

(上接B005版)

(一)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	权证投资	5,000,000,000.00	44.94
其中：股票		5,000,000,000.00	44.94
2	固定收益投资	5,896,778,263.21	53.00
其中：债券		5,856,778,263.21	52.64
	货币市场工具	40,000,000.00	0.36
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产		-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,789,310.00	0.14
7	其他资产	213,635,569.23	1.92
合计		11,255,700,673.74	100.00

注：本基金资产于中国石化销售有限公司股权共计5,000,000,000.00元，列示于“权益投资—股票”项下。

(二)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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产、供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,000,000,000.00	49.25
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	综合	-	-
合计		5,000,000,000.00	49.25

注：本基金资产于中国石化销售有限公司股权共计5,000,000,000.00元，列示于股票投资项下。

(三)按照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	采掘、农、渔业	-	-
B	化工、石油、有色	-	-
C	医药	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产、供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,000,000,000.00	49.25
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	综合	-	-
合计		5,000,000,000.00	49.25

注：本基金资产于中国石化销售有限公司股权共计5,000,000,000.00元，列示于股票投资项下。

(四)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	-	400,000,000	5,000,000,000.00	49.25
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-
合计				5,056,778,263.21	57.69

注：本基金资产于中国石化销售有限公司股权共计5,000,000,000.00元，列示于股票投资项下。

注：按照行业分类的股票投资组合比例大小排名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	-	-	400,000,000	5,000,000,000.00	49.25
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-
合计				5,056,778,263.21	57.69

注：按照行业分类的股票投资组合比例大小排名的前十名股票投资明细。

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140146058	14正CPO02	3,000,000,000	299,190,000.00	2.95
2	122092	11皇马B2	1,730,000,000	175,249,000.00	1.73
3	122310	13中企债	1,550,000,000	158,100,000.00	1.56
4	122094	09机械B	1,540,000,000	154,046,200.00	1.52
5	101554009	15INTM001	1,500,000,000	150,675,000.00	1.48
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-
合计				5,056,778,263.21	57.69

注：按照行业分类的股票投资组合比例大小排名的前十名股票投资明细。

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123561	14乐投01	400,000,000	40,000,000.00	0.39
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-
合计				5,056,778,263.21	57.69

注：按照行业分类的股票投资组合比例大小排名的前十名股票投资明细。

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-
合计				5,056,778,263.21	57.69

注：按照行业分类的股票投资组合比例大小排名的前十名股票投资明细。

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------