

信息披露 Disclosure

富国中证100指数增强型证券投资基金 (LOF)

2018年第三季度报告

本报告期末本基金投资组合公允价值为 2,289,326,028.06 元，较上一报告期末增长 1.12%。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
报告期内本基金严格按照基金合同及招募说明书中约定的投资策略进行投资。鉴于外部环境变化，宏观政策...

4.5 投资组合报告
4.5.1 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 177,762,203.20 7.80%

2 固定收益投资 177,762,203.20 7.80%

3 贵金属投资 - - -

4 金融衍生品投资 - - -

5 买入返售金融资产 - - -

6 银行存款和结算备付金合计 14,076,290.30 0.62%

7 其他资产 15,116,326.26 0.67%

8 合计 215,656,722.96 9.50%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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 农林、牧、渔业 - - -

B 采矿业 - - -

C 制造业 26,145,430.76 1.16%

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - - -

E 建筑业 - - -

F 交通运输、仓储和邮政业 - - -

G 信息技术业 - - -

H 住宿和餐饮业 - - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 3,014,226.09 1.35%

J 金融业 - - -

K 房地产业 - 1,794,328.00 0.79%

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 - - -

O 教育 - - -

P 文化、体育和娱乐业 - - -

Q 综合 - - -

合计 34,226,806.60 1.51%

5.2.2 报告期末按数量权重的股票投资组合
代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林、牧、渔业 - - -

B 采矿业 - - -

C 制造业 26,145,430.76 1.16%

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - - -

E 建筑业 - - -

F 交通运输、仓储和邮政业 - - -

G 信息技术业 - - -

H 住宿和餐饮业 - - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 3,014,226.09 1.35%

J 金融业 - - -

K 房地产业 - 1,794,328.00 0.79%

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 - - -

O 教育 - - -

P 文化、体育和娱乐业 - - -

Q 综合 - - -

合计 34,226,806.60 1.51%

5.2.3 报告期末按市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 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 000033 美的集团 31,200 4,698,070.00 2.07%

2 000001 平安银行 1,000,000 4,698,070.00 2.07%

3 000024 招商局港口 114,300 4,698,070.00 2.07%

4 000002 万科A 40,200 4,698,070.00 2.07%

5 000009 许继电气 30,300 4,698,070.00 2.07%

6 000028 宁沪高速 62,200 4,698,070.00 2.07%

7 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

8 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

9 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

10 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

11 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

12 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

13 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

14 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

15 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

16 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

17 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

18 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

19 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

20 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

21 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

22 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

23 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

24 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

25 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

26 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

27 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

28 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

29 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

30 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

31 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

32 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

33 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

34 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

35 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

36 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

37 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

38 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

39 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

40 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

41 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

42 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

43 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

44 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

45 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

46 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

47 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

48 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

49 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

50 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

51 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

52 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

53 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

54 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

55 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

56 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

57 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

58 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

59 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

60 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

61 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

62 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

63 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

64 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

65 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

66 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

67 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

68 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

69 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

70 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

71 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

72 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

73 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

74 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

75 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

76 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

77 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

78 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

79 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

80 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

81 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

82 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

83 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

84 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

85 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

86 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

87 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

88 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

89 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

90 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

91 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

92 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

93 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

94 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

95 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

96 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

97 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

98 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

99 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

100 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

101 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

102 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

103 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

104 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

105 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

106 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

107 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

108 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

109 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

110 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

111 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

112 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

113 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

114 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

115 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

116 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

117 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

118 000010 深天马A 19,200 4,698,070.00 2.07%

119 000025 长飞光纤 152,000 4,698,070.00 2.07%

120 000069 顺丰控股 18,400 4,698,070.00 2.07%

121 000004 圣农发展 223,600 4,698,070.00 2.07%

122 000014 上海机场 19,200 4,698,070.00 2.07%

123 000026 飞力达 34,200 4,698,070.00 2.07%

124 000029 粤高速A 47,000 4,698,070.00 2.07%

125 000017 恒顺醋业 33,300 4,698,070.00 2.07%

126 000006 鲁商置业 22,200 4,698,070.00 2.07%

127 000012 美都能源 20,300 4,698,070.00 2.07%

128 000003 盐湖股份 31,200 4,698,070.00 2.07%

129 000008 神州高铁 39,200 4,698,070.00 2.07%

130 000005 宝钢股份 37,200 4,698,070.00 2.07%

131 000007 中国神华 33,200 4,698,070.00 2.07%

132 000010 深天马A 19,200 4,69