

(上接B71版)
(20)本基金与私募证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(21)法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他投资限制。
投资组合资产配置:上市公司合并、基金规模变动前基金资产之外的股票基金基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资监督只检查投资组合是否符合上述约定。
法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制,但本基金投资不再受限制或变更后的规定执行。
2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)直接或间接向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但中国证监会另有规定的除外;
(5)向基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
法律、行政法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

八、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法
(1)基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利和债权人权利,保护基金份额持有人的利益;
(2)不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;
(3)有利于基金财产的安全与增值;
(4)不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的其他第三人牟取任何不当利益。
(九)基金的投资组合报告
本基金投资组合报告所载的数据截至2018年9月30日,本报告中所有数值数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,091,796,904.43 | 40.44 |
| 2 | 固定收益 | 1,091,796,904.43 | 40.44 |
| 3 | 货币资金 | 114,084,000.00 | 4.13 |
| 4 | 买入返售金融资产 | 114,084,000.00 | 4.13 |
| 5 | 应收利息 | — | — |
| 6 | 其他资产 | — | — |
| 7 | 其他负债 | — | — |
| 8 | 资产减值准备 | — | — |
| 9 | 公允价值变动损益 | — | — |
| 10 | 未分配利润 | 1,091,796,904.43 | 40.44 |
| 11 | 合计 | 3,482,961,713.26 | 125.00 |

2.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 | 医药生物 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| B | 信息技术 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| C | 食品饮料 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| D | 电力、热力、燃气及生产服务业 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| E | 制造业 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| F | 公用事业 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| G | 交通运输、仓储及邮政业 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| H | 房地产业 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| I | 有色金属业 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| J | 其他行业 | 80,940,900.00 | 2.91 |
| K | 合计 | 1,091,796,904.43 | 40.44 |

(2) 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

| 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 | 000101 | 中国平安 | 1,760,000 | 43,029,534.36 | 1.53 |
| 2 | 000001 | 工商银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 3 | 000002 | 万科A | 2,000,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 4 | 000003 | 招商银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 5 | 000004 | 浦发银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 6 | 000005 | 民生银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 7 | 000006 | 中信银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 8 | 000007 | 农业银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 9 | 000008 | 光大银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 10 | 000009 | 长城银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 11 | 000010 | 华夏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 12 | 000012 | 兴业银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 13 | 000015 | 中信证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 14 | 000016 | 华泰证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 15 | 000017 | 招商证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 16 | 000018 | 方正证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 17 | 000020 | 安信证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 18 | 000021 | 世纪证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 19 | 000022 | 广发证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 20 | 000023 | 光大证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 21 | 000024 | 国信证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 22 | 000025 | 国泰君安 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 23 | 000026 | 海通证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 24 | 000027 | 中信建投 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 25 | 000028 | 国都证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 26 | 000029 | 首创证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 27 | 000030 | 世纪证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 28 | 000031 | 申万宏源 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 29 | 000032 | 华林证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 30 | 000033 | 西南证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 31 | 000034 | 东吴证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 32 | 000035 | 信达证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 33 | 000036 | 恒泰证券 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 34 | 000037 | 晋商银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 35 | 000038 | 鲁商银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 36 | 000039 | 齐商银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 37 | 000040 | 渤海银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 38 | 000041 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 39 | 000042 | 浙江民泰 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 40 | 000043 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 41 | 000044 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 42 | 000045 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 43 | 000046 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 44 | 000047 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 45 | 000048 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 46 | 000049 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 47 | 000050 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 48 | 000051 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 49 | 000052 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 50 | 000053 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 51 | 000054 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 52 | 000055 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 53 | 000056 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 54 | 000057 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 55 | 000058 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 56 | 000059 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 57 | 000060 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 58 | 000061 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 59 | 000062 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 60 | 000063 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 61 | 000064 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 62 | 000065 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 63 | 000066 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 64 | 000067 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 65 | 000068 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 66 | 000069 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 67 | 000070 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 68 | 000071 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 69 | 000072 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 70 | 000073 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 71 | 000074 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 72 | 000075 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 73 | 000076 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 74 | 000077 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 75 | 000078 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 76 | 000079 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 77 | 000080 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 78 | 000081 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 79 | 000082 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 80 | 000083 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 81 | 000084 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 82 | 000085 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 83 | 000086 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 84 | 000087 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 85 | 000088 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 86 | 000089 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 87 | 000090 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 88 | 000091 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 89 | 000092 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 90 | 000093 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 91 | 000094 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 92 | 000095 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 93 | 000096 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 94 | 000097 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 95 | 000098 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 96 | 000099 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 97 | 000100 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 98 | 000101 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 99 | 000102 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 100 | 000103 | 江苏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |

1.报告期末按品种分类的股票投资组合

| 序号 | 品种名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|-------|---------|--------------|
| 1 | 股票 | — | — | — |
| 2 | 债券 | — | — | — |
| 3 | 资产支持证券 | — | — | — |
| 4 | 买入返售金融资产 | — | — | — |
| 5 | 其他品种 | — | — | — |
| 6 | 合计 | — | — | — |

2.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(元) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 000000 | 国债 | 1,000,000 | 114,084,000.00 | 4.13 |
| 2 | 000000 | 国债 | 1,000,000 | 114,084,000.00 | 4.13 |
| 3 | 000000 | 国债 | 1,000,000 | 114,084,000.00 | 4.13 |
| 4 | 000000 | 国债 | 1,000,000 | 114,084,000.00 | 4.13 |
| 5 | 000000 | 国债 | 1,000,000 | 114,084,000.00 | 4.13 |

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 工商银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 2 | 000002 | 万科A | 2,000,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 3 | 000003 | 招商银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 4 | 000004 | 浦发银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 5 | 000005 | 民生银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 6 | 000006 | 中信银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 7 | 000007 | 农业银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 8 | 000008 | 光大银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 9 | 000009 | 长城银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |
| 10 | 000010 | 华夏银行 | 1,760,000 | 36,796,796.36 | 1.31 |

4.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

| 序号 | 贵金属名称 | 数量(克) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|-------|---------|--------------|
| 1 | 黄金 | — | — | — |
| 2 | 白银 | — | — | — |
| 3 | 铂金 | — | — | — |
| 4 | 钌 | — | — | — |
| 5 | 铑 | — | — | — |

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

| 序号 | 权证名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|-------|---------|--------------|
| 1 | — | — | — | — |
| 2 | — | — | — | — |
| 3 | | | | |