

(上接B018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		39,147,492.24	3.31
B 畜牧业		45,969,111.91	3.88
C 制造业		50,653,036.78	42.71
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		11,595,443.99	0.98
E 建筑业		74,121,214.10	6.26
F 批发和零售业		18,241,645.67	1.54
G 交通运输、仓储和邮政业		26,989,557.81	2.28
H 住宿和餐饮业		-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业		168,434,080.36	14.23
J 金融业		333,826,011.73	2.86
K 房地产业		155,304,870.41	13.12
L 租赁和商务服务业		-	-
M 科学研究、技术服务及地质勘查业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		-	-
O 仪器仪表、量具、修理和其他服务业		-	-
P 教育		1,730,622.80	0.15
Q 卫生和社会工作		-	-
R 文化、体育和娱乐业		11,701,091.52	0.99
S 综合		-	-
合计		1,092,718,179.12	92.31

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	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000671	阳光城	6,802,198	85,707,694.80	7.24
2	002153	蓝思科技	45,122,888.67	3.81	
3	000610	誉衡药业	8,838,197	42,785,091.51	3.61
4	000835	上海机场	2,062,877	38,947,177.76	3.29
5	002421	达意隆	966,990	30,653,583.00	2.59
6	000712	深物业A	1,535,946	27,170,884.74	2.30
7	002357	富临运业	1,744,031	26,980,159.57	2.28
8	002642	冀东水泥	846,159	26,035,235.63	2.20
9	000402	金融街	3,967,994	25,553,881.36	2.16
10	002366	月新股份	782,730	25,243,042.50	2.13

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	国债	-	-
2	央票	-	-
3	金融债	80,078,000.00	6.76
4	企业债	80,078,000.00	6.76
5	企短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	80,078,000.00	6.76

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十名债券投资明细

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	140436	14农企36	300,000	30,045,000.00	4.23
2	140512	14国开12	300,000	30,033,000.00	3.54

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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期内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

注:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

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

注:本基金本报告期内未持有权证。

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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有权证投资的期权投资

注:本基金投资操作均通过各券商主体,其纳税义务按国家税法、法规执行。

10.报告期末按公允价值占基金的国债到期交易情况说明

(1)报告期末未持有国债投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有国债投资的期权投资

注:本基金本报告期内未投资国债。

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股票投资明细

注:本基金本报告期内未持有股票投资。

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债券投资明细

注:本基金本报告期内未持有债券投资。

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贵金属投资明细

注:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

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

注:本基金本报告期内未持有权证。

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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有权证投资的期权投资

注:本基金投资操作均通过各券商主体,其纳税义务按国家税法、法规执行。

16.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期内未持有债券投资。

17.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

注:本基金本报告期内未持有资产支持证券。

18.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:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

19.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

注:本基金本报告期内未持有权证。

20.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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有权证投资的期权投资

注:本基金投资操作均通过各券商主体,其纳税义务按国家税法、法规执行。

21.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

注:本基金本报告期内未持有股票投资。

22.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

注:本基金本报告期内未持有债券投资。

23.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:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

24.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

注:本基金本报告期内未持有权证。

25.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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有权证投资的期权投资

注:本基金投资操作均通过各券商主体,其纳税义务按国家税法、法规执行。

26.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

注:本基金本报告期内未持有股票投资。

27.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

注:本基金本报告期内未持有债券投资。

28.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:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

29.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

注:本基金本报告期内未持有权证。

30.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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有权证投资的期权投资

注:本基金投资操作均通过各券商主体,其纳税义务按国家税法、法规执行。

31.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

注:本基金本报告期内未持有股票投资。

32.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

注:本基金本报告期内未持有债券投资。

33.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:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

34.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

注:本基金本报告期内未持有权证。

35.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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有权证投资的期权投资

注:本基金投资操作均通过各券商主体,其纳税义务按国家税法、法规执行。

36.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

注:本基金本报告期内未持有股票投资。

37.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

注:本基金本报告期内未持有债券投资。

38.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:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

39.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

注:本基金本报告期内未持有权证。

40.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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的期货指定期货持仓和损益明细

(2)报告期末未持有权证投资的期权投资

注:本基金投资操作均通过各券商主体,其纳税义务按国家税法、法规执行。

41.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

注:本基金本报告期内未持有股票投资。

42.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

注:本基金本报告期内未持有债券投资。

43.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:本基金本报告期内未持有贵金属投资。

44.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

注:本基金本报告期内未持有权证。

45.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衍生品投资明细

(1)报告期末未持有权证投资的