

(上接B172版)

81	申万宏源西部证券有限公司	注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2006室 法定代表人:李季 电话:0991-2307106 客服电话:4008000662 网址:www.hysec.com	联系人:王怀春 传真:0991-2301927 网址:www.hysec.com
82	华西证券股份有限公司	注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人:杨炯明 联系电话:010-52722273 客户服务热线:06684 网址:www.ha168.com.cn	联系人:潘明海 电话:028-98150040 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
83	九州证券股份有限公司	注册地址:青海省西宁市中区西大街11号工商银行7楼 法定代表人:曲国辉 客服电话:063636 网址:www.jiuzhou.com	联系人:曲国辉 客服电话:063636
84	杭州联合农村商业银行股份有限公司	注册地址:杭州市建国中路90号 法定代表人:张磊 电话:0571-87923226 客服电话:0695274 网址:www.uabcb.com.cn	联系人:仇晓宁 传真:0571-87923214 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
85	包商银行股份有限公司	注册地址:内蒙古包头市钢铁大街6号 法定代表人:李镇西 电话:0472-5189061 客服电话:06016(北京、内蒙古地区) 网址:www.bsb.com.cn	法定代表人:刘芳 电话:0472-5189061 电话:0472-5189067
86	山东寿光农村商业银行股份有限公司	注册地址:山东寿光市光明路19号 法定代表人:郝廷军 电话:0536-5203766 客服电话:0536-90633 网址:www.sbgny.com.cn	联系人:周淑贞 传真:0536-5203766 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
87	晋商银行股份有限公司	注册地址:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦A座 法定代表人:贾俊生 客服电话:06105688 网址:www.jshbank.com	联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
88	宁波银行股份有限公司	注册地址:宁波市鄞州区中南路700号 法定代表人:陆华斌 客服电话:96574 网址:www.nbcb.com.cn	联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
89	浙商银行股份有限公司	注册地址:浙江省杭州市庆春路288号 法定代表人:张达洋 客服电话:956227 网址:www.czbank.com	联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
90	张家港农村商业银行股份有限公司	注册地址:张家港市人民中路66号 法定代表人:王自忠 电话:0512-90065 传真:0512-9006259 网址:www.zrbank.com.cn	联系人:朱芳 客服电话:0512-90065 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
91	广发银行股份有限公司	注册地址:广东省越秀区东风东路713号 法定代表人:杨明华 电话:020-38222898 客服电话:400-830-0003 网址:www.cmfchina.com.cn	联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
92	苏州银行股份有限公司	注册地址:江苏省苏州工业园区钟园路728号 法定代表人:王兰凤 电话:0512-69893365 客服电话:0512-96067 网址:www.suzhoubank.com	联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
93	江苏江南农村商业银行股份有限公司	注册地址:常州市和平中路413号 法定代表人:陆向阳 电话:0519-89966170 客服电话:0519390005 网址:www.jnbank.com.cn	联系人:仇静 传真:0519-89966170 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390

(2) 第三方销售机构

序号	机构名称	机构信息
1	诺亚正行基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A栋 法定代表人:汪静波 电话:021-38602377 客服电话:400-821-5399 网址:www.noah-fund.com
2	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼241号 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-900室 法定代表人:杨文斌 电话:021-20613999 客服电话:400-700-9665 网址:www.ehowbuy.com
3	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号16楼20室 办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人:陈柏青 电话:0571-28829790 客服电话:4000-766-123 网址:www.danjiu.com
4	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801 法定代表人:薛峰 电话:0755-33227960 传真:0755-82090788 网址:www.zlfund.cn 及 www.jmmw.com
5	上海长晟基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区浦东南路556号裕阳国际B座16层 法定代表人:张庆伟 电话:021-58788678-8201 客服电话:400-820-2899 网址:www.shengfunds.com
6	北京展恒基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东后厂营路6号 办公地址:北京市朝阳区东后厂营路6号 法定代表人:闫振杰 电话:010-62003088-8288 传真:010-62003088-8802 客服电话:4008889061 网址:www.myfund.com
7	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址:杭州市文二西路1号903室 办公地址:杭州市余杭区五福街道同顺街18号同顺大厦 法定代表人:凌顺平 电话:0571-88911818-8863 客服电话:4008-773-772 网址:www.5ifund.com
8	江苏金百临投资咨询有限公司	注册地址:无锡市滨湖区锦溪路99号 法定代表人:费晓峰 电话:0510-82758877 客服电话:0510-9688988 网址:www.jgbdc.com
9	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二楼 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座 法定代表人:其实 电话:021-54656877 客服电话:4008181818 网址:www.1234567.com.cn
10	众升财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京科技园13号楼A座9层908室 办公地址:北京市朝阳区望京科技园13号楼A座9层908室 法定代表人:李昭弟 电话:010-69497361 客服电话:400-876-9988 网址:www.zcfund.com
11	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 办公地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 法定代表人:李兴春 电话:021-50658353 客服电话:400-921-7765 网址:www.lidfund.com
12	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室 办公地址:北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室 法定代表人:薛峰 电话:010-62151969 客服电话:400-156-5600 网址:www.shund.com
13	浙江金观诚基金销售有限公司	注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(银隆大厦)1幢10楼1001室 办公地址:杭州市拱墅区登云路45号银隆大厦一楼金观诚财富 法定代表人:徐家豪 电话:0571-8837888 客服电话:400-068-0068 网址:www.jincheng-fund.com
14	康庆财富管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 法定代表人:赵学军 电话:021-20289890 传真:021-20280110,010-85097308 网址:www.harvestwm.cn
15	宜信普泽(上海)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1501室 办公地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1501室 法定代表人:沈伟伟 电话:010-52828244 客服电话:400-6099-200 网址:www.yixinfund.com
16	一牧财富(北京)信息科技有限公司	注册地址:北京市西城区广安门大街2号万通新世界广场A座222208 办公地址:北京市西城区广安门大街2号万通新世界广场A座2208 法定代表人:吴秀秀 电话:400-001-1566 客服电话:4006411999 网址:www.yimufund.com
17	北京增财基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号12号楼1206号 办公地址:北京市西城区南礼士路66号12号楼1206号 客户服务电话:400-001-8811 公司网站:www.zcvc.com.cn
18	汇付基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区中山东路100号19楼 办公地址:上海市徐汇区虹梅路1801号凯利国际大厦7楼 法定代表人:金浩 客服电话:400-821-3869 手机客户端:天天基金金
19	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人:鲍东华 客户服务热线:400-821-9031 网站:www.lufund.com
20	泰诚财富基金销售有限公司(天津)有限公司	注册地址:天津滨海新区塘沽泰达大街13号泰达财富中心金融商业楼341室 办公地址:天津市滨海新区塘沽泰达大街13号泰达财富中心金融商业楼341室 法定代表人:梁洪军 客户服务热线:400-819-6905 网址:www.taichengfund.com
21	北京铁基基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号12号楼1008-1012 办公地址:北京市西城区南礼士路66号12号楼1008-1012 法定代表人:赵爽 电话:010-57418829 客服电话:400-893-6885 网址:www.qianjin.com
22	北京虹点基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路2号裙楼2层2222单元 办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路2号裙楼2层2222单元 法定代表人:胡伟 客户服务热线:400-618-0707 网址:www.hongdianfund.com
23	北京微动利基金销售有限公司	注册地址:北京市石景山区古城西路139号景山财富中心金融商业楼341室 办公地址:北京市石景山区古城西路139号景山财富中心金融商业楼341室 法定代表人:梁洪军 客户服务热线:400-819-6905 网址:www.bayifund.com.cn

24	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道田厦1708号华融大厦27层2704 公司地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座8层 客户服务电话:400-166-1188 法定代表人:张彦 电话:010-8363101 网址:83j.com.cn	联系人:文雯 电话:010-8363101 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
25	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 法定代表人:陈健武 电话:021-63333319 客服电话:4006-433-389 网址:www.lingxianfund.com	联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
26	深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦36层01B.02.03.04单元 办公地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦36层01B.02.03.04单元 法定代表人:刘鹏宇 电话:0755-83999007-815 客服电话:0755-83999007 网址:www.jinjiawu.com	联系人:杨南 电话:0755-83999007-815 传真:0755-83999006
27	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号106室-3491 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203单元 法定代表人:肖雯 电话:020-185000725 客服电话:020-89620099 网址:www.yingmi.com	联系人:李孟军 电话:021-63333330 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
28	北京新浪乐信基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼515室 办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼515室 法定代表人:李海鹏 电话:010-62976405 客服电话:010-62675369 网址:www.xinlei.com	联系人:付文红 电话:010-62976405 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
29	上海万得基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座 法定代表人:王廷富 电话:021-51327185 客服电话:021-51327185 网址:www.52fund.com.cn	联系人:姜吉灵 电话:021-51327185 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
30	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号 办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号(苏宁总部) 法定代表人:钱燕飞 电话:025-66966699-884131 客服电话:025-66966699-884131 网址:www.snjfund.com	联系人:喻明明 电话:025-66966699-884131 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
31	北京汇成基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108 法定代表人:王树刚 电话:010-56282140 客服电话:400-619-9069 网址:www.hcfund.com	联系人:李树刚 电话:010-56282140 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
32	天津万家财富资产管理有限公司	注册地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋大厦A座5层 法定代表人:李修峰 电话:010-59013785 网址:www.wanjiawalth.com	联系人:邵玉磊 电话:010-59013785 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
33	北京创金恒信基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址:北京市西城区阜成门内大街11号18层 法定代表人:梁静 电话:010-66154828 客服电话:400-6262-818 网址:www.creicfund.com	联系人:李静卿 电话:010-66154828 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
34	北京格上富信基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室 办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室 法定代表人:李悦童 电话:010-69883311 客服电话:400-066-8868 网址:www.igesale.com	联系人:陈庆顺 电话:010-69883311 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
35	北京肯特瑞基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 办公地址:北京市亦庄经济开发区宏达北路10号5层5122室 法定代表人:江卉 电话:010-89183343 客服电话:4006185118 APP下载网址:danjiuapp.com	联系人:赵建勇 电话:010-89183343 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
36	北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层22207 办公地址:北京市朝阳区望京SOHO T2 B座202 法定代表人:钟斐斐 电话:010-61940688 客服电话:4006185118 APP下载网址:danjiuapp.com	联系人:陈瑞瑞 电话:010-61940688 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
37	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室 办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号SOHO嘉盛中心30层3001室 法定代表人:周斌 电话:010-59313555 客服电话:4008800618 网址:www.chtmw.com	联系人:张衡 电话:010-59313555 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
38	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层 法定代表人:李一梅 电话:010-88066632 客服电话:400-817-5666 网址:www.huaxiafund.com	联系人:李一梅 电话:010-88066632 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
39	通华财富(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区同丰路667弄701号201室 办公地址:上海市浦东新区高翔路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼9楼 法定代表人:兰奇 电话:021-60818110 客服电话:021-60818110 网址:www.tonghuafund.com	联系人:王洁茹 电话:021-60818110 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
40	北京植信基金销售有限公司	注册地址:北京市密云县云里街88号2号楼106室-67 办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号 法定代表人:于龙 电话:010-56075718 客服电话:4006-802-123 网址:www.zhi信fund.com	联系人:吴鹏 电话:010-56075718 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
41	和鼎传承基金销售有限公司	注册地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6F 办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6F 法定代表人:李海峰 电话:0371-85618396 客服电话:4000-555-671 网址:www.hdcpt.com	联系人:李海峰 电话:0371-85618396 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
42	腾安基金销售有限公司(深圳)有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址:深圳市南山区科技中一路腾讯大厦 法定代表人:刘明军 电话:0755-26661616 客服电话:0755-26661616 网址:www.tengxianfund.com	联系人:李海峰 电话:0755-26661616 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390
43	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室 办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层 法定代表人:钱昊昊 电话:010-59363866 联系人:徐英 电话:010-59363866 客服电话:4008030998 网址:www.jinco.com	联系人:李海峰 电话:010-59363866 联系人:李朝明 电话:021-63333319 传真:021-63333390

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。

(二) 注册登记机关
名称:国泰基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室
办公地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层1611-19层
法定代表人:陈勇胜
联系人:李怡
传真:021-31081800
客户服务专线:400-888-8688,021-31089000
(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
联系电话:021-23318888
传真:021-31358600
经办律师:黎明、丁媛
联系人:丁媛
(四) 审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元
办公地址:上海市湖滨202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:魏佳亮
经办注册会计师:许康玮、魏佳亮
四、基金的名称

国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型和存续期限

1、基金类型:混合型证券投资基金

2、基金运作方式:契约型开放式

3、基金的存续期间:不定期

六、投资目标

本基金以通过灵活的大类资产配置,积极把握个股的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

七、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内上市交易的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及其他中国证监会允许投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

其中,股票、权证等资产占基金资产的30%-80%,债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%-70%。其中,本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人可在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

八、投资策略

1.资产配置策略

本基金管理人依据Melva资产评估体系,通过考量宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关变量指标的变化,评估确定一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

2.股票投资策略

(1) 盈利能力股票筛选

本基金的股票资产投资主要以具有投资价值的股票作为投资对象,采取自下而上精选个股策略,利用ROIC、ROE、股息率等财务指标筛选出盈利能力强的上市公司,构成具有盈利能力的股票备选池。

(2) 价值评估分析

本基金通过价值评估分析,选择价值被低估上市公司,形成优化的股票池。价值评估分析主要运用国际化视野,采用专业的估值模型,合理使用估值指标,选择其中价值被低估的公司,具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EV/EBITDA、股息贴现模型等,基金管理人根据不同行业特征和市场特征灵活运用,努力从估值层面为持有人发掘价值。

(3) 实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司,公司投资研究团队将实地调研上市公司,深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性,投资研究团队还将通过对上市公司的外部合作机构和相关行政管理部

门进一步调研,对上述结论进行核实。

(4) 投资组合建立和调整

本基金将在案头分析和实地调研的基础上,建立和调整投资组合。在投资组合管理过程中,本基金还将注重投资品种的交易活跃程度,以保证投资组合具有良好的流动性。

3.债券投资策略

本基金的债券资产投资主要以中长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。

4.权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下追求稳健的超额收益。

5.资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

6.股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:60%“沪深300指数收益率+40%“中证全债指数收益率

十、风险收益特征

本基金是一只灵活配置的混合型基金,属于基金中的中高风险品种,本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

十一、基金投资报告

基金管理人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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金基金合同约定,于2018年10月23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9月30日,本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	81,863,562.29	79.46
2	其中:股票	81,863,562.29	79.46
3	固定收益投资	12,853,956.44	12.47
4	其中:债券	12,853,956.44	12.47
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	8,231,390.01	7.99
11	其他各项资产	90,947.43	0.09
12	合计	103,039,853.17	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,161,000.00	1.13
B	采矿业	3,007,117.00	2.93
C	制造业	30,771,696.66	29.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,089,598.00	1.06
E	建筑业	4,296,037.67	4.18
F	批发和零售业	724,156.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	2,923,274.00	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,630,146.00	3.53
J	金融业	26,742,615.16	26.04
K	房地产业	2,382,949.00	2.32
L	租赁和商务服务业	1,061,456.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	438,779.55	0.43
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	3,634,394.25	3.54
S	综合	-	-
	合计	81,863,562.29	79.72