

(上接 D65 版)

根据上述调整,按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得(损失)”科目的投资估值增值(减值)净值变动现按企业会计准则在利润表的“公允价值变动收益(损失)”科目中核算,相应的未实现损益净值变动现按企业会计准则直接记入“未分配利润(累计亏损)”科目。于会计期末,按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得(损失)”科目中的全部余额,现按企业会计准则合于“未分配利润(累计亏损)”科目中。

**第七章 投资组合报告**

**一、报告期末基金资产组合情况**

资产类别	金额(人民币元)	占基金资产净值比例
股票资产	2,280,446,757.26	91.51%
债券资产	1,322,572.60	0.05%
权益投资	44,726,166.50	1.79%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存拆放类资产	128,297,856.60	5.12%
其他资产	37,588,176.40	1.50%
资产合计	2,503,000,545.46	100.00%

**二、报告期末按行业分类的股票投资组合**

分类	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
A 农林牧渔	0.00	0.00%
B 采掘业	342,504,300.54	13.29%
C 制造业	531,226,361.44	21.24%
D 食品、饮料	71,564,666.62	2.91%
E 纺织、服装、皮毛	14,827,266.62	0.59%
F 木材、家具	0.00	0.00%
G 造纸、印刷	0.00	0.00%
H 石油、化学、塑胶、塑料	36,026,251.13	1.46%
I 电子业	0.00	0.00%
J 金属、非金属	299,467,263.00	12.17%
K 机械、设备、仪表	109,342,286.07	4.44%
L 医药、生物制品	0.00	0.00%
OR 其他制造业	0.00	0.00%
M 电力、煤气及水生产和供应业	151,274,714.38	6.15%
N 建筑业	0.00	0.00%
P 交通运输、仓储业	193,647,936.79	7.72%
Q 信息技术业	193,309,323.00	7.71%
R 批发和零售贸易	52,942,434.72	2.15%
S 金融、保险业	688,480,983.30	28.32%
T 房地产业	132,003,230.20	5.36%
U 商业贸易	53,537,123.17	2.18%
V 文化传播业	21,282,794.24	0.87%
W 其他文化娱乐业	16,986,221.25	0.69%
M 综合类	2,280,446,757.26	90.97%

**三、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	股票名称	数量(股)	市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
1	600028	中国石化	6,830,894	180,466,727.72	6.59%
2	600030	中信证券	1,191,404	139,430,826.69	5.42%
3	600000	浦发银行	1,975,092	194,294,567.60	7.61%
4	600016	民生银行	6,528,066	96,765,520.12	3.79%
5	600036	招商银行	2,183,594	86,549,304.42	3.32%
6	600002	万科 A	2,742,822	79,302,418.89	3.11%
7	600050	中国联通	4,181,591	58,409,670.00	2.27%
8	600019	宝钢股份	3,177,639	56,417,877.28	2.25%
9	600060	长江电力	2,154,263	49,782,803.07	1.92%
10	600519	贵州茅台	215,066	40,406,193.00	1.57%

**四、报告期末股票投资组合的重大变动**

**(一) 报告期末买入买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(人民币元)	占期初基金资产净值比例
1	600028	中国石化	30,438,705.01	6.01%
2	600016	民生银行	26,864,358.33	6.05%
3	600030	中信证券	24,070,358.30	5.63%
4	600019	宝钢股份	21,828,197.15	4.85%
5	600050	中国联通	19,736,815.41	4.80%
6	600000	浦发银行	18,730,395.20	4.44%
7	000002	万科 A	17,836,401.00	4.04%
8	600060	长江电力	16,306,117.51	3.53%
9	600036	招商银行	15,159,932.00	3.06%
10	000003	中兴通讯	13,911,941.56	2.91%
11	601111	中国铁建	9,458,692.28	2.14%
12	600039	浦发银行	8,740,557.40	1.89%
13	601318	中国平安	8,432,641.90	1.81%
14	601088	中国神华	79,610,946.21	1.80%
15	600519	贵州茅台	78,412,588.95	1.78%
16	600019	宝钢股份	74,831,727.07	1.70%
17	002024	苏宁电器	74,467,200.00	1.69%
18	600015	上海宝钢	72,946,148.89	1.65%
19	600011	华能国际	67,817,472.25	1.54%
20	601006	大秦铁路	63,468,511.91	1.44%

(上接 D67 版)

**(一) 报告期末买入买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(人民币元)	占期初基金资产净值的比例
1	000002	万科 A	232,248,346.77	27.42%
2	601628	中国人寿	162,162,836.14	19.24%
3	601318	中国平安	155,220,902.09	18.22%
4	600795	双钱轮胎	152,047,627.85	18.04%
5	600788	东方国际	151,289,760.71	17.92%
6	600026	中海发展	146,107,457.74	17.23%
7	601088	中国神华	141,365,303.92	16.76%
8	600060	长江电力	138,010,982.64	16.29%
9	601006	大秦铁路	134,640,706.85	15.90%
10	600019	宝钢股份	131,739,625.00	15.56%
11	601111	中国铁建	130,077,877.90	15.36%
12	600104	上海汽车	126,421,217.66	14.92%
13	600036	招商银行	126,013,959.07	14.83%
14	600795	双钱轮胎	121,267,467.99	14.36%
15	000270	长城铝业	113,289,760.71	13.79%
16	600020	云南城投	112,391,317.82	13.54%
17	600002	江苏中业	109,642,800.94	12.94%
18	000729	中航地产	109,274,079.60	12.90%
19	000563	西山煤电	103,088,820.60	12.17%
20	600087	上海机场	99,344,417.14	11.80%
21	000422	湖北宜化	96,613,849.43	11.29%
22	000800	一汽轿车	96,466,430.92	11.27%
23	601059	建研集团	94,761,081.80	11.20%
24	600028	中国石化	94,469,383.09	11.16%
25	000729	中航地产	82,889,384.32	10.29%
26	000528	柳工	79,925,386.22	9.44%
27	601919	中国远洋	79,467,250.75	9.40%
28	002106	莱宝高科	76,281,113.84	9.01%
29	000063	美的电器	73,602,032.00	8.88%
30	000626	长安汽车	71,478,664.75	8.46%
31	600060	长江电力	70,487,528.72	8.32%
32	000858	五粮液	69,408,146.21	8.21%
33	000880	上海医药	68,738,389.43	8.12%
34	600018	华联控股	67,006,506.62	7.98%
35	000278	太原钢铁	64,182,843.86	7.67%
36	601333	广铁铁路	63,787,392.73	7.53%
37	601328	交通银行	63,765,390.75	7.53%
38	601089	腾邦国际	61,263,291.71	7.23%
39	000650	江铃汽车	60,117,122.20	7.20%
40	600875	东方电气	60,161,762.76	7.20%
41	600018	上海石化	59,465,258.13	7.02%
42	600085	上海机场	57,560,986.97	6.90%
43	600010	包钢股份	56,152,149.76	6.81%
44	600029	中原特钢	54,282,006.90	6.41%
45	601280	中国中铁	53,170,309.63	6.27%
46	600631	百发股份	53,476,117.25	6.31%
47	600949	江苏医药	52,904,227.26	6.25%
48	600067	欧亚集团	51,616,023.54	6.12%
49	000290	远大铝业	51,581,923.64	6.09%
50	600611	国联股份	51,467,568.58	6.08%
51	000897	津滨发展	50,465,724.69	5.96%
52	000729	中航地产	50,268,679.40	5.95%
53	002156	联华银行	49,571,612.97	5.85%
54	600097	环渤海	49,286,729.46	5.71%
55	600348	海南高速	47,329,947.62	5.59%
56	000056	广东医疗	46,056,395.56	5.44%
57	600017	日照港	44,892,193.03	5.28%
58	600001	邯郸钢铁	43,768,150.00	5.17%
59	000052	华鲁恒升	43,694,337.81	5.15%
60	000620	长钢股份	43,310,959.18	5.11%
61	000098	兴亚集团	42,191,534.89	4.98%
62	002183	得  证	41,222,108.96	4.89%
63	600717	天津港	40,551,464.28	4.79%
64	000059	三友化工	39,812,110.00	4.70%
65	002001	中航光电	39,171,192.77	4.62%
66	000022	招商局 A	38,065,463.87	4.49%
67	000401	粤高速	37,449,822.21	4.42%
68	000688	宝钢股份	36,488,431.91	4.31%
69	000659	首钢股份	35,647,297.68	4.21%
70	002152	广日运通	35,046,467.88	4.14%
71	000031	中钢地产	34,736,347.95	4.10%
72	000057	华鲁能源	33,485,467.81	3.95%
73	600086	东汽汽车	32,076,301.00	3.85%
74	600710	苏宁电器	32,112,562.67	3.82%
75	600963	内蒙华电	32,286,532.49	3.81%
76	601817	中国石化	31,567,281.15	3.73%
77	600121	郑州煤电	29,410,283.85	3.47%
78	600500	中国国航	26,367,893.15	3.18%
79	600377	宇宁高速	24,194,036.19	2.86%
80	002031	巨轮股份	23,069,847.28	2.72%
81	600269	鲁商置业	22,428,896.87	2.65%
82	600089	郑东电力	22,286,002.78	2.64%
83	000188	*ST 太钢	17,162,317.51	2.11%
84	600260	山东高速	17,763,060.02	2.10%

**(二) 报告期末累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明细**

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(人民币元)	占期初基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	201,619,425.88	75.2%
2	600036	招商银行	200,272,302.44	63.8%
3	600016	民生银行	261,860,382.78	58.0%
4	000002	万科 A	234,168,155.88	53.2%
5	600050	中国联通	228,140,314.44	51.9%
6	600019	宝钢股份	227,189,346.40	51.6%
7	600028	中国石化	213,980,513.39	48.6%
8	600104	上海汽车	172,886,896.52	39.9%
9	600000	浦发银行	164,782,320.22	37.9%
10	600060	长江电力	156,506,029.97	35.0%
11	601111	中国铁建	154,234,116.28	33.6%
12	601111	中国铁建	140,467,433.09	31.8%
13	000003	中兴通讯	123,839,864.89	28.1%
14	601028	中国中冶	113,414,916.07	25.9%
15	601128	中国重工	104,790,572.25	23.9%
16	000002	金  融	99,887,076.62	2.28%
17	600006	武钢股份	96,543,368.38	2.22%
18	601006	大秦铁路	94,061,073.88	2.13%
19	601001	大同煤业	90,796,219.03	2.06%
20	600039	烟台万润	88,742,430.43	2.01%

**(三) 报告期末买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

项目	金额(人民币元)
买入股票成本总额	4,522,000,206.73
卖出股票收入总额	6,214,460,930.04

**五、报告期末按券种分类的债券投资组合**

债券品种	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
国  债	0.00	0.00%
金融债	0.00	0.00%
央行票据	0.00	0.00%
央行票据	0.00	0.00%
企业债	1,602,280.00	0.07%
可转债	240,260.00	0.01%
债券投资合计	1,822,572.60	0.08%

**六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的债券投资组合**

序号	债券品种
----	------