

深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司																																																	
基金托管人:交通银行股份有限公司																																																	
报告送出日期:2018年7月18日																																																	
<p>1.1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年7月16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。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金增值。</p> <p>基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。</p> <p>本报告中所载资料截止于:2018年6月30日。</p>																																																	
<p>1.2 基金产品概况</p> <table border="1"> <tr> <th>基金名称</th> <th>基金代码</th> <th>基金简称</th> <th>基金类型</th> </tr> <tr> <td>深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金</td> <td>159909</td> <td>深证60ETF</td> <td>交易型开放式指数基金</td> </tr> <tr> <td>基金管理人</td> <td>建信基金管理有限责任公司</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金托管人</td> <td>交通银行股份有限公司</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金合同生效日期</td> <td>2014年4月11日</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金运作方式</td> <td>契约型开放式</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金投资目标</td> <td>紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争获得与市场指数相当的投资收益。 </td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金投资策略</td> <td>本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数的表现,以期获得与标的指数相似的投资收益。本基金采用抽样复制法,力争使基金投资组合的净值增长率与业绩比较基准保持一致。 </td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>业绩比较基准</td> <td>中证60交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-0.5%</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>风险收益特征</td> <td>本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的基金品种。 </td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金管理人</td> <td>建信基金管理有限责任公司</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金托管人</td> <td>交通银行股份有限公司</td> <td></td> <td></td> </tr> </table>		基金名称	基金代码	基金简称	基金类型	深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金	159909	深证60ETF	交易型开放式指数基金	基金管理人	建信基金管理有限责任公司			基金托管人	交通银行股份有限公司			基金合同生效日期	2014年4月11日			基金运作方式	契约型开放式			基金投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争获得与市场指数相当的投资收益。			基金投资策略	本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数的表现,以期获得与标的指数相似的投资收益。本基金采用抽样复制法,力争使基金投资组合的净值增长率与业绩比较基准保持一致。			业绩比较基准	中证60交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-0.5%			风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的基金品种。			基金管理人	建信基金管理有限责任公司			基金托管人	交通银行股份有限公司		
基金名称	基金代码	基金简称	基金类型																																														
深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金	159909	深证60ETF	交易型开放式指数基金																																														
基金管理人	建信基金管理有限责任公司																																																
基金托管人	交通银行股份有限公司																																																
基金合同生效日期	2014年4月11日																																																
基金运作方式	契约型开放式																																																
基金投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争获得与市场指数相当的投资收益。																																																
基金投资策略	本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数的表现,以期获得与标的指数相似的投资收益。本基金采用抽样复制法,力争使基金投资组合的净值增长率与业绩比较基准保持一致。																																																
业绩比较基准	中证60交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-0.5%																																																
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的基金品种。																																																
基金管理人	建信基金管理有限责任公司																																																
基金托管人	交通银行股份有限公司																																																

3.1 主要财务指标						
单位:人民币元						
主要财务指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)					
1.本期已实现收益	6,915,234.71					
2.本期利润	-41,255,437.44					
3.本期基金份额净值增长率	-3.93%					
4.本期基金份额净值增长率标准差	3.0800%					
5.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差距	-3.33%					
1.本基金本期收益基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期间实现收益加上本期公允价值变动损益。						
2.所述基金份额净值增长率并不包括持有人认购及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字。						
3.2 基金净值表现						
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差距	波动率	波动率差
最近三个月	-3.93%	1.40%	-0.62%	1.29%	0.53%	0.69%
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较						

3.3 投资组合报告																																																																																									
<p>3.3.1 报告期末按行业分类的股票投资组合</p> <table border="1"> <tr> <th>行业</th> <th>公允价值</th> <th>占净值比例(%)</th> <th>占基金资产净值比例(%)</th> </tr> <tr> <td>A 医药、生物制品</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>B 制造业</td> <td>47,736</td> <td>0.24</td> <td>0.02</td> </tr> <tr> <td>C 信息技术</td> <td>123,848</td> <td>0.62</td> <td>0.04</td> </tr> <tr> <td>D 金融、地产及公用事业</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>E 可选消费</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>F 耐用消费品</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>G 交通運輸、仓储和快递</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>H 日常消费品</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>I 信息、通信、科技和电子设备</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>J 能源</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>K 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>L 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>M 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>N 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>O 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>P 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Q 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>R 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>S 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>T 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>合计</td> <td>123,884</td> <td>0.64</td> <td>0.06</td> </tr> </table>		行业	公允价值	占净值比例(%)	占基金资产净值比例(%)	A 医药、生物制品	-	-	-	B 制造业	47,736	0.24	0.02	C 信息技术	123,848	0.62	0.04	D 金融、地产及公用事业	-	-	-	E 可选消费	-	-	-	F 耐用消费品	-	-	-	G 交通運輸、仓储和快递	-	-	-	H 日常消费品	-	-	-	I 信息、通信、科技和电子设备	-	-	-	J 能源	-	-	-	K 其他	-	-	-	L 其他	-	-	-	M 其他	-	-	-	N 其他	-	-	-	O 其他	-	-	-	P 其他	-	-	-	Q 其他	-	-	-	R 其他	-	-	-	S 其他	-	-	-	T 其他	-	-	-	合计	123,884	0.64	0.06
行业	公允价值	占净值比例(%)	占基金资产净值比例(%)																																																																																						
A 医药、生物制品	-	-	-																																																																																						
B 制造业	47,736	0.24	0.02																																																																																						
C 信息技术	123,848	0.62	0.04																																																																																						
D 金融、地产及公用事业	-	-	-																																																																																						
E 可选消费	-	-	-																																																																																						
F 耐用消费品	-	-	-																																																																																						
G 交通運輸、仓储和快递	-	-	-																																																																																						
H 日常消费品	-	-	-																																																																																						
I 信息、通信、科技和电子设备	-	-	-																																																																																						
J 能源	-	-	-																																																																																						
K 其他	-	-	-																																																																																						
L 其他	-	-	-																																																																																						
M 其他	-	-	-																																																																																						
N 其他	-	-	-																																																																																						
O 其他	-	-	-																																																																																						
P 其他	-	-	-																																																																																						
Q 其他	-	-	-																																																																																						
R 其他	-	-	-																																																																																						
S 其他	-	-	-																																																																																						
T 其他	-	-	-																																																																																						
合计	123,884	0.64	0.06																																																																																						

3.3.2 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	000001	平安银行	784,162	17,448,278.20	12.01								
2	000002	万科A	47,736	12,024,919.77	8.67								
3	000003	招商银行	93,472	12,024,919.77	8.67								
4	000004	平安证券	1,588,448	17,711,851.43	12.70								
5	000009	新华富时	5,588,000	18,261,516.00	13.11								
6	000010	深市综指	484,848	9,796,971.68	7.07								
7	000016	深市综指	1,851,272	3,602,544.36	2.61								
8	000020	深市综指	126,291	2,525,824.68	1.83								
9	000021	深市综指	2,997,489	5,994,978.40	4.35								
10	000071	深市综指	98,988	2,000,000.00	1.46								
<p>3.3.3 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权证投资明细</p> <table border="1"> <tr> <th>序号</th> <th>股票代码</th> <th>权证名称</th> <th>数量(份)</th> <th>公允价值(元)</th> <th>占基金资产净值比例(%)</th> </tr> <tr> <td>1</td> <td>000001</td> <td>平安银行</td> <td>1,144</td> <td>12,399.48</td> <td>0.01</td> </tr> </table>		序号	股票代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	1	000001	平安银行	1,144	12,399.48	0.01
序号	股票代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)								
1	000001	平安银行	1,144	12,399.48	0.01								

3.3.4 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股指期货投资明细					
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	000001	平安银行	784,162	17,448,278.20	12.01
2	000002	万科A	47,736	12,024,919.77	8.67
3	000003	招商银行	93,472	12,024,919.77	8.67
4	000004	平安证券	1,588,448	17,711,851.43	12.70
5	000009	新华富时	5,588,000	18,261,516.00	13.11
6	000010	深市综指	484,848	9,796,971.68	7.07
7	000016	深市综指	1,851,272	3,602,544.36	2.61
8	000020	深市综指	126,291	2,525,824.68	1.83
9	000021	深市综指	2,997,489	5,994,978.40	4.35
10	000071	深市综指	98,988	2,000,000.00	1.46

3.3.5 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					
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	000001	平安银行	784,162	17,448,278.20	12.01
2	000002	万科A	47,736	12,024,919.77	8.67
3	000003	招商银行	93,472	12,024,919.77	8.67
4	000004	平安证券	1,588,448	17,711,851.43	12.70
5	000009	新华富时	5,588,000	18,261,516.00	13.11
6	000010	深市综指	484,848	9,796,971.68	7.07
7	000016	深市综指	1,851,272	3,602,544.36	2.61
8	000020	深市综指	126,291	2,525,824.68	1.83
9	000021	深市综指	2,997,489	5,994,978.40	4.35
10	000071	深市综指	98,988	2,000,000.00	1.46

3.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细					
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	000001	平安银行	784,162	17,448,278.20	12.01
2	000002	万科A	47,736	12,024,919.77	8.67
3	000003	招商银行	93,472	12,024,919.77	8.67
4	000004	平安证券	1,588,448	17,711,851.43	12.70
5	000009	新华富时	5,588,000	18,261,516.00	13.11
6	000010	深市综指	484,848	9,796,971.68	7.07
7	000016	深市综指	1,851,272	3,602,544.36	2.61
8	000020	深市综指	126,291	2,525,824.68	1.83
9	000021	深市综指	2,997,489	5,994,978.40	4.35
10	000071	深市综指	98,988	2,000,000.00	1.46

3.3.7 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权证投资明细					
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	000001	平安银行	784,162	17,448,278.20	12.01
2	000002	万科A	47,736	12,024,919.77	8.67
3	000003	招商银行	93,472	12,024,919.77	8.67
4	000004	平安证券	1,588,448	17,711,851.43	12.70
5	000009	新华富时	5,588,000	18,261,516.00	13.11
6	000010	深市综指	484,848	9,796,971.68	7.07
7	000016	深市综指	1,851,272	3,602,544.36	2.61
8	000020	深市综指	126,291	2,525,824.68	1.83
9	000021	深市综指	2,997,489	5,994,978.40	4.35
10	000071	深市综指	98,988	2,000,000.00	1.46

3.3.8 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					
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	000001	平安银行	784,162	17,448,278.20	12.01
2	000002	万科A	47,736	12,024,919.77	8.67
3	000003	招商银行	93,472	12,024,919.77	8.67
4	000004	平安证券	1,588,448	17,711,851.43	12.70
5	000009	新华富时	5,588,000	18,261,516.00	13.11
6	000010	深市综指	484,848	9,796,971.68	7.07
7	000016	深市综指	1,851,272	3,602,544.36	2.61
8	000020	深市综指	126,291	2,525,824.68	1.83
9	000021	深市综指	2,997,489	5,994,978.40	4.35
10	000071	深市综指	98,988	2,000,000.00	1.46

建信深证100指数增强型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司																																																	
基金托管人:交通银行股份有限公司																																																	
报告送出日期:2018年7月18日																																																	
<p>1.1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年7月16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。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金增值。</p> <p>基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。</p> <p>本报告中所载资料截止于:2018年6月30日。</p>																																																	
<p>1.2 基金产品概况</p> <table border="1"> <tr> <th>基金名称</th> <th>基金代码</th> <th>基金简称</th> <th>基金类型</th> </tr> <tr> <td>建信深证100指数增强型证券投资基金</td> <td>300301</td> <td>建信深100</td> <td>股票型证券投资基金</td> </tr> <tr> <td>基金管理人</td> <td>建信基金管理有限责任公司</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金托管人</td> <td>交通银行股份有限公司</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金合同生效日期</td> <td>2014年4月11日</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金运作方式</td> <td>契约型开放式</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金投资目标</td> <td>紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争获得与市场指数相当的投资收益。 </td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金投资策略</td> <td>本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数的表现,以期获得与标的指数相似的投资收益。本基金采用抽样复制法,力争使基金投资组合的净值增长率与业绩比较基准保持一致。 </td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>业绩比较基准</td> <td>中证100交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-0.5%</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>风险收益特征</td> <td>本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的基金品种。 </td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金管理人</td> <td>建信基金管理有限责任公司</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>基金托管人</td> <td>交通银行股份有限公司</td> <td></td> <td></td> </tr> </table>		基金名称	基金代码	基金简称	基金类型	建信深证100指数增强型证券投资基金	300301	建信深100	股票型证券投资基金	基金管理人	建信基金管理有限责任公司			基金托管人	交通银行股份有限公司			基金合同生效日期	2014年4月11日			基金运作方式	契约型开放式			基金投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争获得与市场指数相当的投资收益。			基金投资策略	本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数的表现,以期获得与标的指数相似的投资收益。本基金采用抽样复制法,力争使基金投资组合的净值增长率与业绩比较基准保持一致。			业绩比较基准	中证100交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-0.5%			风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的基金品种。			基金管理人	建信基金管理有限责任公司			基金托管人	交通银行股份有限公司		
基金名称	基金代码	基金简称	基金类型																																														
建信深证100指数增强型证券投资基金	300301	建信深100	股票型证券投资基金																																														
基金管理人	建信基金管理有限责任公司																																																
基金托管人	交通银行股份有限公司																																																
基金合同生效日期	2014年4月11日																																																
基金运作方式	契约型开放式																																																
基金投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争获得与市场指数相当的投资收益。																																																
基金投资策略	本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数的表现,以期获得与标的指数相似的投资收益。本基金采用抽样复制法,力争使基金投资组合的净值增长率与业绩比较基准保持一致。																																																
业绩比较基准	中证100交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-0.5%																																																
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的基金品种。																																																
基金管理人	建信基金管理有限责任公司																																																
基金托管人	交通银行股份有限公司																																																

3.1 主要财务指标						
单位:人民币元						
主要财务指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)					
1.本期已实现收益	-2,893,812.02					
2.本期利润	-4,885.14					
3.本期基金份额净值增长率	-0.31%					
4.本期基金份额净值增长率标准差	1.682%					
5.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差距	-0.02%					
1.本基金本期收益基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期间实现收益加上本期公允价值变动损益。						
2.所述基金份额净值增长率并不包括持有人认购及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字。						
3.2 基金净值表现						
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差距	波动率	波动率差
最近三个月	-0.29%	1.31%	-1.09%	1.31%	1.21%	0.69%
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较						

3.3 投资组合报告																																																																																																															
<p>3.3.1 报告期末按行业分类的股票投资组合</p> <table border="1"> <tr> <th>行业</th> <th>公允价值</th> <th>数量(股)</th> <th>公允价值(元)</th> <th>占基金资产净值比例(%)</th> </tr> <tr> <td>A 医药、生物制品</td> <td>291,229.18</td> <td>1,194</td> <td>6,779,294.10</td> <td>6.87</td> </tr> <tr> <td>B 制造业</td> <td>982,837</td> <td>3,626</td> <td>6,266,264.14</td> <td>6.36</td> </tr> <tr> <td>C 信息技术</td> <td>11,974,771.81</td> <td>48,318</td> <td>3,456,381.16</td> <td>3.50</td> </tr> <tr> <td>D 金融、地产及公用事业</td> <td>36,764,800</td> <td>14,319</td> <td>3,445,868.68</td> <td>3.50</td> </tr> <tr> <td>E 可选消费</td> <td>729,791.68</td> <td>2,834</td> <td>2,769,791.68</td> <td>2.81</td> </tr> <tr> <td>F 耐用消费品</td> <td>36,764,800</td> <td>14,319</td> <td>3,445,868.68</td> <td>3.50</td> </tr> <tr> <td>G 交通運輸、仓储和快递</td> <td>94,010</td> <td>362</td> <td>2,669,478.80</td> <td>2.72</td> </tr> <tr> <td>H 日常消费品</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>I 信息、通信、科技和电子设备</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>J 能源</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>K 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>L 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>M 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>N 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>O 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>P 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Q 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>R 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>S 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>T 其他</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>合计</td> <td>1,487,939.09</td> <td>5,815</td> <td>64,977,616.16</td> <td>65.95</td> </tr> </table>		行业	公允价值	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	A 医药、生物制品	291,229.18	1,194	6,779,294.10	6.87	B 制造业	982,837	3,626	6,266,264.14	6.36	C 信息技术	11,974,771.81	48,318	3,456,381.16	3.50	D 金融、地产及公用事业	36,764,800	14,319	3,445,868.68	3.50	E 可选消费	729,791.68	2,834	2,769,791.68	2.81	F 耐用消费品	36,764,800	14,319	3,445,868.68	3.50	G 交通運輸、仓储和快递	94,010	362	2,669,478.80	2.72	H 日常消费品	-	-	-	-	I 信息、通信、科技和电子设备	-	-	-	-	J 能源	-	-	-	-	K 其他	-	-	-	-	L 其他	-	-	-	-	M 其他	-	-	-	-	N 其他	-	-	-	-	O 其他	-	-	-	-	P 其他	-	-	-	-	Q 其他	-	-	-	-	R 其他	-	-	-	-	S 其他	-	-	-	-	T 其他	-	-	-	-	合计	1,487,939.09	5,815	64,977,616.16	65.95
行业	公允价值	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																																																																																																											
A 医药、生物制品	291,229.18	1,194	6,779,294.10	6.87																																																																																																											
B 制造业	982,837	3,626	6,266,264.14	6.36																																																																																																											
C 信息技术	11,974,771.81	48,318	3,456,381.16	3.50																																																																																																											
D 金融、地产及公用事业	36,764,800	14,319	3,445,868.68	3.50																																																																																																											
E 可选消费	729,791.68	2,834	2,769,791.68	2.81																																																																																																											
F 耐用消费品	36,764,800	14,319	3,445,868.68	3.50																																																																																																											
G 交通運輸、仓储和快递	94,010	362	2,669,478.80	2.72																																																																																																											
H 日常消费品	-	-	-	-																																																																																																											
I 信息、通信、科技和电子设备	-	-	-	-																																																																																																											
J 能源	-	-	-	-																																																																																																											
K 其他	-	-	-	-																																																																																																											
L 其他	-	-	-	-																																																																																																											
M 其他	-	-	-	-																																																																																																											
N 其他	-	-	-	-																																																																																																											
O 其他	-	-	-	-																																																																																																											
P 其他	-	-	-	-																																																																																																											
Q 其他	-	-	-	-																																																																																																											
R 其他	-	-	-	-																																																																																																											
S 其他	-	-	-	-																																																																																																											
T 其他	-	-	-	-																																																																																																											
合计	1,487,939.09	5,815	64,977,616.16	65.95																																																																																																											

3.3.2 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	000001	平安银行	191,894	4,779,294.10	4.87
2	000002	万科A	982,837	6,266,264.14	6.36
3	000003	招商银行	98,284	3,456,381.16	3.50
4	000004	平安证券	41,319	3,445,868.68	3.50
5	000005	浦发银行	94,010	2,669,478.80	2.72
6	000006	中信银行	36,764	2,669,478.80	2.72
7	000007	工商银行	15,319	2,669,478.80	2.72
8	000008	农业银行	28,319	1,729,294.10	1.76
9	000009	建设银行	8,319	6,779,294.10	6.87
10	000010	交通银行	1,194	6,779,294.10	6.87