

(上接T07版)

基金管理人

<div>21 华泰证券股份有限公司</div> <div>注册地: 江苏省南京市江东中路228号 办公地址: 南京市江东中路228号 法定代表人: 张伟 联系人: 王芳 电话: 025-83306666 传真: 025-83306666 网址: www.htsec.com</div>	<div>69 普华永道会计师事务所</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.pwcc.com.cn</div>	<div>70 诺正行(上海)基金销售有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.nozheng.com</div>	<div>116 上海云湾投资管理有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.yunwan.com</div>	<div>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。</div> <div>基金托管人根据本合同规定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。</div> <div>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的本金不受损失,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。</div> <div>本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日(未经审计)。</div> <div>1.1 报告期末基金资产组合情况</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>项目</th><th>金额(人民币元)</th><th>占基金总资产比例(%)</th></tr></thead><tbody><tr><td>1</td><td>权益投资</td><td>263,760,169.04</td><td>8.88</td></tr><tr><td></td><td>其中:股票</td><td>263,760,169.04</td><td>8.88</td></tr><tr><td>2</td><td>基金投资</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>3</td><td>固定收益投资</td><td>2,647,550,633.00</td><td>85.76</td></tr><tr><td></td><td>其中:债券</td><td>2,647,550,633.00</td><td>85.76</td></tr><tr><td>4</td><td>货币市场基金</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>5</td><td>资产支持证券</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>6</td><td>金融衍生品</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>7</td><td>金融衍生品投资</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>8</td><td>买入返售金融资产</td><td>2,000,000.00</td><td>0.07</td></tr><tr><td></td><td>其中:买入返售金融资产</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>9</td><td>银行存款和结算备付金合计</td><td>113,103,097.44</td><td>3.81</td></tr><tr><td>10</td><td>其他资产</td><td>43,589,907.99</td><td>1.47</td></tr><tr><td></td><td>合计</td><td>2,970,033,904.07</td><td>100.00</td></tr></tbody></table>	序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)	1	权益投资	263,760,169.04	8.88		其中:股票	263,760,169.04	8.88	2	基金投资	-	-	3	固定收益投资	2,647,550,633.00	85.76		其中:债券	2,647,550,633.00	85.76	4	货币市场基金	-	-	5	资产支持证券	-	-	6	金融衍生品	-	-	7	金融衍生品投资	-	-	8	买入返售金融资产	2,000,000.00	0.07		其中:买入返售金融资产	-	-	9	银行存款和结算备付金合计	113,103,097.44	3.81	10	其他资产	43,589,907.99	1.47		合计	2,970,033,904.07	100.00																								
序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)																																																																																					
1	权益投资	263,760,169.04	8.88																																																																																					
	其中:股票	263,760,169.04	8.88																																																																																					
2	基金投资	-	-																																																																																					
3	固定收益投资	2,647,550,633.00	85.76																																																																																					
	其中:债券	2,647,550,633.00	85.76																																																																																					
4	货币市场基金	-	-																																																																																					
5	资产支持证券	-	-																																																																																					
6	金融衍生品	-	-																																																																																					
7	金融衍生品投资	-	-																																																																																					
8	买入返售金融资产	2,000,000.00	0.07																																																																																					
	其中:买入返售金融资产	-	-																																																																																					
9	银行存款和结算备付金合计	113,103,097.44	3.81																																																																																					
10	其他资产	43,589,907.99	1.47																																																																																					
	合计	2,970,033,904.07	100.00																																																																																					
<div>22 华泰证券股份有限公司</div> <div>注册地: 江苏省南京市江东中路228号 办公地址: 南京市江东中路228号 法定代表人: 张伟 联系人: 王芳 电话: 025-83306666 传真: 025-83306666 网址: www.htsec.com</div>	<div>71 深圳众合基金销售有限公司</div> <div>注册地: 深圳市福田区福安路100号 办公地址: 深圳市福田区福安路100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0755-83306666 传真: 0755-83306666 网址: www.zongfund.com</div>	<div>72 上海好易基金销售有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.haoyi.com</div>	<div>117 上海正达资产管理有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.zhengda.com</div>	<div>1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合</div> <div>1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合</div> <table><thead><tr><th>代码</th><th>行业名称</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr></thead><tbody><tr><td>A</td><td>农林、牧、渔业</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>B</td><td>制造业</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>C</td><td>制造业</td><td>129,000,842.28</td><td>4.80</td></tr><tr><td>D</td><td>电力、热力、燃气及生产</td><td>6,238,767.98</td><td>0.23</td></tr><tr><td>E</td><td>建筑业</td><td>4,366,146.44</td><td>0.17</td></tr><tr><td>F</td><td>医药和零售业</td><td>367,093.00</td><td>0.01</td></tr><tr><td>G</td><td>交通、金融、公用事业</td><td>6,608,518.89</td><td>0.28</td></tr><tr><td>H</td><td>信息技术</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>I</td><td>信息技术、软件和信息技术</td><td>7,632.02</td><td>-</td></tr><tr><td>J</td><td>金融</td><td>98,722,762.00</td><td>3.59</td></tr><tr><td>K</td><td>金融</td><td>8,204,380.00</td><td>0.31</td></tr><tr><td>L</td><td>金融</td><td>1,053,000.00</td><td>0.04</td></tr><tr><td>M</td><td>科学、技术和金融服务业</td><td>9,951,712.00</td><td>0.38</td></tr><tr><td>N</td><td>水利、环境和公共设施</td><td>842,600.00</td><td>0.03</td></tr><tr><td>O</td><td>金融</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>P</td><td>金融</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>Q</td><td>卫生和社会工作</td><td>10,569,366.32</td><td>0.39</td></tr><tr><td>R</td><td>文化、体育和娱乐</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>S</td><td>综合</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td></td><td>合计</td><td>263,760,169.04</td><td>9.81</td></tr></tbody></table>	代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	A	农林、牧、渔业	-	-	B	制造业	-	-	C	制造业	129,000,842.28	4.80	D	电力、热力、燃气及生产	6,238,767.98	0.23	E	建筑业	4,366,146.44	0.17	F	医药和零售业	367,093.00	0.01	G	交通、金融、公用事业	6,608,518.89	0.28	H	信息技术	-	-	I	信息技术、软件和信息技术	7,632.02	-	J	金融	98,722,762.00	3.59	K	金融	8,204,380.00	0.31	L	金融	1,053,000.00	0.04	M	科学、技术和金融服务业	9,951,712.00	0.38	N	水利、环境和公共设施	842,600.00	0.03	O	金融	-	-	P	金融	-	-	Q	卫生和社会工作	10,569,366.32	0.39	R	文化、体育和娱乐	-	-	S	综合	-	-		合计	263,760,169.04	9.81
代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																																																																																					
A	农林、牧、渔业	-	-																																																																																					
B	制造业	-	-																																																																																					
C	制造业	129,000,842.28	4.80																																																																																					
D	电力、热力、燃气及生产	6,238,767.98	0.23																																																																																					
E	建筑业	4,366,146.44	0.17																																																																																					
F	医药和零售业	367,093.00	0.01																																																																																					
G	交通、金融、公用事业	6,608,518.89	0.28																																																																																					
H	信息技术	-	-																																																																																					
I	信息技术、软件和信息技术	7,632.02	-																																																																																					
J	金融	98,722,762.00	3.59																																																																																					
K	金融	8,204,380.00	0.31																																																																																					
L	金融	1,053,000.00	0.04																																																																																					
M	科学、技术和金融服务业	9,951,712.00	0.38																																																																																					
N	水利、环境和公共设施	842,600.00	0.03																																																																																					
O	金融	-	-																																																																																					
P	金融	-	-																																																																																					
Q	卫生和社会工作	10,569,366.32	0.39																																																																																					
R	文化、体育和娱乐	-	-																																																																																					
S	综合	-	-																																																																																					
	合计	263,760,169.04	9.81																																																																																					
<div>23 长江证券股份有限公司</div> <div>注册地: 湖北省武汉市新华路100号 办公地址: 湖北省武汉市新华路100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 027-83306666 传真: 027-83306666 网址: www.cjsec.com</div>	<div>73 融安(杭州)基金销售有限公司</div> <div>注册地: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 办公地址: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0571-83306666 传真: 0571-83306666 网址: www.rongan.com</div>	<div>74 上海好基基金销售有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.haoyi.com</div>	<div>118 南京卓金金融信息服务股份有限公司</div> <div>注册地: 南京市鼓楼区江浦街道100号 办公地址: 南京市鼓楼区江浦街道100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 025-83306666 传真: 025-83306666 网址: www.zhuojin.com</div>	<div>1.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合</div> <div>注:本基金本报告期末未有港股投资股票。</div> <div>1.3 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</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>股票代码</th><th>股票名称</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></thead><tbody><tr><td>1</td><td>000333</td><td>润兴股份</td><td>85,000</td><td>17,434,005.60</td><td>0.65</td></tr><tr><td>2</td><td>001988</td><td>招商银行</td><td>1,707,629</td><td>15,958,967.28</td><td>0.60</td></tr><tr><td>3</td><td>001910</td><td>中国平安</td><td>614,500</td><td>14,896,480.00</td><td>0.55</td></tr><tr><td>4</td><td>000793</td><td>建设银行</td><td>1,106,400</td><td>14,351,812.00</td><td>0.53</td></tr><tr><td>5</td><td>001456</td><td>广汇股份</td><td>723,150</td><td>13,996,963.00</td><td>0.52</td></tr><tr><td>7</td><td>000786</td><td>北新建材</td><td>800,300</td><td>12,676,762.00</td><td>0.47</td></tr><tr><td>8</td><td>000513</td><td>神州高铁</td><td>224,400</td><td>9,561,564.00</td><td>0.36</td></tr><tr><td>9</td><td>001984</td><td>光大银行</td><td>1,480,600</td><td>8,213,360.00</td><td>0.31</td></tr><tr><td>10</td><td>002385</td><td>神州药业</td><td>130,000</td><td>7,476,275.00</td><td>0.28</td></tr></tbody></table>	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	000333	润兴股份	85,000	17,434,005.60	0.65	2	001988	招商银行	1,707,629	15,958,967.28	0.60	3	001910	中国平安	614,500	14,896,480.00	0.55	4	000793	建设银行	1,106,400	14,351,812.00	0.53	5	001456	广汇股份	723,150	13,996,963.00	0.52	7	000786	北新建材	800,300	12,676,762.00	0.47	8	000513	神州高铁	224,400	9,561,564.00	0.36	9	001984	光大银行	1,480,600	8,213,360.00	0.31	10	002385	神州药业	130,000	7,476,275.00	0.28																								
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	000333	润兴股份	85,000	17,434,005.60	0.65																																																																																			
2	001988	招商银行	1,707,629	15,958,967.28	0.60																																																																																			
3	001910	中国平安	614,500	14,896,480.00	0.55																																																																																			
4	000793	建设银行	1,106,400	14,351,812.00	0.53																																																																																			
5	001456	广汇股份	723,150	13,996,963.00	0.52																																																																																			
7	000786	北新建材	800,300	12,676,762.00	0.47																																																																																			
8	000513	神州高铁	224,400	9,561,564.00	0.36																																																																																			
9	001984	光大银行	1,480,600	8,213,360.00	0.31																																																																																			
10	002385	神州药业	130,000	7,476,275.00	0.28																																																																																			
<div>24 世纪证券有限责任公司</div> <div>注册地: 深圳市福田区世纪大道100号 办公地址: 深圳市福田区世纪大道100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0755-83306666 传真: 0755-83306666 网址: www.csc.com.cn</div>	<div>75 上海天基基金销售有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.tianji.com</div>	<div>76 北京聚利基金销售有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.juliyun.com</div>	<div>119 东海期货有限责任公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.donghai.com</div>	<div>1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>债券名称</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr></thead><tbody><tr><td>1</td><td>国债</td><td>3,054,579.30</td><td>0.10</td></tr><tr><td>2</td><td>央行票据</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>3</td><td>金融债</td><td>279,590,858.10</td><td>10.41</td></tr><tr><td></td><td>其中:政策性金融债</td><td>150,110,000.00</td><td>5.59</td></tr><tr><td>4</td><td>企业债</td><td>976,468,010.20</td><td>37.87</td></tr><tr><td>5</td><td>公司债</td><td>963,177,000.00</td><td>37.07</td></tr><tr><td>6</td><td>中期票据</td><td>489,307,000.00</td><td>18.86</td></tr><tr><td>7</td><td>可转债(可交换债)</td><td>12,006,286.00</td><td>0.47</td></tr><tr><td>8</td><td>同业存单</td><td>6,687,000.00</td><td>0.26</td></tr><tr><td>9</td><td>其他</td><td>2,000,000.00</td><td>0.08</td></tr><tr><td></td><td>合计</td><td>2,687,088,683.80</td><td>10.22</td></tr></tbody></table>	序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	1	国债	3,054,579.30	0.10	2	央行票据	-	-	3	金融债	279,590,858.10	10.41		其中:政策性金融债	150,110,000.00	5.59	4	企业债	976,468,010.20	37.87	5	公司债	963,177,000.00	37.07	6	中期票据	489,307,000.00	18.86	7	可转债(可交换债)	12,006,286.00	0.47	8	同业存单	6,687,000.00	0.26	9	其他	2,000,000.00	0.08		合计	2,687,088,683.80	10.22																																				
序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																																																																																					
1	国债	3,054,579.30	0.10																																																																																					
2	央行票据	-	-																																																																																					
3	金融债	279,590,858.10	10.41																																																																																					
	其中:政策性金融债	150,110,000.00	5.59																																																																																					
4	企业债	976,468,010.20	37.87																																																																																					
5	公司债	963,177,000.00	37.07																																																																																					
6	中期票据	489,307,000.00	18.86																																																																																					
7	可转债(可交换债)	12,006,286.00	0.47																																																																																					
8	同业存单	6,687,000.00	0.26																																																																																					
9	其他	2,000,000.00	0.08																																																																																					
	合计	2,687,088,683.80	10.22																																																																																					
<div>25 东北证券股份有限公司</div> <div>注册地: 吉林省长春市自由大路138号 办公地址: 吉林省长春市自由大路138号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0431-83306666 传真: 0431-83306666 网址: www.northeast.com</div>	<div>77 浙江万泰基金销售有限公司</div> <div>注册地: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 办公地址: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0571-83306666 传真: 0571-83306666 网址: www.wantai.com</div>	<div>78 中融资产管理有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.zhongrong.com</div>	<div>120 弘业期货股份有限公司</div> <div>注册地: 南京市鼓楼区江浦街道100号 办公地址: 南京市鼓楼区江浦街道100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 025-83306666 传真: 025-83306666 网址: www.hongye.com</div>	<div>1.5 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</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>债券名称</th><th>数量(张)</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr></thead><tbody><tr><td>1</td><td>1016101100</td><td>10国债附息07X03</td><td>1,300,000</td><td>126,570,000.00</td><td>4.76</td></tr><tr><td>2</td><td>140220</td><td>14国债附息</td><td>1,200,000</td><td>120,156,000.00</td><td>4.47</td></tr><tr><td>3</td><td>11174664</td><td>177州转债附息03X03</td><td>1,145,000</td><td>114,564,000.00</td><td>4.28</td></tr><tr><td>4</td><td>11174664</td><td>177州转债附息03X03</td><td>1,145,000</td><td>114,564,000.00</td><td>4.28</td></tr><tr><td>5</td><td>122465</td><td>12国债附息07X02</td><td>887,000</td><td>86,102,400.00</td><td>3.20</td></tr></tbody></table>	序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	1	1016101100	10国债附息07X03	1,300,000	126,570,000.00	4.76	2	140220	14国债附息	1,200,000	120,156,000.00	4.47	3	11174664	177州转债附息03X03	1,145,000	114,564,000.00	4.28	4	11174664	177州转债附息03X03	1,145,000	114,564,000.00	4.28	5	122465	12国债附息07X02	887,000	86,102,400.00	3.20																																																	
序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																																																																																				
1	1016101100	10国债附息07X03	1,300,000	126,570,000.00	4.76																																																																																			
2	140220	14国债附息	1,200,000	120,156,000.00	4.47																																																																																			
3	11174664	177州转债附息03X03	1,145,000	114,564,000.00	4.28																																																																																			
4	11174664	177州转债附息03X03	1,145,000	114,564,000.00	4.28																																																																																			
5	122465	12国债附息07X02	887,000	86,102,400.00	3.20																																																																																			
<div>26 长江证券股份有限公司</div> <div>注册地: 湖北省武汉市新华路100号 办公地址: 湖北省武汉市新华路100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 027-83306666 传真: 027-83306666 网址: www.cjsec.com</div>	<div>79 众安(北京)基金销售有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.zhongan.com</div>	<div>80 南昌证券有限责任公司</div> <div>注册地: 江西省南昌市红谷滩新区100号 办公地址: 江西省南昌市红谷滩新区100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0791-83306666 传真: 0791-83306666 网址: www.ncsec.com</div>	<div>121 上海基煜基金销售有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.jiayu.com</div>	<div>1.6 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明细</div> <div>注:本基金本报告期末未有资产支持证券。</div> <div>1.7 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明细</div> <div>注:本基金本报告期末未有贵金属。</div> <div>1.8 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</div> <div>注:本基金本报告期末未有权证。</div> <div>1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明</div> <div>注:本基金报告期内未投资股指期货。</div> <div>1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明</div> <div>注:本基金报告期内未投资国债期货。</div> <div>1.11 投资组合报告附注</div> <div>1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。</div> <div>1.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。</div> <div>1.11.3 其他资产构成</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>资产名称</th><th>名称</th><th>金额(人民币元)</th></tr></thead><tbody><tr><td>1</td><td>存出保证金</td><td>-</td><td>65,280.76</td></tr><tr><td>2</td><td>应收证券清算款</td><td>-</td><td>563,430.51</td></tr><tr><td>3</td><td>应收利息</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>4</td><td>应收股利</td><td>-</td><td>42,971,227.30</td></tr><tr><td>5</td><td>应收申购款</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>6</td><td>其他应收款</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>7</td><td>预付款项</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>8</td><td>其他</td><td>-</td><td>-</td></tr><tr><td>9</td><td>合计</td><td>-</td><td>43,589,907.99</td></tr></tbody></table>	序号	资产名称	名称	金额(人民币元)	1	存出保证金	-	65,280.76	2	应收证券清算款	-	563,430.51	3	应收利息	-	-	4	应收股利	-	42,971,227.30	5	应收申购款	-	-	6	其他应收款	-	-	7	预付款项	-	-	8	其他	-	-	9	合计	-	43,589,907.99																																												
序号	资产名称	名称	金额(人民币元)																																																																																					
1	存出保证金	-	65,280.76																																																																																					
2	应收证券清算款	-	563,430.51																																																																																					
3	应收利息	-	-																																																																																					
4	应收股利	-	42,971,227.30																																																																																					
5	应收申购款	-	-																																																																																					
6	其他应收款	-	-																																																																																					
7	预付款项	-	-																																																																																					
8	其他	-	-																																																																																					
9	合计	-	43,589,907.99																																																																																					
<div>27 江海证券有限公司</div> <div>注册地: 黑龙江省哈尔滨市香坊区100号 办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0451-83306666 传真: 0451-83306666 网址: www.jianghai.com</div>	<div>81 宜信普华投资顾问(北京)有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.yixin.com</div>	<div>82 浙江天相基金销售有限公司</div> <div>注册地: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 办公地址: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0571-83306666 传真: 0571-83306666 网址: www.tianxiang.com</div>	<div>122 深圳市合子基金销售有限公司</div> <div>注册地: 广东省深圳市福田区福安路100号 办公地址: 广东省深圳市福田区福安路100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0755-83306666 传真: 0755-83306666 网址: www.hezifund.com</div>	<div>1.12 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明细</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>股票代码</th><th>股票名称</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></thead><tbody><tr><td>1</td><td>000333</td><td>润兴股份</td><td>85,000</td><td>17,434,005.60</td><td>0.65</td></tr><tr><td>2</td><td>001988</td><td>招商银行</td><td>1,707,629</td><td>15,958,967.28</td><td>0.60</td></tr><tr><td>3</td><td>001910</td><td>中国平安</td><td>614,500</td><td>14,896,480.00</td><td>0.55</td></tr><tr><td>4</td><td>000793</td><td>建设银行</td><td>1,106,400</td><td>14,351,812.00</td><td>0.53</td></tr><tr><td>5</td><td>001456</td><td>广汇股份</td><td>723,150</td><td>13,996,963.00</td><td>0.52</td></tr><tr><td>7</td><td>000786</td><td>北新建材</td><td>800,300</td><td>12,676,762.00</td><td>0.47</td></tr><tr><td>8</td><td>000513</td><td>神州高铁</td><td>224,400</td><td>9,561,564.00</td><td>0.36</td></tr><tr><td>9</td><td>001984</td><td>光大银行</td><td>1,480,600</td><td>8,213,360.00</td><td>0.31</td></tr><tr><td>10</td><td>002385</td><td>神州药业</td><td>130,000</td><td>7,476,275.00</td><td>0.28</td></tr></tbody></table>	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	000333	润兴股份	85,000	17,434,005.60	0.65	2	001988	招商银行	1,707,629	15,958,967.28	0.60	3	001910	中国平安	614,500	14,896,480.00	0.55	4	000793	建设银行	1,106,400	14,351,812.00	0.53	5	001456	广汇股份	723,150	13,996,963.00	0.52	7	000786	北新建材	800,300	12,676,762.00	0.47	8	000513	神州高铁	224,400	9,561,564.00	0.36	9	001984	光大银行	1,480,600	8,213,360.00	0.31	10	002385	神州药业	130,000	7,476,275.00	0.28																								
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	000333	润兴股份	85,000	17,434,005.60	0.65																																																																																			
2	001988	招商银行	1,707,629	15,958,967.28	0.60																																																																																			
3	001910	中国平安	614,500	14,896,480.00	0.55																																																																																			
4	000793	建设银行	1,106,400	14,351,812.00	0.53																																																																																			
5	001456	广汇股份	723,150	13,996,963.00	0.52																																																																																			
7	000786	北新建材	800,300	12,676,762.00	0.47																																																																																			
8	000513	神州高铁	224,400	9,561,564.00	0.36																																																																																			
9	001984	光大银行	1,480,600	8,213,360.00	0.31																																																																																			
10	002385	神州药业	130,000	7,476,275.00	0.28																																																																																			
<div>28 东吴证券股份有限公司</div> <div>注册地: 江苏省苏州市姑苏区100号 办公地址: 江苏省苏州市姑苏区100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0512-83306666 传真: 0512-83306666 网址: www.dongwu.com</div>	<div>83 南京聚利基金销售有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.juliyun.com</div>	<div>84 鑫聚源资产管理有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.xinjiyuan.com</div>	<div>123 北京普华投资顾问(北京)有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.pwcc.com.cn</div>	<div>1.13 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权证投资明细</div> <div>注:本基金本报告期末未有权证。</div> <div>1.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细</div> <div>注:本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。</div> <div>1.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明</div> <div>注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。</div> <div>§ 12 基金业绩</div> <div>基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。</div> <div>基金管理人及基金托管人根据基金合同规定,在基金资产净值的基础上,按照基金合同约定的费率计提管理费,并计入基金资产净值。</div> <div>1. 基金费用的种类</div> <div>1.1 基金管理人的管理费</div> <div>2. 基金托管人的托管费</div> <div>3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费</div> <div>4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所、审计费、诉讼费、仲裁费</div> <div>5. 基金持有人持有基金的费用</div> <div>6. 基金的投资、赎回费用</div> <div>7. 基金的销售费用</div> <div>8. 基金的相关账户费及维护费</div> <div>9. 按照国家有关规定及《基金合同》约定,可以在基金资产中列支的其他费用。</div> <div>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</div> <div>1. 基金管理人的管理费</div> <div>本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:</div> <div>$H = E \times 1.3\% \div \text{当年天数}$</div> <div>H为每日应计提的基金管理费</div> <div>E为前一日基金资产净值</div> <div>基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</div> <div>2. 基金托管人的托管费</div> <div>本基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:</div> <div>$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$</div> <div>H为每日应计提的基金托管费</div> <div>E为前一日基金资产净值</div> <div>基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</div> <div>三、不列入基金费用的项目</div> <div>下列费用不列入基金费用:</div> <div>1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失;</div> <div>2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;</div> <div>3. 《基金合同》生效前的相关费用;</div> <div>4. 其他根据相关法律法规和中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。</div> <div>四、费用调整</div> <div>基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、托管费率,无需召开基金份额持有人大会。调高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。</div> <div>五、基金税收</div> <div>本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。</div> <div>§ 14 对招募说明书更新情况的说明</div> <div>本基金管理人根据基金法律法规及中国证监会的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的招募说明书进行了更新,主要内容更新如下:</div> <div>1. 在“重要提示”部分,对“重要提示”进行了更新。</div> <div>2. 在“基金管理人”部分,对“主要人员情况”进行了更新。</div> <div>3. 在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新。</div> <div>4. 在“相关服务机构”部分,对“销售机构”进行了更新。</div> <div>5. 在“基金份额的申购和赎回”部分,对“申购与赎回的数额限制”进行了更新。</div> <div>6. 在“基金资产的估值”部分,对“基金资产的估值”进行了更新。</div> <div>7. 在“基金的投资”部分,对“基金投资组合报告”进行了更新,对“基金业绩”进行了更新。</div> <div>8. 在“基金持有人服务”部分,对“基金持有人服务”进行了更新。</div> <div>9. 在“其他应披露事项”部分,对“其他应披露事项”进行了更新。</div> <div>10. 对部分其他表述进行了更新。</div> <div>南方基金集团有限公司</div> <div>2017年8月16日</div>																																																																																				
<div>29 山西证券股份有限公司</div> <div>注册地: 山西省太原市府西街100号 办公地址: 山西省太原市府西街100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0351-83306666 传真: 0351-83306666 网址: www.sxsec.com</div>	<div>85 南京聚利基金销售有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.juliyun.com</div>	<div>86 北京天泽基金销售有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.tianze.com</div>	<div>124 上海基煜基金销售有限公司</div> <div>注册地: 上海市浦东新区世纪大道1500号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1500号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 021-58008000 传真: 021-58008000 网址: www.jiayu.com</div>	<div>1.16 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股票投资明细</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>股票代码</th><th>股票名称</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></thead><tbody><tr><td>1</td><td>000333</td><td>润兴股份</td><td>85,000</td><td>17,434,005.60</td><td>0.65</td></tr><tr><td>2</td><td>001988</td><td>招商银行</td><td>1,707,629</td><td>15,958,967.28</td><td>0.60</td></tr><tr><td>3</td><td>001910</td><td>中国平安</td><td>614,500</td><td>14,896,480.00</td><td>0.55</td></tr><tr><td>4</td><td>000793</td><td>建设银行</td><td>1,106,400</td><td>14,351,812.00</td><td>0.53</td></tr><tr><td>5</td><td>001456</td><td>广汇股份</td><td>723,150</td><td>13,996,963.00</td><td>0.52</td></tr><tr><td>7</td><td>000786</td><td>北新建材</td><td>800,300</td><td>12,676,762.00</td><td>0.47</td></tr><tr><td>8</td><td>000513</td><td>神州高铁</td><td>224,400</td><td>9,561,564.00</td><td>0.36</td></tr><tr><td>9</td><td>001984</td><td>光大银行</td><td>1,480,600</td><td>8,213,360.00</td><td>0.31</td></tr><tr><td>10</td><td>002385</td><td>神州药业</td><td>130,000</td><td>7,476,275.00</td><td>0.28</td></tr></tbody></table>	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	000333	润兴股份	85,000	17,434,005.60	0.65	2	001988	招商银行	1,707,629	15,958,967.28	0.60	3	001910	中国平安	614,500	14,896,480.00	0.55	4	000793	建设银行	1,106,400	14,351,812.00	0.53	5	001456	广汇股份	723,150	13,996,963.00	0.52	7	000786	北新建材	800,300	12,676,762.00	0.47	8	000513	神州高铁	224,400	9,561,564.00	0.36	9	001984	光大银行	1,480,600	8,213,360.00	0.31	10	002385	神州药业	130,000	7,476,275.00	0.28																								
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	000333	润兴股份	85,000	17,434,005.60	0.65																																																																																			
2	001988	招商银行	1,707,629	15,958,967.28	0.60																																																																																			
3	001910	中国平安	614,500	14,896,480.00	0.55																																																																																			
4	000793	建设银行	1,106,400	14,351,812.00	0.53																																																																																			
5	001456	广汇股份	723,150	13,996,963.00	0.52																																																																																			
7	000786	北新建材	800,300	12,676,762.00	0.47																																																																																			
8	000513	神州高铁	224,400	9,561,564.00	0.36																																																																																			
9	001984	光大银行	1,480,600	8,213,360.00	0.31																																																																																			
10	002385	神州药业	130,000	7,476,275.00	0.28																																																																																			
<div>30 渤海证券股份有限公司</div> <div>注册地: 天津市经济技术开发区100号 办公地址: 天津市经济技术开发区100号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 022-83306666 传真: 022-83306666 网址: www.bhsec.com</div>	<div>87 浙江钱银基金销售有限公司</div> <div>注册地: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 办公地址: 浙江省杭州市西湖区文三路121号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 0571-83306666 传真: 0571-83306666 网址: www.qiannyi.com</div>	<div>88 北京金创金源投资管理有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.jinchuang.com</div>	<div>125 大财证券基金销售有限公司</div> <div>注册地: 北京市西城区德胜门内大街118号 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街118号 法定代表人: 李兆强 联系人: 王芳 电话: 010-58008000 传真: 010-58008000 网址: www.dacai.com</div>	<div>1.17 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债券投资明细</div> <table><thead><tr><th>序号</th><th>债券名称</th><th>数量(张)</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr></thead><tbody><tr><td>1</td><td>1016101100</td><td>10国债附息07X03</td><td>1,300,000</td><td>126,570,000.00</td><td>4.76</td></tr><tr><td>2</td><td>140220</td><td>14国债附息</td><td>1,200,000</td><td>120,156,000.00</td><td>4.47</td></tr><tr><td>3</td><td>11174664</td><td>177州转债附息03X03</td><td>1,145,000</td><td>114,564,000.00</td><td>4.28</td></tr><tr><td>4</td><td>11174664</td><td>177州转债附息03X03</td><td>1,1</td></tr></tbody></table>	序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	1	1016101100	10国债附息07X03	1,300,000	126,570,000.00	4.76	2	140220	14国债附息	1,200,000	120,156,000.00	4.47	3	11174664	177州转债附息03X03	1,145,000	114,564,000.00	4.28	4	11174664	177州转债附息03X03	1,1																																																									
序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																																																																																				
1	1016101100	10国债附息07X03	1,300,000	126,570,000.00	4.76																																																																																			
2	140220	14国债附息	1,200,000	120,156,000.00	4.47																																																																																			
3	11174664	177州转债附息03X03	1,145,000	114,564,000.00	4.28																																																																																			
4	11174664	177州转债附息03X03	1,1																																																																																					