

(上接B01版)

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	—	—
C	制造业	333,281,156.13	3.95
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	88,399,268.79	1.06
E	建筑业	10,956,997.93	0.13
F	批发和零售业	31,019,400.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	361,388,908.16	4.28
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,423,000.00	0.17
J	金融业	142,389,497.92	1.69
K	房地产业	—	—
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	2,497,400.00	0.03
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	合计	964,105,528.57	11.42

(三)、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	601006	大秦铁路	49,658,800	331,720,784.00	3.93
2	601619	北方导航	10,000,000	75,900,000.00	0.90
3	600741	华鲁汽车	5,858,470	56,241,312.00	0.67
4	603328	交通银行	11,581,864	43,779,445.92	0.52
5	600886	国投电力	9,500,000	43,700,000.00	0.52
6	601877	正海电器	1,553,583	38,047,247.67	0.45
7	600578	京沪高铁	10,494,281	37,351,368.79	0.44
8	600519	贵州茅台	21,934	34,024,872.70	0.40
9	601179	东珠集团	2,500,000	28,500,000.00	0.33
10	600699	上海机场	2,207,488	27,463,24.16	0.33

(四)、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	43,326.00	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,804,996,000.00	21.39
4	其中:政策性金融债	1,804,996,000.00	21.39
4-1	企业债券	2,303,058,888.07	28.35
5	企业短期融资券	1,235,262,000.00	14.64
6	中期票据	2,510,515,000.00	29.74
7	可转债	97,430,299.60	1.15
8	其他	—	—
9	合计	8,040,790,533.67	95.27

报告期末公允价值占基金资产净值比例大于8.0%的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126018	06国债18	4,778,610	425,267,171.80	5.04
2	122968	11国债01	3,970,150	391,853,805.00	4.64
3	120219	12国债19	3,700,000	366,448,000.00	4.34
4	126014	06国债04	2,573,410	256,113,636.00	3.04
5	130027	13国债27	2,250,000	5,719,070,000.00	2.66

(六)、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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)、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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(八)、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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

(九)、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

(十)、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一)、投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券中的发行主体未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、处罚的情况说明:

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票范围。

三、基金资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	590,240.16
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	—
5	应收申购款	171,740,077.45
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	172,330,317.61

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	113001	中债国债	80,666,899.60	0.96
2	122809	深市转债	16,763,490.00	0.20

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

二、基金的业绩

基金经理人张明强任职以来,秉承以诚、勤勉、尽责的职业道德,运用基金管理人,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益,基金的投资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本基金的招募说明书。

(一)投资组合业绩情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	964,105,528.57	9.76
2	固定收益投资	964,105,528.57	9.76
3	固定收益投资	8,040,790,533.67	81.57
4	资产支持证券	8,040,790,533.67	81.57
5	贵金属投资	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	524,634,626.93	5.31
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	其他资产	172,330,317.61	1.74
10	合计	9,913,524,431.32	100.00

(二)投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中的发行主体未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、处罚的情况说明:

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票范围。

三、基金资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

<p>(上接B014页)</p> <p>(109) 名称: 上海长量基金销售有限公司 注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2202室 办公地址: 上海市浦东新区福山路65号裕阳国际B座16层 法定代表人: 朱皓彬 联系人: 陈皓彬 电话: 021-58788767-8201 客服电话: 400-089-1289 公司网站: www.ewichfund.com</p> <p>(110) 名称: 深圳众信基金销售有限公司 注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦26楼1单元 办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦26楼1单元 法定代表人: 高振峰 联系人: 李海婧 电话: 0755-33227960 客服电话: 4006-788-887 公司网站: www.zxinv.com</p> <p>(111) 名称: 华泰证券股份有限公司 注册地址: 深圳市福田区中心区东海路18号安联大厦28层A01、B0101单元 办公地址: 深圳市福田区中心区东海路18号安联大厦28层A01、B0101单元 法定代表人: 李洪军 联系人: 李洪军 电话: 021-64361642 客服电话: 021-54663629 公司网站: www.htsc.com.cn</p> <p>(112) 名称: 中山证券有限责任公司 注册地址: 广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层 办公地址: 广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层 法定代表人: 吴永良 联系人: 吴永良 电话: 0755-82934755 客服电话: 4001-022011 公司网站: www.zszq.com</p> <p>(113) 名称: 中国银河证券股份有限公司 注册地址: 北京市西城区金融大街19号4层 办公地址: 北京市西城区金融大街19号4层 法定代表人: 李伟 联系人: 李伟 电话: 010-66568825 客服电话: 4001-022011 公司网站: www.chinastock.com.cn</p> <p>(114) 名称: 上海好买基金销售有限公司 注册地址: 上海市虹口区吴淞路393号4楼440室 办公地址: 上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室 法定代表人: 杨文斌 联系人: 杨文斌 电话: 021-58870011 客服电话: 4007-009605 公司网站: www.howbuy.com</p> <p>(115) 名称: 浙江同花顺基金销售有限公司 注册地址: 浙江省杭州市文一路9号元茂大厦903室 办公地址: 浙江省杭州市文一路9号元茂大厦903室 法定代表人: 凌顺平 联系人: 凌顺平 电话: 0571-88918188-8505 客服电话: 0571-88900423 公司网站: www.5ifund.com</p> <p>(116) 名称: 深圳前海微众银行股份有限公司 注册地址: 深圳市福田区田然道228号微众银行大厦主楼4楼(07) 办公地址: 深圳市福田区田然道228号微众银行大厦主楼4楼(07) 法定代表人: 孙建忠 联系人: 孙建忠 电话: 0755-3376853 客服电话: 4006-788-887 公司网站: www.welink.com</p> <p>(117) 名称: 中期资产管理有限公司(北京)有限公司 注册地址: 北京市朝阳区建国门外大街15号11层1103号 办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街15号11层1103号 法定代表人: 路路 联系人: 路路 电话: 010-65060784 客服电话: 95162, 4008881600 公司网站: www.CICFOFUND.COM</p> <p>(118) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(119) 名称: 太平洋证券股份有限公司 注册地址: 云南省昆明市青年路389号金源大厦10楼 办公地址: 云南省昆明市青年路389号金源大厦10楼 法定代表人: 陈树德 联系人: 陈树德 电话: 021-68877940 客服电话: 021-68877940 公司网站: www.tpy.com.cn</p> <p>(120) 名称: 和讯信息科技有限公司 注册地址: 北京市朝阳区朝外大街22号15层1501室 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号15层1501室 法定代表人: 陈彤 联系人: 陈彤 电话: 010-57778888 客服电话: 4006-788-887 公司网站: www.hxw.com.cn</p> <p>(121) 名称: 和讯信息科技有限公司 注册地址: 北京市朝阳区朝外大街22号15层1501室 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号15层1501室 法定代表人: 陈彤 联系人: 陈彤 电话: 010-57778888 客服电话: 4006-788-887 公司网站: www.hxw.com.cn</p> <p>(122) 名称: 和讯信息科技有限公司 注册地址: 北京市朝阳区朝外大街22号15层1501室 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号15层1501室 法定代表人: 陈彤 联系人: 陈彤 电话: 010-57778888 客服电话: 4006-788-887 公司网站: www.hxw.com.cn</p>	<p>联系人: 吴阿勇 联系电话: 0755-82271160-8642 业务传真: 0755-8202965 客服热线: 4000200022 公司网站: www.hxun.com</p> <p>(123) 名称: 浙江金顺顺资产管理有限公司 注册地址: 浙江杭州西湖区西溪路555号D座1801室 办公地址: 浙江杭州西湖区西溪路555号D座1801室 法定代表人: 陆伟彬 联系人: 刘芳勇 电话: 0571-56029620 业务传真: 0571-56899710 公司网站: www.jinshun.com</p> <p>(124) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(125) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(126) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(127) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(128) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(129) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(130) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(131) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(132) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(133) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(134) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(135) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(136) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(137) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(138) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(139) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(140) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(141) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(142) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-59393023 客服电话: 400-000-0000 公司网站: www.fund.com</p> <p>(143) 名称: 方正证券股份有限公司 注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街15号11层1103号 法定代表人: 李俊杰 联系人: 李俊杰 电话: 010-593930</p>
--	--