

(上接A27版)

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	300024	机器人	195,642	11,092,901.40	0.87
2	300168	万达信息	360,721	10,893,954.45	0.86
3	002439	百润股份	433,953	10,079,101.90	0.86
4	600446	金证股份	421,818	10,178,395.38	0.84
5	002707	立讯精密	258,344	10,156,343.22	0.80
6	300271	华宇软件	277,688	9,788,500.00	0.77
7	002699	捷顺科技	580,300	9,615,571.00	0.76
8	002658	晋能电气	467,419	9,142,154.64	0.72
9	600571	信达地产	202,106	9,064,454.10	0.71
10	300059	东方财富	247,023	8,887,887.54	0.70
4.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的第十五名债券投资明细					
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	110001	国家债	300,764,598.60	33.67	
2	110001	央行票据	-	-	-
3	110001	金融债	-	-	-
4	110001	企业债	922,995,103.80	72.63	
5	110001	企短融	-	-	-
6	110001	中期票据	281,982,000.00	22.19	
7	110001	可转债	480,966,985.70	37.85	
8	110001	其他	-	-	-
9	110001	合计	1,986,708,688.10	156.33	
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贵金属投资明细					
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	010107	21国债(7)	2,819,580	300,764,598.60	33.67
2	111008	电气转债	1,392,250	182,593,575.00	14.37
3	132001	14国债(6)	1,202,360	146,327,212.00	11.51
4	120009	歌尔转债	1,099,920	130,562,457.60	10.27
5	110303	格力转债	895,620	116,564,940.00	9.17
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房产投资明细					
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	010107	21国债(7)	2,819,580	300,764,598.60	33.67
2	111008	电气转债	1,392,250	182,593,575.00	14.37
3	132001	14国债(6)	1,202,360	146,327,212.00	11.51
4	120009	歌尔转债	1,099,920	130,562,457.60	10.27
5	110303	格力转债	895,620	116,564,940.00	9.17
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债权投资明细					
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	010107	21国债(7)	2,819,580	300,764,598.60	33.67
2	111008	电气转债	1,392,250	182,593,575.00	14.37
3	132001	14国债(6)	1,202,360	146,327,212.00	11.51
4	120009	歌尔转债	1,099,920	130,562,457.60	10.27
5	110303	格力转债	895,620	116,564,940.00	9.17
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	300024	机器人	195,642	11,092,901.40	0.87
2	300168	万达信息	360,721	10,893,954.45	0.86
3	002439	百润股份	433,953	10,079,101.90	0.86
4	600446	金证股份	421,818	10,178,395.38	0.84
5	002707	立讯精密	258,344	10,156,343.22	0.80
6	300271	华宇软件	277,688	9,788,500.00	0.77
7	002699	捷顺科技	580,300	9,615,571.00	0.76
8	002658	晋能电气	467,419	9,142,154.64	0.72
9	600571	信达地产	202,106	9,064,454.10	0.71
10	300059	东方财富	247,023	8,887,887.54	0.70
9.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的第十五名债券投资明细					
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	110001	国家债	300,764,598.60	33.67	
2	110001	央行票据	-	-	-
3	110001	金融债	-	-	-
4	110001	企业债	922,995,103.80	72.63	
5	110001	企短融	-	-	-
6	110001	中期票据	281,982,000.00	22.19	
7	110001	可转债	480,966,985.70	37.85	
8	110001	其他	-	-	-
9	110001	合计	1,986,708,688.10	156.33	
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	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	010107	21国债(7)	2,819,580	300,764,598.60	33.67
2	111008	电气转债	1,392,250	182,593,575.00	14.37
3	132001	14国债(6)	1,202,360	146,327,212.00	11.51
4	120009	歌尔转债	1,099,920	130,562,457.60	10.27
5	110303	格力转债	895,620	116,564,940.00	9.17
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十名货币市场基金投资明细					
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	010107	21国债(7)	2,819,580	300,764,598.60	33.67
2	111008	电气转债	1,392,250	182,593,575.00	14.37
3	132001	14国债(6)	1,202,360	146,327,212.00	11.51
4	120009	歌尔转债	1,099,920	130,562,457.60	10.27
5	110303	格力转债	895,620	116,564,940.00	9.17
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	300024	机器人	195,642	11,092,901.40	0.87
2	300168	万达信息	360,721	10,893,954.45	0.86
3	002439	百润股份	433,953	10,079,101.90	0.86
4	600446	金证股份	421,818	10,178,395.38	0.84
5	002707	立讯精密	258,344	10,156,343.22	0.80
6	300271	华宇软件	277,688	9,788,500.00	0.77
7	002699	捷顺科技	580,300	9,615,571.00	0.76
8	002658	晋能电气	467,419	9,142,154.64	0.72
9	600571	信达地产	202,106	9,064,454.10	0.71
10	300059	东方财富	247,023	8,887,887.54	0.70
13.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的第十五名债券投资明细					
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	110001	国家债	300,764,598.60	33.67	
2	110001	央行票据	-	-	-
3	110001	金融债	-	-	-
4	110001	企业债	922,995,103.80	72.63	
5	110001	企短融	-	-	-
6	110001	中期票据	281,982,000.00	22.19	
7	110001	可转债	480,966,985.70	37.85	
8	110001	其他	-	-	-
9	110001	合计	1,986,708,688.10	156.33	
14.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的第十五名权证投资明细					
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	010107	21国债(7)	2,819,580	300,764,598.60	33.67
2	111008	电气转债	1,392,250	182,593,575.00	14.37
3	132001	14国债(6)	1,202,360	146,327,212.00	11.51
4	120009	歌尔转债	1,099,920	130,562,457.60	10.27
5	110303	格力转债	895,620	116,564,940.00	9.17
6	300271	华宇软件	277,688	9,788,500.00	0.77
7	002699	捷顺科技</td			