



信息披露

2014年 11月 12日 星期三
zqsb@stcn.com (0755)83501570

B40

(上接B38版)				
1.报告期内基金资产组合情况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	11,102,385,611.30	94.49	
其中:股票		11,102,385,611.30	94.49	
2	固定收益投资	501,140,000.00	4.27	
其中:债券		501,140,000.00	4.27	
3	货币支持证券	-	-	
4	贵金属投资	-	-	
5	买入返售金融资产	-	-	
6	银行存款和结算备付金合计	105,779,949.03	0.90	
7	其他资产	40,143,831.63	0.34	
8	合计	11,749,449,391.76	100.00	

2.报告期末按行业分类的股票投资组合				
2.1.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	31,112,872.32	0.27	
B	采矿业	278,234,871.06	2.38	
C	制造业	6,471,533,757.87	55.35	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	102,630,814.74	0.88	
E	建筑业	125,346,699.75	1.07	
F	批发和零售业	252,340,590.32	2.16	
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-	
H	信息传输、软件和信息技术服务业	823,313,223.60	7.04	
J	金融业	1,242,143,728.26	10.62	
K	房地产业	852,802,718.20	7.29	
L	租赁和商务服务业	223,515,975.96	1.91	
M	科学研究和技术服务业	-	-	
N	水利、环境和公共设施管理业	334,052,527.71	2.86	
O	教育、体育和其他服务业	-	-	
P	卫生和社会工作	-	-	
R	文化、体育和娱乐业	242,031,658.07	2.07	
S	综合	123,237,053.64	1.05	
合计		11,102,385,611.30	94.96	

2.2.报告期末按股票投资行业分类的股票投资组合					
2.3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细					
2.4.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10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	000002	万科A	61,738,706	566,762,055.48	4.83
2	000051	格力电器	16,144,824	455,130,692.52	3.89
3	000001	平安银行	36,096,806	366,021,612.84	3.13
4	000033	美的集团	13,127,820	251,123,390.30	2.23
5	000264	苏宁云商	29,489,597	252,430,082.32	2.16
6	000058	五粮液	12,830,752	236,983,989.44	2.03
7	000776	广发证券	21,070,469	230,721,635.55	1.97
8	000063	中兴通讯	14,029,649	212,689,475.84	1.82
9	000625	长安汽车	14,564,056	199,539,897.20	1.71
10	000783	长江证券	24,870,848	169,867,891.84	1.45

2.5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细				
2.6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券投资明细				
2.7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名贵金属投资明细				
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	国债逆回购	-	-	
2	央行票据	-	-	
3	金融债券	501,140,000.00	4.29	
3	其中:政策性金融债	501,140,000.00	4.29	
4	企业债券	-	-	
5	企业短期融资券	-	-	
6	中期票据	-	-	
7	可转债	-	-	
8	其他	-	-	
9	合计	501,140,000.00	4.29	

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10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	140207	14债07	2,000,000	200,460,000.00	1.71
2	140429	14债29	2,000,000	200,460,000.00	1.71
3	140430	14债30	100,000,000	100,220,000.00	0.86
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10名资产支持证券投资明细					
本基金本报告期末未持有资产支持证券。					
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5名贵金属投资明细					
本基金本报告期末未持有贵金属。					
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10名权证投资明细					
本基金本报告期末未持有权证。					
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
9.1.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
本基金本报告期末未持有股指期货。					
9.2.本基金投资股指期货的投资策略					
本基金本报告期末未持有股指期货。					
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
10.1.本报告期末国债期货交易情况说明					
本基金本报告期末未持有国债期货。					
10.2.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
本基金本报告期末未持有国债期货。					
10.3.本报告期末国债期货交易投资策略					
本基金本报告期末未持有国债期货。					
11.1.基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚					
11.2.基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围					
11.3.其他资产构成					

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	670,363.47
2	应收证券清算款	23,890,517.32
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	11,363,890.88
6	其他应收款	4,218,080.96
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,143,831.63

(上接B38版)				
47 湘财证券股份有限公司				
住所、办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心C26楼			
法定代表人	陶勇	联系人	郭磊	
电话	0731 84403319	传真	0731 84403349	
网址	www.cftz.com			
客服电话	0731 84403360			
48 中信证券(山东)有限责任公司				
住所、办公地址	青岛市市南区深圳路22号青岛国际金融中心4号楼			
法定代表人	杨宝生	联系人	吴长德	
电话	0532 85022326	传真	0532 85022605	
网址	www.citicsec.com			
49 中银证券有限公司				
住所、办公地址	南昌红谷滩新区红谷大道1619号国际金融中心A座41楼			
法定代表人	杜磊	联系人	熊鹏	
电话	0791 86766861	传真	0791 86770178	
网址	www.bocib.com			
50 国信证券股份有限公司				
住所、办公地址	陕西省西安市东大街222号信义国际大厦16-17楼			
法定代表人	刘健武	联系人	刘莹	
电话	029 87416787	传真	029 87417012	
网址	www.guosen.com.cn			
51 恒泰证券股份有限公司				
住所、办公地址	内蒙古呼和浩特市新城区新华大街111号			
法定代表人	董介民	联系人	王旭华	
电话	010 66297386	传真	0471 4961259	
网址	www.chht.com.cn			
52 海通证券股份有限公司				
住所、办公地址	江苏省常州市延政西路23号海通大厦18层			
法定代表人	刘化军	联系人	王一座	
电话	021 20033910	传真	021 20498825	
网址	www.htzq.com.cn			
53 东方证券股份有限公司				
住所、办公地址	上海市中山南路318号2号楼22-29层			
法定代表人	潘鑫伟	联系人	陈宇	
电话	021 63325888	传真	021 63326173	
网址	www.dfq.com.cn			

11.4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。				
11.5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细				
本基金本报告期末未持有股票投资前10名股票中不存在流通受限情况的说明				
11.6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细				
本基金本报告期末未持有股票投资前10名股票中不存在流通受限情况的说明				
11.7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细				
本基金本报告期末未持有股票投资前10名股票中不存在流通受限情况的说明				
(三) 流通受限资产或公允价值投资组合报告				
1. 报告期末按公允价值组合情况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	954,356,765.28	62.21	
其中:股票		954,356,765.28	62.21	
2	固定收益投资	381,105,192.50	24.84	
其中:债券		381,105,192.50	24.84	
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:买入返售金融资产		-	-	
6	银行存款和结算备付金合计	184,221,879.34	12.01	
7	其他资产	14,517,908.53	0.95	
8	合计	1,534,201,745.65	100.00	

2.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	1,665,300.00	0.11	
B	采矿业	106,000,000.00	7.04	
C	制造业	504,199,047.57	33.56	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,580,683.31	2.70	
E	建筑业	-	-	
F	批发和零售业	44,148,266.10	2.93	
G	交通运输、仓储和邮政业	15,213,000.00	1.01	
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	
I	金融业	138,324,281.36	9.19	
J	房地产业	18,750,000.00	1.25	
K	租赁和商务服务业	28,402,500.00	1.89	
M	科学研究和技术服务业	-	-	
N	水利、环境和公共设施管理业	26,093,684.94	1.73	
O	教育、体育和其他服务业	-	-	
P	卫生和社会工作	-	-	
Q	文化、体育和娱乐业	-	-	
S	综合	-	-	
合计		954,356,765.28	63.41	

3.报告期末按公允价值
