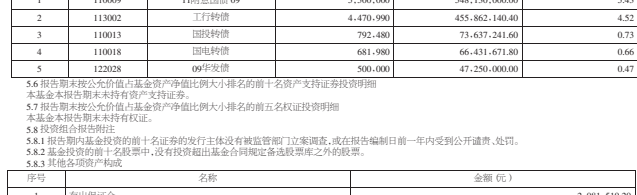


E	建筑业		706,420,000.00	7.60	
F	采矿业, 冶炼业		795,270,000.00	7.89	
G	交通运输业		178,285,000.00	1.77	
H	批发和零售业		140,806,114.00	1.40	
I	金融业, 保险业		2,688,999,023.87	26.23	
J	房地产业		1,144,286,102.87	11.00	
K	住宿餐饮业		-	-	
L	租赁与服务业		97,179,064.92	0.93	
M	其他行业		843,562,527.55	8.37	
	合计		9,432,566,579.45	93.57	
5.3 报告期末, 公司前五大金融资产净值(扣除公允价值变动损益)占报告期末总资产的比例					
序号	金融资产	账面价值 (单位: 元)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	
1	000004 上海汽车	56,973,150	910,431,080.82	9.02	
2	000002 万科 A	123,999,020	897,759,420.80	8.90	
3	000006 五粮液	111,000,000	785,470,430.00	7.80	
4	000004 中国铝业	209,000,000	768,420,000.00	7.60	
5	000036 招商银行	56,500,000	624,890,000.00	6.19	
6	000308 工商银行	151,000,000	600,080,000.00	5.96	
7	000318 中国平安	15,240,000	511,912,093.30	5.07	
8	000660 华鲁恒升	38,499,996	347,587,963.84	3.44	
9	000001 浦发银行	17,489,728	326,246,691.83	3.24	
10	000088 招商银行	50,547,834	307,267,960.88	3.02	
5.4 报告期末, 公司前五大金融资产净值(扣除公允价值变动损益)占报告期末总资产的比例					
序号	债券品种	账面价值 (单位: 元)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	
1	国债逆回购	-	\$48,130,000.00	5.43	
2	银行票据	-	-	-	
3	金融债券	-	-	-	
4	企业债券	-	47,250,000.00	0.47	
5	地方政府债	-	50,200,000.00	0.60	
6	中期票据	-	-	-	
7	可转债	-	611,173,784.20	6.06	
8	其他	-	-	-	
9	合计	-	1,246,735,784.20	12.36	
5.5 报告期末, 公司前五大金融资产净值(扣除公允价值变动损益)占报告期末总资产的比例					
序号	债券代码	债券名称	账面价值 (单位: 元)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)



2	应付证券清算款		30,982,773.57	
3	应付股利		0	
4	应付利息		12,107,177.13	
5	应付中短期融资券		1,407,015.54	
6	其他应付款			
7	待摊费用			
8	其他			
9	合计		66,578,443.34	

5.8.6 报告期末持有待分类的资产中可供出售金融资产明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	110012	工行转债	455,462,860.92	4.52
2	110001	国电转债	71,657,234.09	0.71
3	110001	中行转债	10,081,062.00	0.10
4	110016	川投转债	5,161,038.00	0.05

5.8.7 报告期末前十大股票中存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.8 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.9 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.10 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.11 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.12 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.13 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.14 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.15 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.16 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.17 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

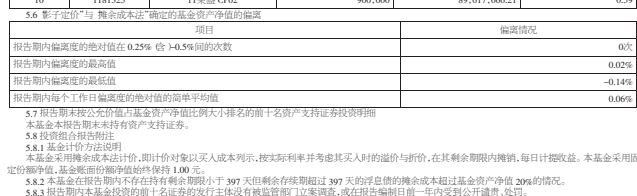
5.8.18 报告期末前十大股票中不存在流通受限情况的明细表

序号	股票名称	公允价值(元)	占金融资产净额比例(%)
1	中国工商银行	455,462,860.92	4.52
2	中国工商银行	71,657,234.09	0.71
3	中国工商银行	10,081,062.00	0.10
4	中国工商银行	5,161,038.00	0.05

5.8.19

[illegible]

本期报告期内买入并持有至到期投资公允价值变动损益不超过 180 元。				
5.5.2 报告期末按资产公允价值计量的金融资产公允价值分布表				
序号	资产类别和期限	金融资产公允价值资产公允价值变动损益(元)	公允价值变动损益占资产公允价值(元)的比例(%)	公允价值变动损益占资产公允价值(元)的比例(%)
1	30天以内	32.95	5.05	
2	30天<持有期限不超过 90 天的资产公允价值	1.35		
3	30 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	12.67		
4	90 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	26.40		
5	30 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	2.92		
6	30 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	14.55		
7	90 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	-		
8	180 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	18.32		
9	30 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	-		
10	30 天 < 持有期限不超过 90 天的资产公允价值	104.29	5.05	
5.6 报告期末按公允价值计量的金融资产公允价值分布表				
序号	资产类别和期限	公允价值变动(元)	公允价值变动损益占资产公允价值(元)的比例(%)	
1	货币类资产	-		
2	权益类资产	-		
3	金融负债	1,548,970,527.56	8.86	
4	资产<权益类金融负债	2,284,730,471.09	8.48	
5	金融负债	256,532,503.85	1.68	
6	资产<金融负债	4,043,256,163.09	27.91	
7	中国境外资产	-		
8	其他	-		
9	资产	5,686,759,184.53	37.47	
10	资产<资产不超过 90 天的资产公允价值	6,686,734,568.56	42.27	
5.6.5 报告期末按公允价值计量的金融资产公允价值变动损益占公允价值 10%以上资产公允价值分布表				
序号	资产类别和期限	公允价值变动(元)	公允价值变动(元)	公允价值变动损益占资产公允价值(元)的比例(%)
1	07/02/11	4,400,000	444,416,482.62	2.93
2	11/02/17	4,400,000	294,252,065.11	2.60
3	09/04/17	2,000,000	246,622,352.94	1.39
4	04/18/006	1,500,000	149,851,993.58	0.95
5	11/12/006	1,200,000	120,002,135.41	0.79
6	02/02/12	1,000,000	100,011,770.32	0.66
7	02/02/12	1,000,000	99,996,564.82	0.66
8	11/02/21	1,000,000	99,996,564.81	0.66
9	08/02/21	1,000,000	99,827,456.99	0.66

[illegible][illegible]