



信息披露 Disclosure

2012年3月29日 星期四 **D104**

【北鼎103号】
43 国元证券
注册地址：无锡市县前东街168号国联大厦6层
办公地址：无锡市县前东街168号国联大厦6层
法定代表人：吴良忠
联系人：陈琳琳
开放式基金业务电话：95578
开放式基金业务传真：0551-2272100
网址：www.gjzq.com.cn

44 国都证券
注册地址：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常耀
联系人：常耀
联系电话：010-84183333
客户服务电话：400-818-8118
开放式基金业务传真：010-84183311-3389
网址：www.guodu.com

45 国信证券
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41-42层
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41-42层
联系人：卢长才
联系电话：0755-83199599 转 8133
开放式基金咨询电话：0755-83199511
开放式基金业务传真：0755-83199545
网址：www.guoxin.com.cn

46 国新证券
注册地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
联系人：冯静
联系电话：029-8740688
客户服务电话：029-95582
传真：029-87406387
网址：www.guoxin.com.cn

47 国安证券
注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市清溪路166号国安大厦A座
法定代表人：李工
联系人：甘霖
联系电话：0551-5161666
客户服务电话：96518、400-80-96518
开放式基金业务传真：0551-5161672
网址：www.huangqi.com

48 国联证券
办公地址：山西省太原市西桥69号山西国联中心东楼塔
注册地址：山西省太原市西桥69号山西国联中心东楼塔
法定代表人：段晓
联系人：郑耀
联系电话：0351-8686659
客户服务电话：95577或400-666-1618
传真：0351-8686619
网址：www.g618.com.cn

49 东吴证券
注册地址：苏州工业园区星阳街18号
办公地址：苏州工业园区星阳街18号
法定代表人：吴永敏
联系人：冯晓丹
联系电话：0512-65851136
客户服务电话：0512-3398288
传真：0512-65888201
网址：www.dwjq.com.cn

50 中原证券
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号17楼
法定代表人：程江涛
联系人：陈琳琳
联系电话：0371-65585670
开放式基金咨询电话：0771-9672118、4008139666
开放式基金业务传真：0771-65585665
网址：www.ccnew.com

51 东北证券
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：杨正中
联系人：潘楠
联系电话：0431-85096709
客户服务电话：4006-686-046、0431-85096733
网址：www.nbd.com.cn

52 国信证券
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1002层
法定代表人：李延兴
联系人：陈沛阳
联系电话：0755-82825551
客户服务电话：4008010010
传真：0755-82558355
网址：www.guoxin.com.cn

53 万联证券
注册地址：广州市中山二路18号广东电信大楼36-37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信大楼36-37层
法定代表人：董建军
联系人：罗剑斌
联系电话：020-37865070
客户服务电话：400-8888-133
开放式基金业务传真：020-22377118-1013
网址：www.wmlq.com.cn

54 中信证券（浙江）
注册地址：浙江杭州滨江区长江大道688号中信大厦主楼19、20层
办公地址：浙江杭州滨江区长江大道688号中信大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：丁慧恩
联系电话：0571-87112510
客户服务电话：96598
传真：0571-85100383
网址：www.bjzq.com.cn

55 南京证券
注册地址：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：孙刚
联系电话：025-83367888-4201
客户服务电话：400-828-5888
传真：025-83320066
网址：www.njzq.com.cn

56 中信万通证券
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（4507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
联系电话：0532-85022326
客户服务电话：0532-96577
传真：0532-4002605
网址：www.cwt.com.cn

57 财富证券
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
联系人：郭晓
联系电话：0731-84403360、0731-84403330
业务投诉电话：0731-84403350
开放式基金业务传真：0731-84403439
网址：www.cfzq.com

58 国都证券
注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
联系人：张巧玲
联系电话：0769-22116655
开放式基金咨询电话：0769-961130
开放式基金业务传真：0769-22119423
网址：www.gdjq.com.cn

59 金元证券
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：陆涛
联系人：陆涛
联系电话：0755-83025022
客户服务电话：400-888-2288
传真：0755-83025625
网址：www.jyqzq.com

60 国海证券
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦2楼
法定代表人：张维群
联系人：李华平
联系电话：0755-43709350
客户服务电话：95561
传真：0755-83700205
网址：www.guohai.com.cn

61 广宇证券
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人：刘东
联系人：林浩雷
联系电话：020-88836999
客户服务电话：020-961303
联系人：陈永基
网址：www.guoyu.com.cn

62 第一创业证券
注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场南座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场南座25、26层
法定代表人：刘学民
联系人：田国良
联系电话：0755-25823852
客户服务电话：0755-25823283
网址：www.firstcapital.com.cn

63 招商证券
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦31楼01-04单元
办公地址：天津市津南区咸水沽西大街8号
法定代表人：杜庆平
联系人：王冠权
联系电话：022-28451861
客户服务电话：400-6515-988
传真：022-28451992

网址：www.hqzq.com

64 瑞信证券
注册地址：四川省成都市陕西路239号
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼（深圳总部）
法定代表人：李勇
联系人：赵昕
传真：021-68775878
联系人：倪丹
客户服务电话：68777777
网址：www.rf-china.com

65 瑞泰证券
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
法定代表人：朱晓斌
联系人：李勇
联系电话：0519-88157761
客户服务电话：0519-88166222、021-52574550、0379-64902266
免费服务热线：400-888-8588
传真：0519-88157761
网址：www.rjt.com.cn

66 齐鲁证券
注册地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李伟
联系人：吴阳
联系电话：0531-68880155
客户服务电话：95538
传真：0531-68899732
网址：www.qlzq.com.cn

67 唯实证券
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯成武
联系人：李斌
联系电话：010-88085588
客户服务电话：4008-000-562
传真：010-88081595
网址：www.vicsec.com

68 方正证券
注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：邵晓波
联系电话：0731-85832507
客户服务电话：95571
传真：0731-8583214
网址：www.fundsec.com

69 川财证券
注册 址： 深 圳 市 福 田 区 益 田 路 与 福 中 路 交 界 处 荣 超 商 务 中 心 A 栋 第 18 - 21 层 及 第 04 层
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23楼
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
注册 册 地 址： 深 圳 市 福 田 区 益 田 路 与 福 中 路 交 界 处 荣 超 商 务 中 心 A 栋 第 04、18 层 至 21 层
法定代表人：龙增光
联系人：刘锐
客户服务电话：0755-82023442
客户服务电话：400-600-8008
传真：0755-82026359
网址：www.china-irvsn.com

70 华融证券
注册地址：重庆市红岩寺路291号
办公地址：重庆市红岩寺路291号
法定代表人：王林
联系人：陈彬
联系电话：010-88086830-730
客户服务电话：010-88086830
传真：010-66142337
网址：www.huarong.com.cn

71 恒信证券
注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路14号
法定代表人：孔伟杰
联系人：陈彬
联系电话：010-88086830-730
客户服务电话：010-88086830
传真：010-66142337
网址：www.hxjq.com

72 华安证券
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
联系人：宋霖
联系电话：021-50122086
客户服务电话：400-820-9898
网址：www.huan.com.cn

73 联讯证券
注册地址：北京市西城区金融街15号新盛大厦6-9层
办公地址：北京市西城区金融街15号新盛大厦6-9层
法定代表人：赵建雄
联系人：李斌
客户服务电话：400-889-5618
网址：www.lxsec.com

74 西南证券
注册地址：重庆市江北桥北路8号
办公地址：重庆市江北桥北路8号西南证券大厦
法定代表人：王林
联系人：陈斌
联系电话：023-63784664
客户服务电话：400809096
传真：023-63786311
网址：www.swsc.com.cn

75 湘财证券
注册地址：北京市西城区金融大街1号A座8层
办公地址：北京市西城区金融大街1号A座8层
法定代表人：马金岭
联系人：孙皓
联系电话：010-83561449
客户服务电话：400-698-9908
开放式基金业务传真：010-83561094
网址：www.xcfz.com

76 华融证券
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄洪琳
联系人：张磊
联系电话：091-87383623
客户服务电话：0591-96236
传真：0591-87383610
网址：www.hqzq.com

77 信达证券
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：高冠江
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
客户服务电话：400-800-8899
传真：010-63080978
网址：www.cindasc.com

78 陈光标证券
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦12、15层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦12、15层
法定代表人：徐勇力
联系人：陈永利
联系电话：010-6555316
客户服务电话：400-8888-993
传真：010-6555246
网址：www.cdqz.net.cn

79 华龙证券
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路68号财富大厦
法定代表人：李俊庆
联系人：李海平
联系电话：0931-4890208
客户服务电话：0931-4890100、4890619、4890618、4890208
网址：www.hljzq.com

80 瑞银证券
注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：邵弘
联系人：邵弘
联系电话：010-58328366
客户服务电话：400-887-8827
传真：010-59227478
网址：www.abnrochina.com

81 中山证券
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：吴永基
联系人：李珍
客户服务电话：4001020211
网址：www.zsq.com.cn

82 厦门证券
注册地址：厦门市湖滨南路5号富厦大厦七楼
办公地址：厦门市湖滨南路2号富厦大厦七楼
法定代表人：傅德胜
联系人：卢文金
联系电话：0592-5161642
客户服务电话：0592-5163588
网址：www.xmzq.com

83 江海证券
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇华
联系电话：0451-82236683
客户服务电话：091-4890100、4890619、4890618、4890208
网址：www.jhzq.com.cn

84 华融证券
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号A座3、4层
法定代表人：丁志辉
联系人：海融
联系电话：010-5856040
客户服务电话：010-58568118
网址：www.hrsec.com.cn

85 中汇金公司
注册地址：北京市朝陽区建外大街1号国贸写字楼27层及28层
联系人：王雪路

联系电话：010-85679265
网址：www.zhq.com

86 财富里昂证券
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心C座
法定代表人：李勇
电话：021-38784818
传真：021-68775878
联系人：倪丹
客户服务电话：68777777
网址：www.cf-ib.com

87 注册证券
名称：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省广州市天河区珠江新城428号九洲广场东塔4001室
办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路25-28楼
法定代表人：钟卫英
电话：4008810888
传真：020-38799249
联系人：余倩
（三）律师事务所和经办律师
律师事务所：上海源泰律师事务所
地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人：廖海
电话：021 51150288
传真：021 51150398
经办律师：梁颖、刘佳
联系人：廖海
（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所：安永华明会计师事务所
注册地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场东三翼楼东三办公楼15层、16层
电话：010-51151300
传真：010-51188298
经办注册会计师：吕华、周刚
联系人：许建群

四、基金的名称
本基金名称：易方达消费行业股票型证券投资基金

五、基金的类型
本基金类别：股票型开放式

六、基金的投资目标
本基金主要投资于消费行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以投资于创业板市场发行、上市的股票及创业板上市公司发行的存托凭证。同时法律法规监管机构允许消费行业股票以外的品种，基金管理人可在法律法规许可范围内进行投资。

本基金为股票型基金，投资比例范围为：股票资产占基金资产的80%—95%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于中国证监会认定的主要消费行业和可选消费行业股票的比例不低于股票资产的95%。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略
本基金基于定量与定性相结合的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，追求更高收益，回避市场风险。

在资产配置上，本基金主要考虑：① 宏观经济指标，包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据、金融数据等，以判断经济波动对市场的影响；② 微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期；③ 市场方向性指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场供求关系及其变化；④ 政策因素，分析证券市场切实际的各种政策出台对市场的影响等。

2. 股票投资策略
① 消费行业股票的界定
本基金所指的消费行业由主要消费行业和可选消费行业组成。主要消费行业包括食品与主要用品零售行业、家庭及个人用品行业、食品、饮料与烟草行业、可选消费行业包括汽车与汽车零配件行业、耐用消费品与服务业行业、消费服务行业、媒体和广告行业等。本基金投资于中证指数公司界定的主要消费行业和可选消费行业股票的比例不低于股票资产的95%。

根据中证指数公司《关于行业分类的说明》，中证指数公司进行上市公司行业分类的方法为：中证指数有限公司根据上市公司正式公告中主营业务的收入为分类依据，如果公司主营业务收入无法确定行业分类，将同时考察主营业务收入与利润状况。上市公司行业划分原则如下：① 如果公司利润和主营业务收入占公司总收入、利润总额的50%以上，则该公司归属该行业对应的行业；② 如果公司没有一项业务收入与利润总额均占全部收入的30%以上，则该公司归属该业务对应的行业；③ 如果公司没有一项业务收入和利润均占到30%以上，则公司将通过进一步研究分析确定行业归属。

② 如果中证指数公司调整行业分类方法，或者基金管理人认为有更适当的消费行业划分标准，基金管理人可在履行适当程序后对消费行业的界定方法进行调整并及时公告。

③ 如因对消费行业的界定方法进行及时调整或者上市公司经营状况发生变化，本基金持有消费行业股票的比例低于股票资产的95%，本基金将在三个月之内进行调整。

3. 消费行业子行业配置策略
消费行业由主要消费行业和可选消费行业组成。主要消费行业和可选消费行业根据所提供的产品与服务类别不同，可划分为不同的子行业。本基金将综合考虑以下因素，进行股票资产在各消费子行业间的配置。

1）国家经济政策
本基金将跟踪监测国家财政与税收政策、货币政策、产业政策、贸易政策、汇率政策等政策的变化，分析国家政策对消费行业各子行业的影响，超越受益于国家政策变化、预期收益率较高的子行业，规避受国家政策影响、预期收益率较低的行业。

2）消费结构变化
随着我国居民收入水平提高，消费升级趋势越来越明显，导致消费升级行业公司业绩提升。本基金将对影响国内收入水平及消费结构的变化以及消费结构的变化趋势进行跟踪分析，发掘不同时期的消费升级主题，在不同子行业进行积极的轮动，不断优化资产配置。

3）经济周期
本基金将当前经济在经济周期所处的阶段进行前瞻分析，根据各子行业在经济周期各阶段的预期表现，进行行业配置与调整，为投资者追求更高回报。

4）子行业自身的生命周期
本基金将对各消费子行业的生命周期进行动态分析，判断各子行业所处的生命周期阶段，并采取相应的投资策略。

5）子行业基本面的变化
本基金将对影响各子行业基本面的因素进行跟踪分析，预期各子行业基本面变化的拐点，超越基本面即将发生有利变化的子行业，超越基本面即将发生不利变化的子行业。

6）子行业的相对估值水平
本基金将对各子行业的相对估值水平进行动态分析，增加城市市低估的子行业配置比例，降低盈利低于预期的子行业配置比例。

7）消费行业个股投资策略
在股票选择方面，本基金将从公司治理结构、核心竞争力、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务状况、股权激励等方面对基金投资组合中的消费行业上市公司进行综合评价，精选具有较高投资价值价值的上市公司，具体来讲，主要考虑的因素包括：
1）具有完善的法人治理结构；公司已建立起完善的法人治理结构，经营活动规范；
2）具有较领先的核心竞争力；公司在管理水平、人才储备、资源禀赋、品牌或业务模式等方面具有较领先的竞争优势；
3）具有较强的研发能力；对采购成本和销售价格控制能力较强；
4）市场占有率高；消费者对公司产品或服务忠诚度高，公司产品或服务市场占有率有较高且保持稳定或继续提高；
5）成长性较好；公司成长良好，预期营业收入增长率高于行业平均水平；
6）盈利能力较强；公司运营效率高，预期盈利能力强，净资产收益率高于行业平均水平；
7）运营效率高；公司运营效率高，总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率等指标在业内处于领先水平；
8）财务结构良好；公司资产负债结构良好，财务风险较低；
9）现金流充裕；公司现金流充足，能够满足运营的需要；
10）公司基本面即将发生重大变化；预期公司基本面处于变化的拐点，公司盈利能力将大幅提升。
8）估值水平公平
在消费行业股票的基础上，基金管理人将对备选股票进行估值分析。采用的估值方法包括市盈率法（PE）、市净率法（PB）、市销率法（长期成长法（PEG）、企业价值倍数法（EV/SALES）、企业价值息税前利润摊薄法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF、FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。

通过估值水平分析，基金管理人将发出价值被低估或估值合理的股票。

8）股票组合的构建与调整
本基金将根据对消费行业各子行业的综合分析，确定各子行业的资产配置比例，在各子行业上，本基金将选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的上市公司进行投资。当各子行业与上市公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本基金将对投资组合进行动态调整。

3. 债券投资策略
在债券投资方面，本基金将通过久期配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类别配置层面，结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的权重比例。

在券种选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，合理运用投资管理策略，实施积极主动的消费行业投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构变化，许多债券新品种和交易形式将增加债券投资组合模式，本基金可积极跟踪市场动态变化，选择适合的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。

4. 衍生产品投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

本基金将关注股指期货等国内金融衍生产品的推出情况，如法律法规允许基金机构允许基金进行衍生工具，本基金将制定与本基金投资目标相适应的投资策略，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

九、基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率*85%+中证综合收益指数*15%

本基金股票部分主要投资于主要消费行业和可选消费行业股票，中证内地消费主题指数成份股由主要消费行业股票和可选消费行业股票组成，具有较强的代表性，因此股票部分的业绩基准采用中证内地消费主题指数。固定收益部分的业绩基准则采用了市场普遍认可的债指数。此外，本基金还按照预期债券资产平均配置比例设置了业绩基准的权重。

如果标的指数暂停发布或编制方法发生变更，或有更适当的、更能与市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，调整业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征
本基金为主动股票基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种，理论上其风险收益水平高于混合基金和债券基金，同时，本基金为行业基金，在享受消费行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。

十一、基金投资组合报告（报告期末）
本基金管理人的董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金的投资人可通过中国证监会指定网站查询本报告基金合同的规定。已于2012年2月28日复核了本报告的内容，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2011年10月31日至2011年12月31日。

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,215,277,674.17	81.06
其中：股票	3,215,277,674.17	81.06	
2	固定收益投资	292,047,013.10	7.36
其中：债券	292,047,013.10	7.36	
资产支持证券	-	-	
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
5	银行存款和结算备付金合计	443,907,455.03	11.19
6	其他各项资产	15,114,438.80	0.38
7	合计	3,966,346,581.10	100.00

1. 报告期末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	10,348,800.00	0.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,008,936,827.00	52.09
CD	食品饮料	1,337,215,879.60	34.68
CE	纺织服装、皮毛	420,822,756.30	10.91
C2	化学、石化、塑胶	1,510,640.00	0.04
C4	造纸、印刷	27,400,000.00	0.71
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	213,585,623.09	5.54
C8	医药、生物制品	8,401,928.01	0.22
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	596,000.00	0.02
E	建筑业	35,788,975.20	0.93
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	45,628,500.16	1.18
H	批发和零售业	1,030,922,070.49	26.73
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	83,056,099.98	2.15
L	传播与文化产业	-	-
M	综合	-	-
合计		3,215,277,674.17	83.38

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	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	000568	泸州老窖	9,712,601	362,280,017.30	9.39
2	600694	大亚股份	9,148,491	305,792,980.48	7.93
3	600887	伊泰股份	14,499,979	296,234,570.97	7.68
4	002157	郑拓科技	19,920,000	190,415,200.00	4.94
5	600600	青岛啤酒	5,619,286	188,113,495.28	4.88
6	000963	华东医药	6,813,695	181,380,560.90	4.70
7	002397	梦洁家纺	6,896,598	180,690,867.60	4.69
8	600280	南京中商	6,886,849	172,377,830.47	4.47
9	000651	格力电器	8,300,000	143,507,000.00	3.72
10	600327	东方	18,060,000	130,393,200.00	3.38

4. 报告期末按消费品种分类的股票投资组合

序号	消费品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	192,125,000.00	4.98
其中：政策性金融债	192,125,000.00	4.98	
4	企业债	29,606,013.10	0.77
5	企业短期融资券	70,316,000.00	1.82
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	292,047,013.10	7.57

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	070419	07农发19	1,200,000	121,908,000.00	3.16
2	110414	11农发14	700,000	70,217,000.00	1.82
3	041161010	11浦发CP01	500,000	50,250,000.00	1.30
4	122978	11东阳光	299,990	29,406,013.10	0.77
5	1181282	11桂林银行CP01	200,000	20,066,000.00	0.52

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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持证券。

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权证投资明细
本基金本报告期末未有权证。

8. 投资组合报告附注

8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.2 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。

8.3 其他各项资产构成

序号	项目	名称	金额（元）
1	存出保证金	-	1,657,156.31
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	-	3,764,094.78
5	应收申购款	-	9,693,187.71
6	其他应收款	-	-
7	预付款项	-	-
8	其他	-	-
9			