



# Disclosure 信息披露

2015年 11月 12日 星期四  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B72

(上揭B705)				
1.报告期内基金净值增长情况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	4312,450,473.53	93.29	
2	其中:股票	4312,450,473.53	93.29	
3	固定收益投资	201,040,000.00	3.90	
4	其中:债券	201,040,000.00	3.90	
5	资产支持证券	-	-	
6	贵金属投资	-	-	
7	金融衍生品投资	-	-	
8	买入返售金融资产	-	-	
9	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-	
10	银行存款和结算备付金合计	13,817,502.92	2.62	
11	其他资产	10,172,306.50	0.20	
12	合计	5,158,850,286.95	100.00	

2.报告期末按行业分类的股票投资组合				
1.报告期末按行业分类的股票投资组合				
序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
A	农林、牧、渔	-	-	
B	采矿业	52,978,806.08	1.03	
C	制造业	2,620,542,672.78	50.92	
D	电力、热力、燃气及生产供应业	24,667,071.27	0.48	
E	建筑业	36,387,066.60	0.72	
F	批发和零售业	155,609,705.49	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	房地产业	432,765,471.30	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	水利、环境和公共设施管理业	152,247,293.26	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	34,778,534.28	0.68	
合计		4,812,450,473.53	93.51	

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	数量(股)	公允价值(元)
1	000002	万科A	19,557,028	248,906,966.44
2	000051	格力电器	80,462,379	175,000,922.27
3	000001	平安银行	14,460,375	153,783,333.75
4	000033	荣信股份	4,831,374	121,895,560.62
5	002034	苏宁云商	9,699,227	117,545,613.24
6	002415	海康威视	3,265,118	106,737,544.44
7	000024	招商局A	3,479,219	91,311,496.31
8	000078	广汇物流	4,166,524	90,288,575.08
9	000076	广发证券	6,733,631	88,210,566.10
10	300009	东方财富	2,392,362	86,077,184.76

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	数量(元)	公允价值(元)
1	000000	国债	-	-
2	000000	国债	-	-
3	000000	国债	-	-
4	000000	国债	-	-
5	000000	国债	-	-
6	000000	国债	-	-
7	000000	国债	-	-
8	000000	国债	-	-
9	000000	国债	-	-
10	000000	国债	-	-

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(元)	公允价值(元)
1	150007	15进07	2,000,000	201,040,000.00
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资产支持证券投资明细				
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贵金属投资明细				
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				
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明				
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明				
11.报告期末本基金投资的期权交易情况说明				
12.报告期末本基金投资的权证交易情况说明				
13.报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明				
14.报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明				

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权证投资明细				
序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	150007	15进07	2,000,000	201,040,000.00
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资产支持证券投资明细				
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明细				
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权证投资明细				
10.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明				
11.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明				
12.报告期末本基金投资的期权交易情况说明				
13.报告期末本基金投资的权证交易情况说明				
14.报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明				
15.报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明				

(上揭B715)				
1.报告期内基金净值增长情况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	198,115,448.82	78.90	
2	其中:股票	198,115,448.82	78.90	
3	固定收益投资	201,040,000.00	3.90	
4	其中:债券	201,040,000.00	3.90	
5	资产支持证券	-	-	
6	贵金属投资	-	-	
7	金融衍生品投资	-	-	
8	买入返售金融资产	-	-	
9	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-	
10	银行存款和结算备付金合计	52,438,301.13	20.88	
11	其他资产	535,122.97	0.21	
12	合计	251,088,272.92	100.00	

2.报告期末按行业分类的股票投资组合				
1.报告期末按行业分类的股票投资组合				
序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
A	农林、牧、渔	26,677,429.54	10.72	
B	采矿业	-	-	
C	制造业	90,171,029.38	36.23	
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-	
E	建筑业	-	-	
F	批发和零售业	16,168,090.96	6.50	
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	33,342,181.82	13.40	
J	金融业	-	-	
K	房地产业	8,437,260.70	3.39	
L	租赁和商务服务业	8,281,202.90	3.32	
M	科学研究和技术服务业	10,214,457.42	4.10	
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	438,640.60	1.95	
合计		198,115,448.82	79.00	

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)
1	300094	国农种业	765,580	14,923,154.20
2	300028	中国铁建	775,713	13,498,881.66
3	300044	华平国际	202,489	11,955,679.92
4	600131	农发种业	985,438	11,582,275.42
5	002268	卫士通	246,607	11,568,384.36
6	600697	东方明珠	769,640	11,287,619.80
7	000059	中南文化	98,110	11,082,554.00
8	000888	招商局A	96,458	10,211,457.42
9	300069	东方财富	222,933	9,820,129.34
10	000788	中航飞机	40,590	8,983,215.00

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合				
1.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	数量(元)	公允价值(元)
1	000000	国债	-	-
2	000000	国债	-	-
3	000000	国债	-	-
4	000000	国债	-	-
5	000000	国债	-	-
6	000000	国债	-	-
7	000000	国债	-	-
8	000000	国债	-	-
9	000000	国债	-	-
10	000000	国债	-	-

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(元)	公允价值(元)
1	000000	国债	-	-
2	000000	国债	-	-
3	000000	国债	-	-
4	000000	国债	-	-
5	000000	国债	-	-
6	000000	国债	-	-
7	000000	国债	-	-
8	000000	国债	-	-
9	000000	国债	-	-
10	000000	国债	-	-

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资产支持证券投资明细				
序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)
1	000000	资产支持证券	-	-
2	000000	资产支持证券	-	-
3	000000	资产支持证券	-	-
4	000000	资产支持证券	-	-
5	000000	资产支持证券	-	-
6	000000	资产支持证券	-	-
7	000000	资产支持证券	-	-
8	000000	资产支持证券	-	-
9	000000	资产支持证券	-	-
10	000000	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				
序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	000000	权证	-	-
2	000000	权证	-	-
3	000000	权证	-	-
4	000000	权证	-	-
5	000000	权证	-	-
6	000000	权证	-	-
7	000000	权证	-	-
8	000000	权证	-	-
9	000000	权证	-	-
10	000000	权证	-	-

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	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	000000	权证	-	-
2	000000	权证	-	-
3	000000	权证	-	-
4	000000	权证	-	-
5	000000	权证	-	-
6	000000	权证	-	-
7	000000	权证	-	-
8	000000	权证	-	-
9	000000	权证	-	-
10	000000	权证	-	-

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权证投资明细				
序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	000000	权证	-	-
2	000000	权证	-	-
3	000000	权证	-	-
4	000000	权证	-	-
5	000000	权证	-	-
6	000000	权证	-	-
7	000000	权证	-	-
8	000000	权证	-	-
9	000000	权证	-	-
10	000000	权证	-	-

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权证投资明细				
序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	000000	权证	-	-
2	000000	权证	-	-
3	000000	权证	-	-
4	000000	权证	-	-
5	000000	权证	-	-
6	000000	权证	-	-
7	000000	权证	-	-
8	000000	权证	-	-
9	000000	权证	-	-
10	000000	权证	-	-

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	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	000000	权证	-	-
2	000000	权证	-	-
3	000000	权证	-	-
4	000000	权证	-	-
5	000000	权证	-	-
6	000000	权证	-	-
7	000000	权证	-	-
8	000000	权证	-	-
9	000000	权证	-	-
10	000000	权证	-	-

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权证投资明细				
序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	000000	权证	-	-
2	000000	权证	-	-
3	000000	权证	-	-
4	000000	权证	-	-
5	000000	权证	-	-
6	000000	权证	-	-
7	000000	权证	-	-
8	000000	权证	-	-
9	000000	权证	-	-
10	000000	权证	-	-

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	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	019509	15进09	995,130	99,712,026.00
2	150026	15进06	500,000	50,125,000.00
3	150015	15进01	500,000	49,990,000.00
4	150010	15进01	400,000	41,616,000.00
5	150013	15进03	400,000	40,988,000.00

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权证投资明细				
序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)
1	019509	15进09	995,130	99,712,026.00
2	150026	15进06	500,000	50,125,000.00
3	150015	15进01	500,000	49,990,000.00
4	150010	15进01	400,000	41,616,000.00
5	150013	15进03	400,000	40,988,000.00

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权证投资明细
-------------------------------------