

(上接B18版)

## 十一、基金投资组合报告

基金管理人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。  
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月19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09月30日。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	78,056,308.76	11.66
2	固定收益投资	78,056,308.76	11.66
3	贵金属投资	580,569,000.00	86.73
4	基金投资	580,569,000.00	86.73
5	买入返售金融资产	-	-
6	应收利息	-	-
7	其他资产	107,913,000.00	16.14
8	合计	580,569,000.00	86.82

### 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	111818153	18华夏银行CD153	800,000	78,480,000.00	11.74
2	1282435	12国债高评MTN2	500,000	51,665,000.00	7.73
3	011800847	18国债01	400,000	40,312,000.00	6.03
4	041800319	18国债04	400,000	40,054,000.00	5.98
5	101658047	16国债10	400,000	39,748,000.00	5.94

### 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股票投资明细

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、化学、医药	-	-
B	有色金属	3,200,431.00	0.48
C	制造业	13,796,157.00	2.06
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	16,239,331.00	2.44
E	建筑业	1,690,820.00	0.25
F	批发和零售业	1,088,930.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	15,048,690.56	2.25
H	房地产业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	25,552,101.20	3.82
K	房地产业	1,004,930.00	0.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	349,508.00	0.05
O	批发和零售业	-	-
P	制造业	-	-
Q	软件和信息技术服务业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	78,056,308.76	11.67

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	600000	长江电力	645,600	10,542,168.00	1.58
2	600036	上海医药	77,500	4,542,921.00	0.68
3	600519	贵州茅台	5,700	4,161,000.00	0.62
4	600009	招商局港口	113,600	3,486,380.00	0.52
5	601998	工商银行	517,300	2,984,821.00	0.43
6	601988	中国银行	800,700	2,978,600.00	0.43
7	600848	保利地产	345,800	2,908,176.00	0.43
8	600014	上汽集团	84,100	2,798,848.00	0.42
9	601019	建设银行	376,300	2,724,412.00	0.41
10	601288	农业银行	670,200	2,607,078.00	0.39

### 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十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	069000	长江电力	645,600	10,542,168.00	1.58
2	060036	上海医药	77,500	4,542,921.00	0.68
3	060519	贵州茅台	5,700	4,161,000.00	0.62
4	060009	招商局港口	113,600	3,486,380.00	0.52
5	061998	工商银行	517,300	2,984,821.00	0.43
6	061988	中国银行	800,700	2,978,600.00	0.43
7	060848	保利地产	345,800	2,908,176.00	0.43
8	060014	上汽集团	84,100	2,798,848.00	0.42
9	061019	建设银行	376,300	2,724,412.00	0.41
10	061288	农业银行	670,200	2,607,078.00	0.39

### 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十名资产支持证券投资

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111818153	18华夏银行CD153	800,000	78,480,000.00	11.74
2	1282435	12国债高评MTN2	500,000	51,665,000.00	7.73
3	011800847	18国债01	400,000	40,312,000.00	6.03
4	041800319	18国债04	400,000	40,054,000.00	5.98
5	101658047	16国债10	400,000	39,748,000.00	5.94

### 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	580,569.00	580,569,000.00	86.73

### 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	069000	长江电力	645,600	10,542,168.00	1.58
2	060036	上海医药	77,500	4,542,921.00	0.68
3	060519	贵州茅台	5,700	4,161,000.00	0.62
4	060009	招商局港口	113,600	3,486,380.00	0.52
5	061998	工商银行	517,300	2,984,821.00	0.43
6	061988	中国银行	800,700	2,978,600.00	0.43
7	060848	保利地产	345,800	2,908,176.00	0.43
8	060014	上汽集团	84,100	2,798,848.00	0.42
9	061019	建设银行	376,300	2,724,412.00	0.41
10	061288	农业银行	670,200	2,607,078.00	0.39

### 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指期货投资

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1809	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
2	IF1812	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
3	IF1903	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
4	IF1906	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
5	IF1909	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46

### 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国债期货投资

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1809	5年期国债期货	100,000	10,000,000.00	1.46
2	TF1812	5年期国债期货	100,000	10,000,000.00	1.46
3	TF1903	5年期国债期货	100,000	10,000,000.00	1.46
4	TF1906	5年期国债期货	100,000	10,000,000.00	1.46
5	TF1909	5年期国债期货	100,000	10,000,000.00	1.46

### 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商品期货投资

序号	商品期货代码	商品期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	CU1809	铜期货	100,000	10,000,000.00	1.46
2	CU1812	铜期货	100,000	10,000,000.00	1.46
3	CU1903	铜期货	100,000	10,000,000.00	1.46
4	CU1906	铜期货	100,000	10,000,000.00	1.46
5	CU1909	铜期货	100,000	10,000,000.00	1.46

### 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原油期货投资

序号	原油期货代码	原油期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	WTI1809	WTI原油期货	100,000	10,000,000.00	1.46
2	WTI1812	WTI原油期货	100,000	10,000,000.00	1.46
3	WTI1903	WTI原油期货	100,000	10,000,000.00	1.46
4	WTI1906	WTI原油期货	100,000	10,000,000.00	1.46
5	WTI1909	WTI原油期货	100,000	10,000,000.00	1.46

### 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期权投资

序号	期权代码	期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	069000	长江电力	645,600	10,542,168.00	1.58
2	060036	上海医药	77,500	4,542,921.00	0.68
3	060519	贵州茅台	5,700	4,161,000.00	0.62
4	060009	招商局港口	113,600	3,486,380.00	0.52
5	061998	工商银行	517,300	2,984,821.00	0.43
6	061988	中国银行	800,700	2,978,600.00	0.43
7	060848	保利地产	345,800	2,908,176.00	0.43
8	060014	上汽集团	84,100	2,798,848.00	0.42
9	061019	建设银行	376,300	2,724,412.00	0.41
10	061288	农业银行	670,200	2,607,078.00	0.39

### 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权证投资

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	069000	长江电力	645,600	10,542,168.00	1.58
2	060036	上海医药	77,500	4,542,921.00	0.68
3	060519	贵州茅台	5,700	4,161,000.00	0.62
4	060009	招商局港口	113,600	3,486,380.00	0.52
5	061998	工商银行	517,300	2,984,821.00	0.43
6	061988	中国银行	800,700	2,978,600.00	0.43
7	060848	保利地产	345,800	2,908,176.00	0.43
8	060014	上汽集团	84,100	2,798,848.00	0.42
9	061019	建设银行	376,300	2,724,412.00	0.41
10	061288	农业银行	670,200	2,607,078.00	0.39

### 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111818153	18华夏银行CD153	800,000	78,480,000.00	11.74
2	1282435	12国债高评MTN2	500,000	51,665,000.00	7.73
3	011800847	18国债01	400,000	40,312,000.00	6.03
4	041800319	18国债04	400,000	40,054,000.00	5.98
5	101658047	16国债10	400,000	39,748,000.00	5.94

### 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权证投资

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	069000	长江电力	645,600	10,542,168.00	1.58
2	060036	上海医药	77,500	4,542,921.00	0.68
3	060519	贵州茅台	5,700	4,161,000.00	0.62
4	060009	招商局港口	113,600	3,486,380.00	0.52
5	061998	工商银行	517,300	2,984,821.00	0.43
6	061988	中国银行	800,700	2,978,600.00	0.43
7	060848	保利地产	345,800	2,908,176.00	0.43
8	060014	上汽集团	84,100	2,798,848.00	0.42
9	061019	建设银行	376,300	2,724,412.00	0.41
10	061288	农业银行	670,200	2,607,078.00	0.39

### 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股指期货投资

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1809	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
2	IF1812	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
3	IF1903	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
4	IF1906	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46
5	IF1909	沪深300股指期货	100,000	10,000,000.00	1.46

### 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国债期货投资

序号	国债期货
----	------