

(上接B71版)
本系列基金托管人中国工商银行根据本系列基金合同规定,于2018年11月2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2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一) 基金投资组合情况
1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	--	--
其中:股票	--	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	165,782,645.90	94.47
其中:债券	165,782,645.90	94.47	
4	资产支持证券	--	--
5	贵金属投资	--	--
6	金融衍生品投资	--	--
7	买入返售金融资产	--	--
其中:买入返售金融资产的买入返售金融资产	--	--	--
8	银行存款和结算备付金合计	6,834,752.19	3.89
9	其他资产	2,860,807.14	1.64
10	合计	175,487,205.23	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	32,663,077.00	25.28
2	央行票据	--	--
3	金融债	52,964,800.00	40.99
其中:政策性金融债	37,375,128.90	29.23	
4	企业债	12,194,000.00	9.44
5	可转债(可交换债)	--	--
6	其他债券	--	--
7	其他	30,208,000.00	23.38
10	合计	165,782,645.90	128.29

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国债10	400,000	39,492,000.00	30.56
2	019536	16国开08	185,100	16,523,877.00	12.79
3	019547	16国开09	130,000	11,109,800.00	8.60
4	180406	18国债06	100,000	10,229,000.00	7.92
5	10180662	MTN001	100,000	10,171,000.00	7.87

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十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

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贵金属投资明细

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	601288	农业银行	4,750,000	18,477,500.00	2.55
2	603065	珀莱雅	390,079	16,824,107.27	2.32
3	601336	新华保险	330,000	16,658,400.00	2.30
4	601939	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
5	600076	恒顺国投	252,449	10,643,211.50	2.21
6	600284	普利特	1,317,500	10,035,975.00	2.21
7	601888	中国蓝田	231,268	15,703,849.36	2.17
8	600138	顺鑫农业	224,000	15,344,000.00	2.12
9	601933	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
10	600026	中国石化	2,139,430	15,232,741.60	2.10

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股票投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

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资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

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贵金属投资明细

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	601288	农业银行	4,750,000	18,477,500.00	2.55
2	603065	珀莱雅	390,079	16,824,107.27	2.32
3	601336	新华保险	330,000	16,658,400.00	2.30
4	601939	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
5	600076	恒顺国投	252,449	10,643,211.50	2.21
6	600284	普利特	1,317,500	10,035,975.00	2.21
7	601888	中国蓝田	231,268	15,703,849.36	2.17
8	600138	顺鑫农业	224,000	15,344,000.00	2.12
9	601933	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
10	600026	中国石化	2,139,430	15,232,741.60	2.10

9.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票投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

10.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资产支持证券投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

11.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

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	601288	农业银行	4,750,000	18,477,500.00	2.55
2	603065	珀莱雅	390,079	16,824,107.27	2.32
3	601336	新华保险	330,000	16,658,400.00	2.30
4	601939	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
5	600076	恒顺国投	252,449	10,643,211.50	2.21
6	600284	普利特	1,317,500	10,035,975.00	2.21
7	601888	中国蓝田	231,268	15,703,849.36	2.17
8	600138	顺鑫农业	224,000	15,344,000.00	2.12
9	601933	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
10	600026	中国石化	2,139,430	15,232,741.60	2.10

12.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票投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

13.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资产支持证券投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

14.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

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	601288	农业银行	4,750,000	18,477,500.00	2.55
2	603065	珀莱雅	390,079	16,824,107.27	2.32
3	601336	新华保险	330,000	16,658,400.00	2.30
4	601939	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
5	600076	恒顺国投	252,449	10,643,211.50	2.21
6	600284	普利特	1,317,500	10,035,975.00	2.21
7	601888	中国蓝田	231,268	15,703,849.36	2.17
8	600138	顺鑫农业	224,000	15,344,000.00	2.12
9	601933	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
10	600026	中国石化	2,139,430	15,232,741.60	2.10

15.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票投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

16.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资产支持证券投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

17.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

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	601288	农业银行	4,750,000	18,477,500.00	2.55
2	603065	珀莱雅	390,079	16,824,107.27	2.32
3	601336	新华保险	330,000	16,658,400.00	2.30
4	601939	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
5	600076	恒顺国投	252,449	10,643,211.50	2.21
6	600284	普利特	1,317,500	10,035,975.00	2.21
7	601888	中国蓝田	231,268	15,703,849.36	2.17
8	600138	顺鑫农业	224,000	15,344,000.00	2.12
9	601933	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
10	600026	中国石化	2,139,430	15,232,741.60	2.10

18.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票投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

19.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资产支持证券投资

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18国债08	900,000	89,910,000.00	69.78
2	180407	18国开07	300,000	50,220,000.00	39.26
3	160420	16国开20	400,000	39,900,000.00	30.78

20.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

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	601288	农业银行	4,750,000	18,477,500.00	2.55
2	603065	珀莱雅	390,079	16,824,107.27	2.32
3	601336	新华保险	330,000	16,658,400.00	2.30
4	601939	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
5	600076	恒顺国投	252,449	10,643,211.50	2.21
6	600284	普利特	1,317,500	10,035,975.00	2.21
7	601888	中国蓝田	231,268	15,703,849.36	2.17
8	600138	顺鑫农业	224,000	15,344,000.00	2.12
9	601933	永年纸业	1,876,000	15,399,400.00	2.11
10	600026	中国石化	2,139,430	15,232,741.60	