



(上接B53版)

十一、基金投资组合报告

基金管理人及基金托管人本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人中国银河证券股份有限公司本报告基金合同规定，于2017年4月20日复核了本报告所载投资组合净值表(报表和附注)与托管人报告，本报告所载投资组合净值表(报表和附注)与托管人报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本报告所载投资组合净值表(报表和附注)于2017年3月31日。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	342,964,411.09	68.81
	其中:股票	342,964,411.09	68.81
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
3	贵金属投资	--	--
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	148,888,562.39	29.87
7	其他各项资产	6,540,428.91	1.31
8	合计	498,393,407.39	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	--	--
C	制造业	223,994,181.53	45.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,107,900.59	1.44
E	建筑业	212,432.50	0.04
F	批发和零售业	47,660,008.86	9.55
G	交通运输、仓储和邮政业	21,636,451.12	4.39
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术业	5,442,216.74	1.10
J	金融业	--	--
K	房地产业	31,919,408.51	6.48
L	租赁和商务服务业	5,516,810.65	1.12
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	58,890.52	0.01
O	国民服务、休闲和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生健康业	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
合计		342,964,411.09	69.50

2.2 报告期末按行业分类的沪港深投资股票投资组合

无。

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	300285	富国材料	956,996	38,068,369.88	7.72
2	002366	台海核电	639,774	32,231,814.12	6.54
3	600693	东百集团	2,223,971	29,578,814.30	6.00
4	002694	国地科技	662,642	24,053,904.60	4.88
5	600834	申通地铁	1,009,439	14,889,225.25	3.02
6	600826	三生股份	541,956	13,960,786.56	2.83
7	600114	东睦股份	764,045	13,752,810.00	2.79
8	600622	宝泰集团	689,614	13,364,719.32	2.71
9	603005	晶方科技	299,200	10,647,136.00	2.04
10	600360	华微电子	1,074,800	9,511,980.00	1.93

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(一)基金净值表现

9.1 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。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未持有国债期货。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 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。

9.8 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。

9.9 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。

9.10 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。

9.11 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。

9.12 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1.基金管理人的管理费

2.基金托管人的托管费

3.基金销售服务费

4.基金赎回费

5.基金转换费

6.基金申购费

7.基金赎回费

8.基金销售服务费

9.基金赎回费

10.基金销售服务费

11.基金赎回费

12.基金销售服务费

2.2 报告期末按行业分类的沪港深投资股票投资组合

无。

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	300285	富国材料	956,996	38,068,369.88	7.72
2	002366	台海核电	639,774	32,231,814.12	6.54
3	600693	东百集团	2,223,971	29,578,814.30	6.00
4	002694	国地科技	662,642	24,053,904.60	4.88
5	600834	申通地铁	1,009,439	14,889,225.25	3.02
6	600826	三生股份	541,956	13,960,786.56	2.83
7	600114	东睦股份	764,045	13,752,810.00	2.79
8	600622	宝泰集团	689,614	13,364,719.32	2.71
9	603005	晶方科技	299,200	10,647,136.00	2.04
10	600360	华微电子	1,074,800	9,511,980.00	1.93

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

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

本基金本报告期末持有债券。

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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末持有贵金属。

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持有权证。

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。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未持有国债期货。

11 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。

12 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十四、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(一)基金净值表现

9.1 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。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未持有国债期货。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 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。

9.8 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。

9.9 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。

9.10 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。

9.11 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。

9.12 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十五、基金费用

(一)与基金运作有关的费用

1.基金管理人的管理费

2.基金托管人的托管费

3.基金销售服务费

4.基金赎回费

5.基金转换费

6.基金申购费

7.基金赎回费

8.基金销售服务费

9.基金赎回费

10.基金销售服务费

11.基金赎回费

12.基金销售服务费

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十六、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(一)基金净值表现

9.1 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。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未持有国债期货。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 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。

9.8 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。

9.9 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。

9.10 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。

9.11 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。

9.12 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十七、基金费用

(一)与基金运作有关的费用

1.基金管理人的管理费

2.基金托管人的托管费

3.基金销售服务费

4.基金赎回费

5.基金转换费

6.基金申购费

7.基金赎回费

8.基金销售服务费

9.基金赎回费

10.基金销售服务费

11.基金赎回费

12.基金销售服务费

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十八、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(一)基金净值表现

9.1 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。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未持有国债期货。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 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。

9.8 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。

9.9 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。

9.10 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。

9.11 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。

9.12 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

十九、基金费用

(一)与基金运作有关的费用

1.基金管理人的管理费

2.基金托管人的托管费

3.基金销售服务费

4.基金赎回费

5.基金转换费

6.基金申购费

7.基金赎回费

8.基金销售服务费

9.基金赎回费

10.基金销售服务费

11.基金赎回费

12.基金销售服务费

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

二十、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(一)基金净值表现

9.1 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。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未持有国债期货。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 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。

9.8 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。

9.9 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。

9.10 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。

9.11 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。

9.12 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	489,009.34
2	应收证券清算款	4,616,209.61
3	应收利息	--
4	应收股利	24,111.88
5	应收申购款	1,411,038.08
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	6,540,428.91

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓数量(股)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600834	申通地铁	14,889,225.25	3.02	筹划重大资产重组

2.2 报告期末按行业分类的沪港深投资股票投资组合

无。

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
----	------	------	-------	---------	-------