

（上接 B30 版）

6.4.9 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 期末以公允价值计量的股票类流通受限证券

证券代码	证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
603328	依依电子	46,731,705.64	13.53

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌前收盘价(元)	复牌日期	复牌开盘价(元)	数量(股)	期末成本总额	期末公允价值	备注
601012	隆基股份	2014年6月19日	15.50	2014年7月1日	15.60	199,939	3,084,616.86	3,099,054.50	--

6.4.9.3 期末非公允价值计量的股票类流通受限证券

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌前收盘价(元)	复牌日期	复牌开盘价(元)	数量(股)	期末成本总额	期末公允价值	备注
601012	隆基股份	2014年6月19日	15.50	2014年7月1日	15.60	199,939	3,084,616.86	3,099,054.50	--

7.1 基金投资组合情况

7.1.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	--	--
2	固定收益投资	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	1,162,317,202.40	100.00

7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.1.3 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

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.5 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.1.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

7.1.7 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

7.1.8 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

7.1.9 期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

7.1.11 本期国债逆回购交易情况说明

7.1.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.1.13 本期国债期货投资评价

7.1.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.1.15 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.1.16 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.1.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	10,167,215.28	2.94
B	采矿业	--	--
C	制造业	46,731,705.64	13.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	--	--
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		56,898,920.92	16.47

注:以上行业分类为以中国证监会行业分类标准为依据。

7.1.18 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	占基金资产净值比例(%)
1	601766	中国南车	2,299,912	10,349,604.00	3.00
2	000998	隆平高科	369,986	10,167,215.28	2.94
3	000566	广生药业	449,875	8,579,116.25	2.48
4	601299	中国北车	1,800,000	8,172,000.00	2.37
5	002501	利源精制	399,931	5,435,062.29	1.57
6	002562	兄弟科技	334,784	4,486,105.60	1.30
7	601012	隆基股份	199,939	3,099,054.50	0.90
8	600063	皖能电力	1,000,000	2,450,000.00	0.71
9	000920	南方汇通	199,990	2,131,893.40	0.62
10	300274	阳光电源	121,960	2,013,559.60	0.58

注:以上行业分类为以中国证监会行业分类标准为依据。

7.1.19 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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科 A	34,726,697.72	10.05	
2	000671	阳光 城	19,257,383.26	5.58	
3	600003	曙光股份	11,359,283.63	3.29	
4	000423	东阿阿胶	10,986,618.12	3.18	
5	601766	中国南车	10,028,477.96	2.90	
6	000998	隆平高科	9,708,478.54	2.81	
7	000596	开普药业	8,588,657.45	2.49	
8	601019	国金证券	8,221,847.32	2.38	
9	601299	中国北车	8,109,906.00	2.35	
10	600887	伊利股份	7,957,177.05	2.30	
11	600266	北京城建	7,586,820.83	2.20	
12	600858	海螺水泥	7,414,299.83	2.15	
13	601166	兴业银行	6,233,769.39	1.80	
14	002501	利源精制	5,413,024.85	1.57	
15	000547	闽发铝业	5,382,369.70	1.56	
16	600729	重庆百货	5,094,379.74	1.48	
17	000656	金科股份	4,736,509.98	1.37	
18	600376	普开股份	4,518,385.50	1.31	
19	000768	中航飞机	4,434,557.92	1.28	
20	002562	兄弟科技	4,054,581.17	1.17	

注:上述买入金额为本基金买入成交金额(成交金额以成交数量),不包括相关交易费用。

7.1.20 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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科 A	33,411,409.67	9.67	
2	000671	阳光 城	17,132,180.87	4.96	
3	000423	东阿阿胶	9,602,250.78	2.78	
4	600003	曙光股份	9,379,449.69	2.72	
5	600109	国金证券	7,781,641.84	2.25	
6	000827	华发股份	7,668,297.37	2.22	
7	600266	北京城建	7,345,419.38	2.13	
8	601166	兴业银行	6,633,802.29	1.92	
9	601688	海螺水泥	5,977,600.00	1.73	
10	000547	闽发铝业	5,795,536.34	1.68	
11	600729	重庆百货	5,532,091.22	1.60	
12	600376	普开股份	5,362,409.24	1.55	
13	000768	中航飞机	4,426,037.61	1.28	
14	000656	金科股份	3,952,717.41	1.14	
15	600893	航空动力	2,283,726.46	0.66	

注:上述买入金额为本基金买入成交金额(成交金额以成交数量),不包括相关交易费用。

7.1.21 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	56,898,920.92	15.50
2	固定收益投资	59,499,000.00	25.47
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	1,362,397,012.73	99.97
5	买入返售金融资产	340,893.67	0.03
6	其他资产	367,078,740.05	100.00

7.1.22 期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------