

3. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600595	中孚实业	8,503,426	110,119,396.70	5.29%
2	600125	G 铁龙	14,035,961	105,971,430.05	5.09%
3	600118	G 卫 星	6,391,373	106,467,494.50	5.06%
4	600538	G 云铝	2,513,839	72,775,278.50	3.40%
5	600688	G 嘉 酒	7,331,498	69,383,066.33	3.33%
6	600994	大雁股份	1,630,593	67,424,083.00	3.24%
7	600683	G 海 上	2,768,502	63,171,756.80	3.03%
8	600361	G 康 达	3,454,569	62,389,135.54	3.00%
9	600739	G 成 大	4,765,926	56,619,238.52	2.72%
10	000758	G 中 色	5,900,138	49,073,011.30	2.28%

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应查阅登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

4. 报告期内股票投资组合的重大变动

(1) 报告期内累计买入价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600151	G 航 天	109,083,057.68	5,565.91	5.56%
2	600118	G 卫 星	104,396,021.46	5.09%	
3	600859	王 府 井	74,288,434.71	4.05%	
4	000400	G 广 电	69,658,480.15	3.80%	
5	600031	G 智 行	69,897,971.91	3.76%	
6	000031	G 中粮	63,394,449.18	3.48%	
7	600494	大雁股份	53,944,912.22	2.94%	
8	600271	G 航 信	42,320,752.29	2.31%	
9	600683	G 海 上	41,846,058.17	2.28%	
10	000729	G 嘉 啤	41,073,083.04	2.24%	
11	000758	G 中 色	40,219,283.74	2.19%	
12	000658	G 五 粮 液	36,598,746.29	2.00%	
13	000060	G 中 金	35,445,851.45	1.93%	
14	000089	G 华 锦 5	31,015,108.98	1.74%	
15	600729	G 嘉 啤	31,397,292.81	1.71%	
16	000668	G 老 窖	30,472,248.31	1.65%	
17	600316	航都航空	30,346,941.47	1.64%	
18	600386	G 巴 圣	30,128,428.75	1.64%	
19	600361	G 康 达	29,351,376.25	1.62%	
20	000911	G 皇 台	29,086,076.04	1.62%	

(2) 报告期内累计卖出价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	000638	G 白云	145,752,310.45	7.95%	
2	600683	G 海 上	130,446,821.49	7.12%	
3	000031	G 中粮	95,379,122.25	5.20%	
4	000069	G 华锦 5	91,671,527.71	5.00%	
5	600036	G 智 行	86,910,424.61	4.74%	
6	600125	G 铁龙	76,939,595.96	4.20%	
7	600061	G 广 电	66,718,407.23	3.58%	
8	600436	G 广 钨	62,120,512.18	3.39%	
9	600271	G 航 信	61,631,286.77	3.26%	
10	000017	G 广 东	67,233,288.04	3.12%	
11	000400	G 广 电	56,941,203.21	3.10%	
12	600009	G 伊 瑞	51,948,225.45	2.83%	
13	000858	G 老 窖	51,659,612.83	2.82%	
14	600094	大雁股份	46,352,989.94	2.52%	
15	000911	G 皇 台	43,671,297.24	2.28%	
16	600066	G 宇 通	42,211,768.96	2.23%	
17	600616	G 食 品	38,900,628.20	2.13%	
18	600267	G 海 正	34,008,890.50	1.89%	
19	600494	大雁股份	32,135,421.58	1.81%	
20	600831	G 广 电	31,944,505.27	1.74%	

(3) 报告期末买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额(单位:元)

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
1,486,719,195.17	2,072,821,766.71

5. 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国债	337,013,737.00	16.18%
2	央行票据	-	-
3	企业债	-	-
4	金融债	95,120,749.88	4.57%
5	可转债债券	9,948,040.00	0.48%
合计		442,082,526.88	21.23%

6. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	2006国债 1	117,041,912.40	5.62%
2	02国债 03	97,788,300.50	4.73%
3	21国债 09	67,144,968.60	3.24%
4	01国债 19	30,003,000.00	1.44%
5	04国债 21	20,384,000.00	0.98%

7. 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 本基金持有的资产构成

项目	期末金额(元)
交易保证金	966,872.98
应收利息	6,562,347.70
应收股利	6,237,613.35
应收证券清算款	6,068,368.36
其他应收款	3,261,346.40
合计	23,146,548.82

(4) 基金持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	100226	桂电转债	5,449,291.50	0.26%
2	100795	国电转债	4,499,765.60	0.22%

(5) 报告期末持有的权证投资

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	期末总金额	类别(被浮动或有主动投资)
1	580090	茅台 C/P1	640,490	0	被浮动
2	580096	茅台 J/P1	2,470,287	0	被浮动
3	580097	招行 C/P1	5,134,670	0	被浮动

(6) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细:无

(7) 基金投资组合报告附注

1. 报告期末基金投资组合情况

项目	金额(元)	占基金资产的比例
股票	533,916,988.05	73.82%
债券	154,838,798.00	21.90%
银行存款及货币资金合计	25,725,496.23	3.56%
权证	-	-
其他资产	8,744,326.30	1.21%
资产合计	723,225,388.68	100.00%

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A. 农林牧渔	12,285,425.00	1.71%
B. 采矿业	304,243,628.38	42.40%
C. 制造业	107,225,338.34	14.66%
D. 食品饮料	-	-
E. 纺织服装	-	-
F. 木材家具	-	-
G. 造纸印刷	8,639,136.00	1.20%
H. 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
I. 电子、通信	60,933,219.00	8.42%
J. 金属、非金属	-	-
K. 机械、设备、仪表	74,304,705.68	10.44%

(8) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	G 智 行	6,959,972	49,073,011.32	6.33%
2	000729	G 嘉 啤	4,799,447	41,058,271.85	5.72%
3	600739	G 成 大	3,199,912	38,194,564.56	5.30%
4	600361	G 康 达	1,950,000	35,217,000.00	4.91%
5	000423	东阿阿胶	3,146,931	35,215,214.27	4.90%
6	600717	G 天 通	3,799,896	31,919,110.00	4.48%
7	000157	中 铁 二 局	1,999,284	27,477,569.64	3.85%
8	600519	王 府 井	579,636	27,496,461.20	3.83%
9	600686	G 海 耀	1,789,275	24,674,102.25	3.44%
10	600150	G 重 钢	1,114,812	24,603,300.84	3.43%

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应查阅登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

4. 报告期内股票投资组合的重大变动

(1) 报告期内累计买入价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	G 智 行	67,166,372.44	7.98%	
2	000729	G 嘉 啤	44,456,188.32	5.29%	
3	000658	G 五 粮 液	38,218,060.23	4.55%	
4	000423	东阿阿胶	32,607,897.98	3.98%	
5	600069	G 盛 都	32,570,193.74	3.95%	
6	600016	G 民 生	32,163,982.27	3.85%	
7	600679	G 火 箭	30,150,138.11	3.69%	
8	600686	G 海 耀	28,574,234.82	3.40%	
9	000039	G 中 集	28,364,690.75	3.37%	
10	600689	G 中 兴	28,330,640.13	3.37%	
11	600739	G 成 大	27,965,776.03	3.33%	
12	600320	G 振 华	27,598,496.69	3.28%	
13	600717	G 天 通	26,291,707.41	3.13%	
14	600361	G 康 达	25,692,142.22	3.06%	
15	600039	G 盛 都	24,999,360.67	2.99%	
16	000002	G 万 林 A	23,683,125.82	2.85%	
17	600331	G 宏 达	23,365,611.26	2.78%	
18	000060	G 中 金	22,698,125.82	2.70%	
19	600006	东风汽车	22,496,410.26	2.68%	
20	600362	G 中 集	21,772,680.78	2.59%	
21	000157	G 中 铁	20,152,666.76	2.44%	
22	000679	G 火 箭	20,157,568.82	2.40%	
23	600519	G 茅 台	19,904,874.83	2.37%	
24	600028	G 太 平	19,740,220.78	2.36%	
25	600018	G 长 岭	19,252,844.46	2.23%	
26	600856	G 长 电	17,875,780.59	2.18%	
27	600150	G 重 钢	17,075,464.26	2.03%	
28	600418	G 江 汽	17,005,344.31	2.02%	

(2) 报告期内累计卖出价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	000042	G 广 电 A	66,988,478.03	7.98%	
2	600066	G 宇 通	66,274,069.82	7.89%	
3	000858	G 老 窖	62,342,027.37	7.42%	
4	000039	G 中 集	60,963,710.56	7.25%	
5	600994	大雁股份	54,796,285.75	6.52%	
6	600028	中国石化	49,733,607.71	5.98%	
7	600016	G 民 生	45,289,233.30	5.39%	
8	600018	G 长 电	43,912,211.76	5.23%	
9	600013	G 中 兴	42,790,012.87	5.08%	
10	000069	G 华锦 5	42,210,621.04	5.02%	
11	600679	G 火 箭	37,289,938.77	4.44%	
12	600037	G 广 电	36,033,276.06	4.29%	
13	600362	G 中 集	34,886,413.98	4.15%	
14	600020	G 中 兴	32,560,727.88	3.87%	
15	600331	G 宏 达	30,947,547.34	3.68%	
16	000060	G 中 金	26,717,724.36	3.18%	
17	600660	G 福 耀	24,911,878.83	2.96%	
18	600688	G 海 耀	24,879,156.00	2.96%	
19	000076	G 云 铝	24,503,425.94	2.92%	
20	600000	G 浦 发	23,556,180.07	2.80%	
21	600009	G 伊 瑞	23,171,815.39	2.77%	
22	000025	G 太 平	23,173,600.80	2.76%	
23	600086	G 海 耀	22,967,702.97	2.73%	
24	600350	G 广 电	22,949,002.63	2.73%	
25	600887	G 伊 利	22,895,403.11	2.72%	
26	600006	东风汽车	21,826,903.91	2.60%	
27	600042	G 申 能	21,777,721.75	2.59%	
28	000539	G 中 集	21,563,120.01	2.57%	
29	600795	国电转债	20,627,189.83	2.45%	
30	600361	G 康 达	18,545,891.89	2.21%	
31	600418	G 江 汽	18,522,044.62	2.20%	
32	600050	G 联 通	16,970,081.30	2.02%	

(3) 报告期末买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额(单位:元)

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
906,916,132.75	1,327,217,803.97

6. 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国债	105,048,918.00	14.64%
2	央行票据	-	-
3	企业债	-	-
4	金融债	49,789,880.00	6.94%
5	可转债债券	-	-
合计		154,838,798.00	21.58%

7. 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 本基金持有的资产构成

项目	期末金额(元)
交易保证金	638,549.12
应收证券清算款	3,243,034.31
应收利息	2,109,506.87
其他应收款	1,073,238.00
应收股利	1,680,000.00
待摊费用	-
买入返售证券	-
合计	8,744,326.30

8. 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A. 农林牧渔	12,285,425.00	1.71%
B. 采矿业	304,243,628.38	42.40%
C. 制造业	107,225,338.34	14.66%
D. 食品饮料	-	-
E. 纺织服装	-	-
F. 木材家具	-	-
G. 造纸印刷	8,639,136.00	1.20%
H. 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
I. 电子、通信	60,933,219.00	8.42%
J. 金属、非金属	-	-
K. 机械、设备、仪表	74,304,705.68	10.44%

(4) 基金持有的处于转股期的可转换债券明细:无

9. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细:无

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	期末总金额	类别(被浮动或有主动投资)
1	580090	茅台 C/P1	828,000	0	被浮动
2	580096	茅台 J/P			