

(上接B79版)

2)可转换公司债券选择策略
本基金在具体的投资过程中,将综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上,采用数量化估值工具评定其投资价值,选择其中安全边际较高、发行条件相对优惠、流动性良好,并且其基本面优良,具有较好盈利能力或成长潜力,股性活跃并具有较高上涨潜力的品种,以合理价格买入并持有,期限内会收益率、折溢价比率、久期、凸性等要素构建可转换公司债券投资组合,获取超额的投资回报。

3)资产支持证券选择策略
本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金生成,辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型对资产支持证券进行估值,并结合资产支持证券类资产的市场特点,进行以类品种的投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(1)固定投资策略
本基金将通过对权证证券的基本面研究,并结合权证定价模型计算权证价值,把握权证交易、风险补偿收益和市场流动性等基本因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金生成,辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型对资产支持证券进行估值,并结合资产支持证券类资产的市场特点,进行以类品种的投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

3.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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000062	万科A	295,102	7,368,406.94	5.68
2	000026	招商地产	313,800	7,135,262.00	5.49
3	600415	海螺水泥	79,800	6,250,556.00	4.82
4	600048	保利地产	479,380	6,713,478.34	5.18
5	000036	华联控股	711,127	6,471,285.78	4.99
6	600188	光大银行	1,598,850	6,459,142.50	4.98
7	001668	中国铁建	660,000	6,446,800.00	4.97
8	600823	世茂股份	1,314,120	6,439,188.00	4.96
9	002142	宁波银行	333,279	6,432,284.70	4.93
10	600016	民生银行	781,913	6,427,341.30	4.92

4.期末按品种分类的债券投资组合
 本基金本报告期末持有债券:
 5.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明细
 本基金本报告期末持有债券:
 6.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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.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
 9.1.报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 9.2.本基金投资股指期货的投资政策
 10.本基金投资国债期货的投资政策
 10.1.本基金投资国债期货的投资政策
 10.2.本基金投资国债期货的投资政策
 11.投资组合报告附注
 11.1.本基金投资的前十名证券的发行主体本期没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、处罚的情况
 11.2.本基金投资的前十名证券的发行主体本期没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、处罚的情况
 11.3.本基金投资的前十名证券的发行主体本期没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、处罚的情况

九.基金的投资业绩比较基准
 本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准为中国债券总指数。本基金的整体业绩基准为:
 沪深300指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%
 本基金上述业绩比较基准的理由如下:
 沪深300指数为中证指数有限公司编制的,由从上海和深圳证券市场选取的300只A股作为样本股编制而成。该指数具有良好的流动性,股票投资增加,加权样本覆盖了沪深两市大约80%左右的市场代表性和市场影响力。
 中国债券总指数是中国国债登记结算有限责任公司编制的,采用市值加权计算的债券指数,其中涵盖了可流通的记账式国债和附息国债,基本可以反映中国债券市场的总体趋势。由于该债券总指数反映了我国债券市场价格总水平的波动水平和变动趋势,涵盖的投资范围较宽,作为本基金固定收益类资产的投资业绩比较基准较为适当。
 今后若基准指数停止计算编制或更改名称或法律法规发生变化,或有更权威、更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准的指数,导致本基金业绩比较基准不再适用,本基金管理人可以根据维护基金份额持有人利益的原则,在与基金托管人协商一致并经中国证监会批准后,适当调整业绩比较基准并及时公告。
 十.基金的风险收益特征
 本基金是一只具有主题投资特征的混合型基金,其预期的风险和收益将低于股票型基金,高于债券型基金与货币型基金,属于中高风险、较高收益的证券投资基金品种。
 十一.基金投资组合报告
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	6.91
8	合计	148,184,765.07	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

证券代码:300698 证券简称:万马科技 公告编号:2017-003

万马科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍
 万马科技股份有限公司(以下简称“公司”)连续2个交易日(2017年9月12日、2017年9月13日)收盘价较涨幅偏离值累计超过20%,根据《深圳证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
 二、公司关注并核实情况说明
 针对公司股票交易异常波动,公司董事会、控股股东及实际控制人就相关事项进行了核实,现就相关情况说明如下:
 1.公司未发现前期披露的信息存在需要更正、补充之处;
 2.公司未发现近期公共传媒报道了可能已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;
 3.公司目前经营情况及内外环境未发生重大变化;
 4.经核查,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段重大事项;
 5.经核查,公司控股股东、实际控制人在股票异常波动期间不存在买卖公司股票的情形;
 6.公司不存在违反公平信息披露规定的其他情形。
 三、是否存在应披露而未披露信息的说明
 本公司董事会确认,公司目前没有任何根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的事项或事项有关的筹划、商谈、协议、意向,也未获悉公司可能根据深圳证券交易所《创业板股票上市规则》等相关规定予以披露而未披露的本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。
 四、必要的风险提示
 基金管理人的董事会及董事保证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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日。
 1.期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	129,062,376.39	87.81
	其中:股票	129,062,376.39	87.81
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	8,862,423.97	5.99
7	其他负债	10,239,964.71	