

中金沪深300指数增强型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

5.2.1 报告期末按股票投资行业分类的境内股票投资组合		
行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
农林、牧、渔业	-	-
采矿业	779,008.76	3.81
制造业	7,262,119.64	35.60
电力、热力、燃气及生产与供应业	768,956.00	3.90
建筑业	548,101.00	2.70
批发和零售业	596,981.63	2.92
交通运输、仓储和邮政业	639,885.68	3.13
住宿和餐饮业	-	-
信息传输、软件和信息技术服务业	391,614.00	0.94
金融业	7,173,629.24	36.07
房地产业	1,066,076.96	5.36
租赁和商务服务业	390,612.00	1.91
科学研究和技术服务业	-	-
水利、环境和公共设施管理业	49,472.00	0.24
教育、文体和娱乐业	-	-
卫生和社会工作	-	-
文化、体育和娱乐业	48,688.00	0.24
综合	-	-
合计	19,373,438.91	94.71

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.4 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

5.2.5 报告期末指数投资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	23,200	1,301,520.00	6.36
2	000051	格力电器	28,077	1,092,088.13	4.90
3	600196	华谊兄弟	62,688	785,216.52	3.79
4	600016	民生银行	125,781	709,355.12	3.40
5	600058	五粮液	18,916	563,860.48	2.61
6	601328	交通银行	87,486	569,538.15	2.64
7	600039	中国石化	96,600	497,530.00	2.40
8	600031	三一重工	46,466	414,059.30	2.01
9	600818	中国银行	111,260	411,462.20	2.02
10	601006	大秦铁路	47,716	392,762.61	1.92

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	23,200	1,301,520.00	6.36
2	000051	格力电器	28,077	1,092,088.13	4.90
3	600196	华谊兄弟	62,688	785,216.52	3.79
4	600016	民生银行	125,781	709,355.12	3.40
5	600058	五粮液	18,916	563,860.48	2.61

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140005	14国债05	1,104,840.00	5.40
2	140006	14国债06	1,104,840.00	5.40
3	140007	14国债07	1,104,840.00	5.40
4	140008	14国债08	1,104,840.00	5.40
5	140009	14国债09	1,104,840.00	5.40

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,138,713.61	7.97