------------|--------|-----|
| 方军 | 本基金的基金经理 | 2004-12-30 | - | 12年 |

注:①上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。
②证券从业年限指从事证券行业工作年限,即自取得证券从业资格之日起,至本报告期末止。
③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。
④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。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.51 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.53 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.55 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.57 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.58 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.59 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.60 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.61 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.62 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.63 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.64 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.65 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.66 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.67 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.68 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.69 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.70 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.71 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.72 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.73 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.74 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.75 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.76 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.77 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.78 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.79 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.80 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.81 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.82 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.83 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.84 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.85 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.86 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.87 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.88 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.89 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.90 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.91 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.92 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.93 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.94 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.95 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.96 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.97 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.98 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.99 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.2.100 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

§ 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 | 19,809,122,923.40 | 99.07 |
| 2 | 其中:股票 | 19,809,122,923.40 | 99.07 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| 4 | 其中:债券 | - | - |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 7 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 8 | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 9 | 银行存款和结算备付金合计 | 165,989,224.83 | 0.83 |
| 10 | 其他各项资产 | 19,552,040.86 | 0.10 |
| 11 | 合计 | 19,994,664,189.09 | 100.00 |

注:1.报告期末基金资产组合情况

2.报告期末基金资产组合情况

3.报告期末基金资产组合情况

4.报告期末基金资产组合情况

5.报告期末基金资产组合情况

6.报告期末基金资产组合情况

7.报告期末基金资产组合情况

8.报告期末基金资产组合情况

9.报告期末基金资产组合情况

10.报告期末基金资产组合情况

11.报告期末基金资产组合情况

12.报告期末基金资产组合情况

13.报告期末基金资产组合情况

14.报告期末基金资产组合情况

15.报告期末基金资产组合情况

16.报告期末基金资产组合情况

17.报告期末基金资产组合情况

18.报告期末基金资产组合情况

19.报告期末基金资产组合情况

20.报告期末基金资产组合情况

21.报告期末基金资产组合情况

22.报告期末基金资产组合情况

23.报告期末基金资产组合情况

24.报告期末基金资产组合情况

25.报告期末基金资产组合情况

26.报告期末基金资产组合情况

27.报告期末基金资产组合情况

28.报告期末基金资产组合情况

29.报告期末基金资产组合情况

30.报告期末基金资产组合情况

31.报告期末基金资产组合情况

32.报告期末基金资产组合情况

33.报告期末基金资产组合情况

34.报告期末基金资产组合情况

35.报告期末基金资产组合情况

36.报告期末基金资产组合情况

37.报告期末基金资产组合情况

38.报告期末基金资产组合情况

39.报告期末基金资产组合情况

40.报告期末基金资产组合情况

41.报告期末基金资产组合情况

42.报告期末基金资产组合情况

43.报告期末基金资产组合情况

44.报告期末基金资产组合情况

45.报告期末基金资产组合情况

46.报告期末基金资产组合情况

47.报告期末基金资产组合情况

48.报告期末基金资产组合情况

49.报告期末基金资产组合情况

50.报告期末基金资产组合情况

51.报告期末基金资产组合情况

52.报告期末基金资产组合情况

53.报告期末基金资产组合情况

54.报告期末基金资产组合情况

55.报告期末基金资产组合情况

56.报告期末基金资产组合情况

57.报告期末基金资产组合情况

58.报告期末基金资产组合情况

59.报告期末基金资产组合情况

60.报告期末基金资产组合情况

61.报告期末基金资产组合情况

62.报告期末基金资产组合情况

63.报告期末基金资产组合情况

64.报告期末基金资产组合情况

65.报告期末基金资产组合情况

66.报告期末基金资产组合情况

67.报告期末基金资产组合情况

68.报告期末基金资产组合情况

69.报告期末基金资产组合情况

70.报告期末基金资产组合情况

71.报告期末基金资产组合情况

72.报告期末基金资产组合情况

73.报告期末基金资产组合情况

74.报告期末基金资产组合情况

75.报告期末基金资产组合情况

76.报告期末基金资产组合情况

77.报告期末基金资产组合情况

78.报告期末基金资产组合情况

79.报告期末基金资产组合情况

80.报告期末基金资产组合情况

81.报告期末基金资产组合情况

82.报告期末基金资产组合情况

83.报告期末基金资产组合情况

84.报告期末基金资产组合情况

85.报告期末基金资产组合情况

86.报告期末基金资产组合情况

87.报告期末基金资产组合情况

88.报告期末基金资产组合情况

89.报告期末基金资产组合情况

90.报告期末基金资产组合情况

91.报告期末基金资产组合情况

92.报告期末基金资产组合情况

93.报告期末基金资产组合情况

94.报告期末基金资产组合情况

95.报告期末基金资产组合情况

96.报告期末基金资产组合情况

97.报告期末基金资产组合情况

98.报告期末基金资产组合情况

99.报告期末基金资产组合情况

100.报告期末基金资产组合情况

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 | 60,433,561.20 | 1.03 |
| B | 采矿业 | 116,992,884.66 | 1.99 |
| C | 制造业 | 833,988,000.00 | 31.52 |
| D | 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 | 193,160,335.27 | 3.29 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 103,700,000.00 | 1.77 |
| H | 信息传输、计算机服务和软件业 | - | - |
| I | 金融业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 租赁和商务服务业 | - | - |
| L | 卫生、社会保障和社会福利业 | - | - |
| M | 教育、文化、体育和娱乐业 | - | - |
| N | 综合类 | 4,616,620,903.45 | 78.60 |

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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 69,446,798 | 945,865,388.76 | 4.74 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 26,187,414 | 761,791,873.26 | 3.81 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 28,549,497 | 631,957,273.64 | 3.16 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 3,148,426 | 566,244,416.10 | 2.84 |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 108,219,437 | 537,850,780.81 | 2.69 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 69,446,798 | 945,865,388.76 | 4.74 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 26,187,414 | 761,791,873.26 | 3.81 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 28,549,497 | 631,957,273.64 | 3.16 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 3,148,426 | 566,244,416.10 | 2.84 |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 108,219,437 | 537,850,780.81 | 2.69 |

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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

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权证投资明细

| 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

5.9 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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

5.10 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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

5.11 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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

5.12 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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

5.13 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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

5.14 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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |
| 2 | 600318 | 交通银行 | 27,083,610 | 1,339,555,360.60 | 6.71 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 187,099,688 | 1,064,597,224.72 | 5.33 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 188,372,081 | 1,052,999,932.79 | 5.27 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 35,070,686 | 1,006,879,395.06 | 5.04 |

5.15 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 | 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 | 600036 | 招商银行 | 107,035,558 | 1,508,131,012.22 | 7.55 |