

(上接 B3版)

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	615,321.81	3.61
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	19,147.31	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术业	134,011.56	0.79
J	金融业	4,126,274.04	24.23
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	17,552.98	0.10
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	-	-
合计		4,912,307.70	28.84

1.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

注:本基金报告期末未有港股股票资产。

1.3 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	601688	华泰证券	796,578	4,126,274.04	24.23
2	688101	三远通信	13,483	242,156.68	1.42
3	688108	普诺医疗	9,304	142,537.28	0.84
4	688089	泰必信	4,769	141,400.85	0.83
5	688118	普元信息	4,028	134,011.56	0.79
6	688021	东微环保	2,940	89,229.00	0.52
7	600325	中顺石油	689	19,147.31	0.11
8	300853	阿尔特	1,642	17,552.98	0.10

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	2,986,800.00	17.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,004,000.00	5.89
其中:政策性金融债	1,004,000.00	5.89	
4	企业债券	-	-
5	中期票据	-	-
6	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,990,800.00	23.43

1.5 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	019547	16国债19	30,000	2,986,800.00	17.54
2	019860	20国债1911	10,000	1,004,000.00	5.89

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

本基金本报告期末未有资产支持证券。

1.7 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

本基金本报告期末未有贵金属投资。

1.8 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

本基金本报告期末未有权证投资。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期未持有股指期货持仓和损益明细。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未持有国债期货持仓。

1.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

1.10.2 报告期末国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未持有国债期货持仓。

1.10.3 本期国债期货投资政策

1.11 投资组合报告摘要

1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情况

本基金本报告期未持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、处罚的发行主体。

1.11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.11.3 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.11.4 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。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情况

本基金本报告期未持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、处罚的发行主体。

1.12.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.3 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.4 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。

1.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

1.12.6 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.7 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.8 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.9 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.10 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.11 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.12 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.13 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.14 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.15 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.16 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.17 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.18 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.19 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.20 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.21 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.22 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.23 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.24 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.25 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.26 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.27 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.28 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.29 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.30 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.31 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.32 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.33 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.34 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.35 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.36 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.37 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.38 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.39 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.12.40 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	19,569.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,146.05
5	应收申购款	899.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,615.15

1.12.41 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金