

(上接630版)

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

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  | 000625 | 长安汽车 | 14,500,000 | 149,350,000.00 | 8.72         |
| 2  | 300171 | 东富龙  | 3,853,010  | 116,669,142.80 | 6.81         |
| 3  | 300088 | 长信科技 | 4,500,000  | 86,940,000.00  | 5.08         |
| 4  |        | 宇通客车 | 3,947,795  | 72,639,428.00  | 4.24         |
| 5  | 000650 | 仁和药业 | 10,974,300 | 68,150,403.00  | 3.98         |
| 6  | 002625 | 勤上光电 | 6,300,000  | 67,914,000.00  | 3.97         |
| 7  | 002022 | 科华生物 | 3,967,046  | 66,448,020.50  | 3.88         |
| 8  | 600157 | 永泰能源 | 9,500,000  | 62,700,000.00  | 3.66         |
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 3,600,000  | 59,760,000.00  | 3.49         |
| 10 | 600089 | 特变电工 | 3,700,000  | 44,659,000.00  | 2.61         |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券代码 | 债券名称    | 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  |      | 金融债券    | 89,750,000.00  | 5.24         |
| 4  |      | 企业债券    | 53,054,193.00  | 3.10         |
| 5  |      | 企业短期融资券 | -              | -            |
| 6  |      | 中期票据    | -              | -            |
| 7  |      | 可转债     | 254,604,363.90 | 14.87        |
| 8  |      | 其他      | -              | -            |
| 9  |      | 合计      | 397,408,756.90 | 23.20        |

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

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  | 110015 | 石化债    | 960,000 | 93,974,400.00 | 5.49         |
| 2  | 113001 | 中行票据   | 518,000 | 51,815,540.00 | 3.03         |
| 3  | 110023 | 民生债    | 472,190 | 49,962,423.90 | 2.92         |
| 4  | 120245 | 12国开45 | 500,000 | 49,930,000.00 | 2.92         |
| 5  | 126011 | 108国债  | 437,940 | 43,115,193.00 | 2.52         |

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 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  |      |      | -     | -       | -            |
| 2  |      |      | -     | -       | -            |
| 3  |      |      | -     | -       | -            |
| 4  |      |      | -     | -       | -            |
| 5  |      |      | -     | -       | -            |
| 6  |      |      | -     | -       | -            |
| 7  |      |      | -     | -       | -            |
| 8  |      |      | -     | -       | -            |
| 9  |      |      | -     | -       | -            |
| 10 |      |      | -     | -       | -            |

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
| 1  |      |      | -     | -       | -            |
| 2  |      |      | -     | -       | -            |
| 3  |      |      | -     | -       | -            |
| 4  |      |      | -     | -       | -            |
| 5  |      |      | -     | -       | -            |

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贵金属投资情况说明

1)报告期末本基金投资的贵金属投资的品种情况。

2)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

3)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

4)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

5)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

6)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

7)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

8)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

9)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

10)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

11)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

12)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

13)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

14)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

15)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

16)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

17)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

18)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

19)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

20)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

21)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

22)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

23)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

24)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

25)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

26)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

27)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

28)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

29)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

30)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

31)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

32)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

33)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

34)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

35)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

36)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

37)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

38)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

39)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

40)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

41)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

42)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

43)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

44)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

45)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

46)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

47)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

48)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

49)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

50)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

51)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

52)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

53)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

54)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

55)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

56)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

57)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

58)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

59)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

60)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

61)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

62)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

63)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

64)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

65)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

66)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

67)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

68)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

69)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

70)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

71)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

72)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

73)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

74)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

75)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

76)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

77)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

78)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

79)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

80)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

81)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

82)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

83)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

84)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

85)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

86)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

87)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

88)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

89)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

90)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

91)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

92)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

93)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

94)本报告期内本基金未持有贵金属投资。

95