

(上接B69版)

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18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2019年3月31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	140,524,812.03	29.47
其中：股票	140,524,812.03	29.47
2 固定收益投资	207,490,000.00	43.51
其中：债券	207,490,000.00	43.51
资产支持证券	-	-
3 贵金属投资	-	-
4 金融衍生品投资	-	-
5 委托买卖金融产品	50,000,145.00	10.49
其中：买入返售金融产品	-	-
6 银行存款和结算备付金合计	75,786,001.24	15.89
7 其他各项资产	3,032,473.00	0.64
8 合计	476,833,395.27	100.00

2 报告期未按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业		10,029,707.00	2.21
B 采矿业		-	-
C 制造业		45,616,717.87	10.03
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		-	-
E 建筑业		-	-
F 批发零售业		-	-
G 交通运输、仓储和邮政业		-	-
H 食品、饮料业		-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业		32,902,94	0.01
J 金融业		66,330,676.00	14.58
K 地产业		18,514,808.22	4.07
L 租赁和商务服务业		-	-
M 科学研究、技术服务业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		-	-
O 居民服务、修理和其他服务业		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生和社会工作		-	-
R 文化、体育和娱乐业		-	-
S 综合		-	-
合计		140,524,812.03	30.90

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资组合

无。

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

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	601318	中国平安	428,000	32,998,800.00	7.26
2	600519	贵州茅台	36,834	31,455,867.66	6.92
3	600036	招行银行	713,900	24,215,488.00	5.32
4	600030	华泰证券	443,861	13,768,568.22	3.03
5	603218	东方财富	349,700	9,295,026.00	2.04
6	601688	华泰证券	406,800	9,116,388.00	2.00
7	027114	牧原股份	85,700	5,425,667.00	1.19
8	000002	万科A	154,500	4,742,340.00	1.06
9	000661	长高新	14,800	4,691,452.00	1.03
10	300498	温氏股份	113,400	4,604,040.00	1.01

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	中央票据	-	-
3	金融债券	70,922,000.00	15.59
4	企业债券	70,922,000.00	15.59
5	短期融资券	20,110,000.00	4.42
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交债)	116,458,000.00	25.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	207,490,000.00	45.62

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	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	150306	15国债16	300,000	30,444,000.00	6.69
2	111806270	18交通银行CD270	300,000	29,097,000.00	6.40
3	111814179	18江阴银行CD179	300,000	29,043,000.00	6.39
4	170205	17银行开票	200,000	20,248,000.00	4.45
5	120253	12中行25	200,000	20,230,000.00	4.45

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

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	150306	15国债16	300,000	30,444,000.00	6.69
2	111806270	18交通银行CD270	300,000	29,097,000.00	6.40
3	111814179	18江阴银行CD179	300,000	29,043,000.00	6.39
4	170205	17银行开票	200,000	20,248,000.00	4.45
5	120253	12中行25	200,000	20,230,000.00	4.45

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十名贵金属投资明细

序号	贵金属品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	中央票据	-	-
3	金融债券	70,922,000.00	15.59
4	企业债券	70,922,000.00	15.59
5	短期融资券	20,110,000.00	4.42
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交债)	116,458,000.00	25.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	207,490,000.00	45.62

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十名股票投资组合

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	601318	中国平安	428,000	32,998,800.00	7.26
2	600519	贵州茅台	36,834	31,455,867.66	6.92
3	600036	招行银行	713,900	24,215,488.00	5.32
4	600030	华泰证券	443,861	13,768,568.22	3.03
5	603218	东方财富	349,700	9,295,026.00	2.04
6	601688	华泰证券	406,800	9,116,388.00	2.00
7	027114	牧原股份	85,700	5,425,667.00	1.19
8	000002	万科A	154,500	4,742,340.00	1.06
9	000661	长高新	14,800	4,691,452.00	1.03
10	300498	温氏股份	113,400	4,604,040.00	1.01

9 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

<tbl_r cells="4" ix="4" maxcspan="1" maxr