

(上接B70版)			
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 项目 金额(元) 占基金资产的比例 (%)			
1 权益投资 4,812,450,473.53 93.29			
其中：股票 4,812,450,473.53 93.29			
2 固定收益投资 201,040,000.00 3.90			
其中：债券 201,040,000.00 3.90			
货币市场工具 -			
3 衍生金融工具 -			
4 金融衍生品投资 -			
5 买入返售金融资产 -			
其中：买断式回购的买入返售金融资产 -			
6 银行存款和结算备付金合计 135,187,506.92 2.62			
7 其他资产 101,172,366.50 0.20			
8 合计 5,118,850,369.45 100.00			
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、渔业 - -			
B 采矿业 52,978,806.08 1.03			
C 制造业 2,630,542,672.78 50.92			
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 24,667,071.27 0.48			
E 建筑业 36,887,906.60 0.72			
F 批发和零售业 155,690,705.59 3.03			
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 551,397,136.24 10.71			
J 金融业 599,282,934.69 11.65			
K 房屋建筑业 432,765,471.20 8.41			
L 租赁和商务服务业 61,539,784.03 1.20			
M 科学研究和技术服务业 - -			
N 水、气、电、暖、燃料和电力供应业 152,247,593.26 2.96			
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 89,671,857.51 1.74			
S 综合类 34,778,534.28 0.68			
合计 4,812,450,473.53 93.51			
2.2报告期末按行业分类的股票投资组合			
本基金报告期末无重仓股。			
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五名股票投资明细			
序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 000002 万科A 19,557,028 4.84			
2 000651 格力电器 10,324,279 173,810,074.22 3.38			
3 000100 平安银行 14,660,075 155,783,337.75 3.99			
4 000333 深圳燃气 4,831,394 121,895,566.02 2.37			
5 002024 万华化学 9,699,237 117,554,631.24 2.28			
6 002015 海螺水泥 3,266,118 106,377,544.44 2.07			
7 000024 招商银行 3,479,939 99,131,406.31 1.93			
8 000658 五粮液 4,166,524 90,288,578.05 1.75			
9 000776 宁波银行 6,733,631 88,210,266.10 1.71			
10 000708 东方雨虹 2,392,362 86,077,144.76 1.67			
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五名债券投资明细			
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 150002 万科A 240,960,966.44 4.84			
2 000651 格力电器 173,810,074.22 3.38			
3 000100 平安银行 155,783,337.75 3.99			
4 000333 深圳燃气 121,895,566.02 2.37			
5 002024 万华化学 117,554,631.24 2.28			
6 002015 海螺水泥 106,377,544.44 2.07			
7 000024 招商银行 106,377,544.44 2.07			
8 000658 五粮液 106,377,544.44 2.07			
9 000776 宁波银行 106,377,544.44 2.07			
10 000708 东方雨虹 106,377,544.44 2.07			
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贵金属投资明细			
序号 期货代码 期货名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
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五名贵金属投资明细			
序号 期货代码 期货名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
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			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
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权证投资明细			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
9.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股指期货投资明细			
序号 期货代码 期货名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
10.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 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
11.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			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
12.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明细			
序号 期货代码 期货名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
13.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			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
14.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股指期货投资明细			
序号 期货代码 期货名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
15.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 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
16.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			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
17.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股指期货投资明细			
序号 期货代码 期货名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
18.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 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
19.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			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
20.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股指期货投资明细			
序号 期货代码 期货名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
21.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 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
22.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			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
23.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股指期货投资明细			
序号 期货代码 期货名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
24.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 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
25.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			
序号 期权代码 期权名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)			
1 150007 黄金 2,000,000 201,040,000.00 3.91			
26.			