

(上)B125(续)

本投资组合报告所载数据截至2017年8月31日,“报告期末”,本报告所列财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	1,491,305,474.33	93.61
2	债券投资	1,491,305,474.33	93.61
3	货币资金	28,296,000.00	1.76
4	买入返售金融资产	28,296,000.00	1.76
5	应收利息	28,296,000.00	1.76
6	其他资产	28,296,000.00	1.76
7	资产支持证券	10,000,000.00	0.62
8	其他负债	10,000,000.00	0.62
9	未分配利润	10,000,000.00	0.62
10	其他综合收益	10,000,000.00	0.62
11	公允价值变动损益	10,000,000.00	0.62
12	其他	10,000,000.00	0.62

注:本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行上市的其他股票等,成份股及备选股投资比例不低于基金资产净值90%。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34
B	医药生物	279,673,174.34	18.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,068,126.24	3.00
E	建筑业	192,820,357.49	12.57
F	信息技术业	32,315,289.13	2.11
G	金融业	60,791,394.28	4.00
H	制造业	712,790,173.94	46.48
J	房地产业	47,867,607.43	3.13
K	公用事业	28,296,000.00	1.84
L	交通运输、仓储和邮政业	28,296,000.00	1.84
M	批发和零售业	28,296,000.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	28,296,000.00	1.84
O	采矿业	28,296,000.00	1.84
P	教育	28,296,000.00	1.84
Q	国防军工	28,296,000.00	1.84
R	有色金属	28,296,000.00	1.84
S	其他	28,296,000.00	1.84
合计		1,491,305,474.33	93.61

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	97,299,511.74	6.34