



Disclosure 信息披露

2018年2月13日 星期二
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B106

（上接B105版）

未来,随着市场的发展和基金管理人运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,适当调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。

十、基金的投资组合报告

以投资策略和资产配置来看,本基金的基础份额为股票基金,主要采用完全复制策略跟踪标的指数的投资,其风险收益特征与标的指数相似,长期而言,其风险收益水平高于普通基金。本基金主要投资于股票市场,与基础份额相似,A类份额具有风险高、收益较高的特征,与基础份额相比,其风险收益特征与基础份额相似,B类份额具有风险低、收益较低的特征,其风险收益特征与基础份额相似。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本基金管理人报告期内严格按照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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定,复核了本报告的内容,保证其内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为2017年10月1日至2017年12月31日

十二、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	392,804,547.76	93.81
2	固定收益投资	577,997.47	0.14
3	贵金属投资	577,997.47	0.14
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金	24,413,368.41	5.83
7	其他资产	935,381.58	0.22
8	合计	418,731,295.22	100.00

十三、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	372,106,554.71	89.50
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,443.20	0.00
E	交通运输、仓储和邮政业	-	-
F	信息、软件和信息技术服务业	3,282,296.02	0.79
G	金融业	17,942.76	0.00
H	房地产业	-	-
I	医药、生物和医药技术服务业	17,340,187.87	4.17
J	公用事业	-	-
K	能源、金属和金属服务业	-	-
L	其他行业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-

十四、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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14
2	110042	8,619,369	5,780	0.14
3	110042	8,619,369	5,780	0.14
4	110042	8,619,369	5,780	0.14
5	110042	8,619,369	5,780	0.14
6	110042	8,619,369	5,780	0.14
7	110042	8,619,369	5,780	0.14
8	110042	8,619,369	5,780	0.14
9	110042	8,619,369	5,780	0.14
10	110042	8,619,369	5,780	0.14

十五、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债券投资明细

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

十六、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金融衍生品投资明细

序号	金融衍生品名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

十七、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贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

十八、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

十九、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十一、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十二、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十三、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十四、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十五、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十六、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十七、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十八、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

二十九、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十一、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十二、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十三、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十四、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十五、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十六、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十七、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十八、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

三十九、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十一、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十二、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十三、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十四、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十五、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十六、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十七、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十八、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

四十九、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十一、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十二、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十三、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十四、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十五、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十六、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十七、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十八、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

五十九、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十一、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十二、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十三、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十四、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十五、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十六、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14

六十七、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其他资产投资明细

序号	其他资产名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	8,619,369	5,780	0.14