

(上接B02版)

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	2,453,578,811.07	88.48
2	601988	招商银行	2,262,933,889.07	80.46
3	600036	招商银行	99,740,000.00	4.08
4	601288	农业银行	99,740,000.00	4.08
5	600016	民生银行	—	—
6	600028	中国银行	—	—
7	600009	中信银行	—	—
8	600015	光大银行	—	—
9	600012	工商银行	—	—
10	600018	华商银行	—	—
11	600017	交通银行	—	—
12	600019	中信银行	—	—
13	600016	民生银行	—	—
14	600015	光大银行	—	—
15	600012	工商银行	—	—
16	600018	华商银行	—	—
17	600017	交通银行	—	—
18	600019	中信银行	—	—
19	600016	民生银行	—	—
20	600015	光大银行	—	—
21	600012	工商银行	—	—
22	600018	华商银行	—	—
23	600017	交通银行	—	—
24	600019	中信银行	—	—
25	600016	民生银行	—	—
26	600015	光大银行	—	—
27	600012	工商银行	—	—
28	600018	华商银行	—	—
29	600017	交通银行	—	—
30	600019	中信银行	—	—
31	600016	民生银行	—	—
32	600015	光大银行	—	—
33	600012	工商银行	—	—
34	600018	华商银行	—	—
35	600017	交通银行	—	—
36	600019	中信银行	—	—
37	600016	民生银行	—	—
38	600015	光大银行	—	—
39	600012	工商银行	—	—
40	600018	华商银行	—	—
41	600017	交通银行	—	—
42	600019	中信银行	—	—
43	600016	民生银行	—	—
44	600015	光大银行	—	—
45	600012	工商银行	—	—
46	600018	华商银行	—	—
47	600017	交通银行	—	—
48	600019	中信银行	—	—
49	600016	民生银行	—	—
50	600015	光大银行	—	—
51	600012	工商银行	—	—
52	600018	华商银行	—	—
53	600017	交通银行	—	—
54	600019	中信银行	—	—
55	600016	民生银行	—	—
56	600015	光大银行	—	—
57	600012	工商银行	—	—
58	600018	华商银行	—	—
59	600017	交通银行	—	—
60	600019	中信银行	—	—
61	600016	民生银行	—	—
62	600015	光大银行	—	—
63	600012	工商银行	—	—
64	600018	华商银行	—	—
65	600017	交通银行	—	—
66	600019	中信银行	—	—
67	600016	民生银行	—	—
68	600015	光大银行	—	—
69	600012	工商银行	—	—
70	600018	华商银行	—	—
71	600017	交通银行	—	—
72	600019	中信银行	—	—
73	600016	民生银行	—	—
74	600015	光大银行	—	—
75	600012	工商银行	—	—
76	600018	华商银行	—	—
77	600017	交通银行	—	—
78	600019	中信银行	—	—
79	600016	民生银行	—	—
80	600015	光大银行	—	—
81	600012	工商银行	—	—
82	600018	华商银行	—	—
83	600017	交通银行	—	—
84	600019	中信银行	—	—
85	600016	民生银行	—	—
86	600015	光大银行	—	—
87	600012	工商银行	—	—
88	600018	华商银行	—	—
89	600017	交通银行	—	—
90	600019	中信银行	—	—
91	600016	民生银行	—	—
92	600015	光大银行	—	—
93	600012	工商银行	—	—
94	600018	华商银行	—	—
95	600017	交通银行	—	—
96	600019	中信银行	—	—
97	600016	民生银行	—	—
98	600015	光大银行	—	—
99	600012	工商银行	—	—
100	600018	华商银行	—	—

2. 报告期未按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 医药、生物制品	55,660,070.71	3.13
B 制造业	1,154,362,433.27	47.65
D 电力、热力、燃气及水利生产和供应业	19,930,521.00	0.91
F 金融业	86,226,662.52	3.78
G 信息技术业	—	—
H 交通运输、仓储和邮政业	—	—
I 批发和零售业	—	—
J 房地产业	—	—
K 建筑业	—	—
L 采矿业	186,295,433.20	7.99
M 其他制造业	—	—
N 其他服务业	237,851,404.30	9.82
合计	1,862,978,816.00	81.24
P 待分类资产	63,817,750.00	0.26
Q 其他资产	124,000,000.00	5.14
合计	214,817,750.00	9.17

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	600000	浦发银行	5,006,349	2,073,748,811.07	84.1
2	601988	招商银行	4,526,349	2,073,748,811.07	84.1
3	600036	招商银行	197,000,000	99,740,000.00	4.08
4	601288	农业银行	197,000,000	99,740,000.00	4.08
5	600016	民生银行	—	—	—
6	600028	中国银行	—	—	—
7	600009	中信银行	—	—	—
8	600015	光大银行	—	—	—
9	600012	工商银行	—	—	—
10	600018	华商银行	—	—	—

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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
6	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
7	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
8	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
9	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
10	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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

序号	权证代码	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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	权证代码	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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	权证代码	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
2	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
3	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
4	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12
5	130101	13国债01	1,000,000	99,750,000.00	4.12

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