

中海上证50指数增强型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:中海基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 送出日期:2019年3月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会。董事保证本报偿所载资料不存在虚假记载、误号性陈述成出土遗漏、并对其内容的实效性、海地性识影性失程个例及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上效应董事签字问意,并由董事长客发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司以下简称"工商银行")根据本基金合同规定,于2019年3月20日复核了本核色中的纳劳精炼、沙值表现、利润分配情况。对务会计报告、投资组合报告等内容、保证复核内各不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人来指以该定信用,勤勉是表的的职则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金管理人来指以该定信用,勤勉是表的的职则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金管理人来指以该定信用,勤勉是表的的职则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金管理人来指以该企信用,就是是有规定,投资者在作出投资决策响应仔细阅读本基金的招募的引入其互联。 本任银标件编建编件在原程内下文,投资者被了解证细内容,应解证在原程内下文。

基金简称	中海上证50指数增强
基金主代码	399001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月25日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	138,704,592.27份
基金合同存续期	不定期

X基金为股票指数增强型基金。在被动痕器标的指数 均基础上,加入增强型的剪模手段。力争它倾水基金 使置长率与业绩比较基础。2000月1日与限聚值偏离 均均对值不超过0.5%,在累路误差不超过7.5%。在约 增急对值不超过0.5%,在累路误差不超过7.5%。在约 排金组合原题误差的销售了力争投商高于业绩基 能价稳定收益,追求长期的资本增值。 造成的股票投资组合相对于标的指数的偏离,并 投资收益能够有效跟除并适度超越标的指数。 1、资产配置策略 为实现有效跟除标的指数并力争超越标的指

金额单位:人民币元

V締比较基准 基金管理人和基

吉息披露负责 r户服务电话

3.1 主要会计数据和财务地

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	4,535,865.85	6,154,233.18	-9,595,714.04
本期利润	-21,723,512.91	34,551,985.25	-9,588,295.79
加权平均基金份额本期利 润	-0.1865	0.2685	-0.0655
本期基金份额净值增长率	-14.64%	27.29%	-5.64%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份額利 润	0.0376	-0.0092	-0.0560
期末基金资产净值	146,271,931.60	145,203,034.89	125,388,991.48
期末基金份額净值	1.055	1.236	0.971
- 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末

在19人上7月2000年起的时间个包括17年7人以中央交易的集组了中央工厂(1994、77年2人会会员 费等)。1十人费用汽运和收益补产型使工厂开价数字。 注2:本期已3项股金油指益金本期利息收入,投资收益。其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费 用局的余额、本即利润为本即已实现收益加上本明公允价值变动收益。 3.2 基金净值表现 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	1)-(3)	2-4
过去三个月	-11.72%	1.52%	-11.41%	1.52%	-0.31%	0.00%
过去六个月	-5.47%	1.43%	-7.07%	1.44%	1.60%	-0.01%
过去一年	-14.64%	1.29%	-18.78%	1.30%	4.14%	-0.01%
过去三年	2.53%	1.11%	-4.54%	1.10%	7.07%	0.01%
过去五年	63.06%	1.49%	44.70%	1.50%	18.36%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	5.50%	1.43%	2.35%	1.43%	3.15%	0.00%
					至2018年12月3 F畝利塞(税后)	

3.3 过去三年基金的利润分配情况 注:本基金在过去三年未安生利润分配。 4.1 基金管理人及基金经理构成 5.4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1 施查特別人及独立定期的6.2 4.1 施查特別人及特型基金的经验 进金等別人自2004年3月10日成立以来,始终坚持"被求信用,勤勉是责"的原则,严格履行基金管理人 进金指队之,保健从允许经时间从实现的结果与管理模式,严密科学的风险管理机内部控制体系、为广大基 价等制持人,提供规划、专业的资产管理服务,截至2018年12月31日,其管理证券投资基金33只。 4.12 施金管理(建筑金管界)4.12 发金管理则原则介

姓名	z,	职务	任本基金的基	基金经理(助理)期 限	证券从业	说明
700 0			任职日期	离任日期	年限	
彭海平平		本理。 基金中用组设金、使用。 基金中产组设金、建筑工程、工程、工程、工程、工程、工程、工程、工程、工程、工程、工程、工程、工程、工	2013年1月8 日		84:	影衝平死生,中国科学优生,中国科学优生,中国科学优生,中国科学优生,中国科学优生,中国人们的工作,2000年12月,2000年12

解館的途裡,在获得相关申批后,由公司暂时关税投资风险系统的特定陶值、完成该交易后,公司立即自动赔价的免疫风险值。
行为监核机分析证法。
(1)公司债务提供证据。
行为监核机分析证法。(1)公司债务提供证法或对诉状设定组合进行间向交易价差分析、反似及异方交易分析。(2)公司债务检查从据告期的人间。10 日间市金额股部产于平间市间间的现在分反向交易分析。(2)对于不同时间间间的同组合反向交易及公司被理定的资金交易。公司裁据交易价格、公司被下不同时间间间的回组合反向交易及公司被理定的资金交易。公司裁据交易价值。(3)对于不同时间间间间间组合反向交易及公司被理定的资金交易。公司裁据应易价格、交易频率、交易数量、交易时机等进行综合分析。
422 公平交易则值的执行院院
422 公平交易则值的执行院院
422 公平交易则值的执行院院
422 公平交易则有的执行规则,2016年已经为证明的证据有股价差为零,7分析的检验,对上规划的自然的是公司证据(1)对于两限自合的同立实别。我们从目内。3日、5日三个时间区间进行假设价差为零,7分析的检验,对于未通过假设检验的的病见。公司结合社交票用组合的应交易,占付此,果然的往来就是还完全一定水平从,可用其有统计学及、规和利益验验金额的的结果,从可以自然可以自然可以有关系的方面进行合为时一段资格和目内反向交易,将结合市场接收费品种的造成交通批行综合分析。
(2)对于两限自合约应可必要。30回发期间一位分时一段资格和日内反向交易,将结合市场接收费品种的总成交通批行综合分析。
(3)对于公司制度设定的资金资金,间末提合表现于根据的定率基础之非私性并非面部确。综合而,水及可通过事间的制度规则,非中的监控机率与的分析评估,执行可公,不可通知或被定的有效之,并以可由这一个分别,以可以由于经验的工程分析。

辯查65%。他的年李康以東始新低,PMI在经历数月下降,排隔两年半月再回回领地抢战厂下,从最新的社最被服果者,比喻时比增进维续多月下海。但下海,在下降边域,企业是利力而,业物增进持续下海,PHI的边势性回溯也据看一个企业。但是一个企业,是

上证50指数增强基金在控制跟踪误差的前提下,超配券商。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

	『限公司編制和披露的中海上证50指数增强型证券投资基金2018年 ・配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容					
推确和完整。 6.1 审计报告基本信息	§ 6 审计报告					
B.1 申订报告基本信息 财务报表是否经过审计	臣					
由计算见类型	左 标准无保留意见					
审计报告编号	标准元保田思见 安永华明(2019)审字第61372718 B08号					
年	安水平明(2019)甲子弗61372718_B08号					
宙计报告标题	审计报告					
审计报告收件人	中海上证50指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人:					
审计意见	是但审计了原始的中海上进口的股票型正常高级的中海 提供的工作。但是10年12月3日的资产价值表。2018年度的利润表 所有者权益 基金伸倒,变动起义和状分外保护进 形成一次,原始的中海上进心的煅煌等型证券投资基金的 财务报表还再建工大河股限企业计准则的股速编制。公人 反映了中海上进心指数增强管理等投资基金的19年12月31日 的财务状态以及2018年2018年2018年2018年2018年2018年2018年2018年					
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审 计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步啊 该了我们在这些机则下的责任、按照中国注册会计师职业遗储 守则,我们独立于中海上证50指数增强型证券投资基金,并履行 了那业遗憾方面的其他责任。我们报信,我们联现的审计证规是 充分,适当的,为发表审计官及提供了基础。					
其他信息	中海上距ら附数增强照证券投资基金管理尽对其他信息负责。 其他信息经济生度报告中福德的信息。但不包括财务报表和我 们的审计报告。 我们对财务报表处表的审计意见不涵盖其他信息。我们也 不对其他信息发表任何形式的塞证结论。 给合规可划分积累的审计,我们的责任民间读其他信息。 在此过每年,考虑其他信息是否当财务报表或我们在审计过程 中了解则的情况存在出大一致成者似乎存在进大情报。 属于我们已执行的工作。如果我们确定其他信息存在进大 错报。我们应当报告读事实。在这方面,我们无任何事项需要报					
管理层和治理层对财务报表 的责任	管理层负责按照企业会计准则均规定输制的多根表、使其实现 公允良、并设计、技术目储产业的均常控制,以使财务报表 不存在由于侧弊或情误导致的重大情况。 在海侧的务报及积,信息现处责评估中海上证6的物效增强 低证券投票基金的转换整定常位。发展与持续经营相关的事项 (如原用,并运用转续经营假设。除非计划进行消算,终止运营 成别无其他现实的选择。					
	與们的目标原列對多限是機体是否不存在由于網際或期間學數 的個土機構成使合理傾應,提出自會审计學成功時計程等。合 環保証是為不卑的保証。但并不確認能按照审计計期對表行的审 计在某一册土物解存在研总能处理。					

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	1,589,020.58	9,246,500.60
结算备付金		86,599.03	29,947.28
存出保证金		14,239.70	14,171.78
交易性金融资产	7.4.7.2	144,526,702.11	136,091,193.02
其中:股票投资		138,390,822.51	136,091,193.02
基金投资		-	-
债券投资		6,135,879.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买人返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	171,262.72	1,733.06
应收股利		-	-
应收申购款		365,018.57	133,994.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	_
资产总计		146,752,842.71	145,517,540.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	_
交易性金融负债		-	_
衍生金融负债	7.4.7.3	-	_
卖出回购金融资产款		-	_
应付证券清算款		-	_
应付赎回款		130,979.17	91,232.75
应付管理人报酬		107,275.40	105,906.17
应付托管费		21,455.08	21,181.21
应付销售服务费		-	_
应付交易费用	7.4.7.7	59,218.29	34,214.18
应交税费		-	_
应付利息		-	_
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	_
其他负债	7.4.7.8	161,983.17	61,971.18
负债合计		480,911.11	314,505.49
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	138,704,592.27	117,501,744.81
未分配利润	7.4.7.10	7,567,339.33	27,701,290.08

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
一、收入		-19,774,653.88	36,505,184.46
1.利息收入		183,693.15	62,609.55
其中:存款利息收入	7.4.7.11	34,123.72	62,487.55
债券利息收入		149,569.43	122.00
资产支持证券利息收入		-	_
买人返售金融资产收入		-	_
其他利息收入		-	_
2.投资收益(损失以"-"填 列)		6,142,718.94	7,980,312.39
其中:股票投资收益	7.4.7.12	2,769,542.03	4,645,159.22
基金投资收益		-	_
债券投资收益	7.4.7.13	-417.69	47,643.84
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	_
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	
衍生工具收益	7.4.7.15	-	_
股利收益	7.4.7.16	3,373,594.60	3,287,509.33
3.公允价值变动收益(损失 以"-"号填列)	7.4.7.17	-26,259,378.76	28,397,752.07
4. 汇兑收益(损失以 "-" 号 填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号 填列)	7.4.7.18	158,312.79	64,510.45
减:二、费用		1,948,859.03	1,953,199.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,160,921.68	1,193,300.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	232,184.44	238,660.06
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	_
4. 交易费用	7.4.7.19	228,350.27	193,074.32
5. 利息支出		-	_
其中: 卖出回购金融资产支 出		-	
6. 税金及附加		-	
7. 其他费用	7.4.7.20	327,402.64	328,164.23
三、利润总额 (亏损总额以 "-"号填列)		-21,723,512.91	34,551,985.25
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-" 号埠列)		-21,723,512.91	34,551,985.25

期初所有者权 27,701,29 145,203,034.8 -21,723,512 -21,723,512 (净值减少以" 号填列) 其中:1.基金申购款 2.基金赎回款 五、期末所有者权益 146,271,93 项目 Z017年12月31日 所有者权益合い 期初所有者权 129,175,928 (基金净值) 二、本期经营活动产 34,551,985.2 34,551,985.2 利润) 、本期基金份額交 (净值减少以"-号填列) 其中:1.基金申购款 2.基金赎回款 五、期末所有者权益 成部分。 及表由下列负责人签署: 宋字 主管会计工作负责人

率,由展先的3%。網接为1%。 经国务院批准。协政部、国家税务总局研究决定。自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交 房印存税标准缴纳印花税,受让万不再征收,税基不受; 房间将税税率。国家营业局等的是2008年103岁至(交产)股权分置试点改准有关税收改第问题的通知1的 规定。股权分强改革更到中限制率通股股票的流通股股东交付的价充发生的股权转让,都全成改印花根。

根则则经常。国家保护企品财情以2005103号文(关于报处分量点点发格有关的改变值问期的调到1的 股产。就处方域在中非电量服务应通过对约方式向面能配股东支付的股份,完全等处,每是他农港国股 股东运搬的价。2017年8月。5日期时间200811号文(关于企业所有超初干化里采物的通1)的形成、对证券投 营基金从基于市场中电路的收入,在48万亩农业,供参约查价收入。股权的股重。12和收入,债券的利息收入 对基金从上等市场中电路的收入,在48万亩农业,债券的查价收入,股权的股重。12和收入,债券的利息收入 74.65 个人所得限 服务。据文并是这一局时程20081103号文(关于股权分量试点支着有关转改改集间则的通划)的 股产。很处分据设计中的电路投资通过对约方式向机能股级充分的股份,完全等收入,但全地收流通股 股票。据文并是实现。12年以为65年以为65年以市场市场股份收入,有6400克加的股份,12年以为65年以下,12年以为65年以下,12年以为65年以下,12年以为65年以下,12年以

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司("中海基金")	基金管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司("中海信托")	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司("国联证券")	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司 ("法国洛希尔银行")	基金管理人的股东
中海恒信资产管理(上海)有限公司("中海恒信")	基金管理人的控股子公司

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018	年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金額	占当期股票 成交总额的 比例	
1联证券	12,849,269.74	7.83%	4,036,534.78	3.23%	

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018	年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金額	占当期债券 成交总额的 比例	
可联证券	180,198.00	2.78%	-	-	
8.1.3 债券回购交 :本基金在本报告	易 朝及上年度可比期间均未	:在关联方交易	B单元进行债券回购交易		

7.48.1.4 权证义例 注: 本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。 7.48.1.5 应支付关联方的佣金 金额单位, 人民而元

关联方名 称	2		本期 至2018年12月31日	
	当期佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余額	占期末应付 佣金总额的 比例
国联证券	11,966.65	8.32%		
关联方名 称	2		E可比期间 至2017年12月31日	
	当期佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余額	占期末应付 佣金总额的 比例
国联证券	3,759.22	3.41%		
的证券结算				
		水期		1 122.7 (1)

项目 当期发生的基金应支付 ... 口生成 其中:支付销售机构的 客户维护费 539,313.77 注:基金管理费按前一日 H=E×0.85%÷当年天数

日-E×105%。当年天教 江沙前日立世报院基金管理费 比沙前一日时接金资产的值 成为6、日的基金资产的值 或游舟、基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付的基金托管人发送基金管理 或游舟、基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付的基金管理人。若遇决定节 24.6代银等。支付日期底延 748.2.2 基金托管费

本期 2018年1月1日至2018年12月 31日 頑目 当期发生的基金应支付的托管费 E:基金托管费按前一日的基金 (=E×0.17% - 当年天数 (为每日应计提的基金托管费 为前一日的基金资产净值 232,184.44 曾费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划 2.托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等、支

這期應近。 7-48.3 与英族方进行银行间同业市场的债券(含同期)交易 注: 水基金本根含期及上年度可比期间均率与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。 7-48.4 名英族产税营水基金的情况。 7-48.4 1 根含期内基金管理人运用国有资金投资水基金的情况。 7-48.4 报告期内基金管理人运用国有资金投资水基金的情况。 7-48.42 根含期末龄基金管理人运产以为企业等企业的转成。 7-48.42 根容期末龄基金管理人之外的其他实践方投资太基金的情况。 注: 水煤铝明末足上年度末联基金管理人之外的其他实践方块是大投资本基金。 7-48.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

中国工商银 行股份伺限 人名 大型份价限 人名 大型份价限 人名 大型份价限 人名 大型份价限 人名 大型份价限 人名 大型份价。 大型份价,本基金的业券交易转算资金通过托管银行备付金银户转存于中国业券 技供公司。2018年度转得的利息收入为人民币1,351.06元(2017年度;人民币68187元),2018년 金条侧为人民币6,5903元(2017年末,人民币29.4723元)。 48.6 本基金在来销期内参与关键方承的课券的情况 大本基金在来的期及上年度可比期间均未在采销期内参与认购关键方承的证券。 48.7 其他之限交易事项的说明 48.7 其他之限交易事项的说明

7.4.10 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券 7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票 (741.1.1) 受険阻滞契別が接端 正券 遊 成功 可落 洗通 从购 期末 数量 期末 期末估值 6491 夕 以购 減口 受限 (公板 估值 (单位: efactors)

	代码	名称	H	通日	类型	价格	单价	股)	成本总额	总额	66 1.1.	
	6018 60	紫金银行	2018 年12 月20	年月	1 新版 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3	3.14	3.14	15,97	0 50,145.8	0 50, 145.80	-	
7	.4.10.2	期末	寺有的1	哲时停	牌等流过	重受限R	} #			金額单	位:人目	民市:
	股票代码	股票名称	停牌 日期	停牌原因	期末 估值单 介	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总額	期末估值总额	备注	
	6000 30	中信证券	2018 年12 月25 日	 田大事项停牌	16.01	2019 年1月 10日	17.15	739, 137	13,325, 472.92	11,833 583.3		
	6004 85	信威集团	2016 年12 月26 日	重大事项停牌	10.03	-	-	70,731	1,075, 494.00	709,431.9	3 -	

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 74.10.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2018年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融 %从环境。 74.10.32 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2018年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融 74.11 有助于理解机分析会计极表需要说明的其他事项 74.141公允价值 74.141公允价值计量的金融工具 74.141、1740公允价值计量的金融工具 金融公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他 金融负债,其限额余期源不长、公允的值与账面价值相括。

本基金於行由的以公元的他計畫自其交叉的扩入三層的無由主 不141名英指等項 截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。 7-4143其他事項 截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。 7-41446样条相志的标准。 7.4.14.4财务报表的批准 本财务报表已于2019年3月26日经本基金的基金管理人批准。

81 期末基金资产组合情况

股票 代码	项目	金额	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	138,390,822.51	94.30
	其中:股票	138,390,822.51	94.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,135,879.60	4.18
	其中:债券	6,135,879.60	4.18
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,675,619.61	1.14
8	其他各项资产	550,520.99	0.38
9	合计	146,752,842.71	100.00

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	_
В	采矿业	10,379,809.00	7.10
C	制造业	25,787,202.22	17.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	-	-
Ε	建筑业	5,807,761.37	3.97
F	批发和零售业	-	_
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服 务业	1,128,094.00	0.77
J	金融业	91,444,989.62	62.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	_
M	科学研究和技术服务业	-	-
Ν	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	-
Ω	卫生和社会工作	-	_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	-	_
	合计	134,547,856.21	91.98

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	-	-
C	制造业	816,155.64	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	-	-
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服 务业		-
J	金融业	3,026,810.66	2.07
K	房地产业	-	-
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	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	-
Ω	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,842,966.30	2.63

股票代码 股票名称

阅读登载于管理人网 序号 股票代码 股票名称 公允价值 上机数控 紫金银行

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产 净值比例(%)
1	601318	中国平安	11,270,971.60	7.76
2	600036	招商银行	11,179,077.00	7.70
3	600030	中信证券	10,091,673.10	6.95
4	601688	华泰证券	6,155,888.00	4.24
5	601328	交通银行	4,581,423.00	3.16
6	600276	恒瑞医药	4,568,261.35	3.15
7	601857	中国石油	3,258,734.00	2.24
8	600028	中国石化	2,619,589.00	1.80
9	600519	贵州茅台	2,569,497.00	1.77
10	600547	山东黄金	2,506,631.88	1.73
11	601229	上海银行	2,007,188.20	1.38
12	601288	农业银行	1,962,593.00	1.35
13	600309	万华化学	1,887,719.00	1.30
14	601166	兴业银行	1,860,482.00	1.28
15	600016	民生银行	1,708,113.00	1.18
16	600585	海螺水泥	1,680,355.12	1.16
17	601988	中国银行	1,670,873.00	1.15
18	600690	青岛海尔	1,649,296.00	1.14
19	600000	浦发银行	1.629.695.00	1.12

易费用。 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

字号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期创基金资产 净值比例(%)
1	601318	中国平安	6,617,239.00	4.56
2	600016	民生银行	6,460,895.84	4.45
3	600048	保利地产	3,484,851.21	2.40
4	600036	招商银行	2,949,814.00	2.03
5	600837	海通证券	2,785,913.20	1.92
6	600519	贵州茅台	2,703,908.00	1.86
7	601328	交通银行	2,580,496.00	1.78
8	600518	康美药业	2,461,032.87	1.69
9	601166	兴业银行	1,705,121.00	1.17
10	601006	大秦铁路	1,699,814.00	1.17
11	601288	农业银行	1,601,512.00	1.10
12	600887	伊利股份	1,557,757.00	1.07
13	600919	江苏银行	1,535,837.56	1.06
14	601989	中国重工	1,526,086.80	1.05
15	601088	中国神华	1,456,642.00	1.00
16	601360	三六零	1,430,756.00	0.99
17	601988	中国银行	1,288,595.00	0.89
18	600030	中信证券	1,285,869.00	0.89
19	600000	浦发银行	1,149,130.00	0.79
20	601668	中国建筑	1,051,566.00	0.72

zm。 84.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 买人股票成本(成交)总额

金额单位:人民币元

2 央行票据 10 合计 6,135,879.60 8.6 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约

2.102本版白期末未持有限指開货合约。 8.102本基金经費股捐辦實的投資或與 機關基金合同級定、基金令等。與指開實交易。 8.11 报告期本基金投資的無機則實交影時份說明 4.11本期间的實度發改質 4.12 提自計畫本基金投的問題問題的存在期益明 注:本基金本提自用本基金经的問題問題持令在期益明細 注:基金本报自用本基金经的問題問題持令在期益明細 2.13 本期间確如實度對

注:本基金水股告期末未转有国旗附股合约。
3.11.3 本阴量的照效,是基金不参与国德明货交易。
3.12 化物值与程告报告。
3.12 化物值与程告报告。
3.12 化物值与程告报告。
3.12 化物值与程告报告。
3.12 化物值与程告报告。
3.12 化物值与程告报告。
3.12 化物值与报告报告。
3.12 化原位与报告报告,但成者理理一起。中枢内型的从外域,一定地报出报告让日本人为借款股份。
3.12 化成分电影器,一定地报出来一个现代的工程,一个现代的工程。
3.12 化成分电影器,一个现代的工程。
3.12 化成分电影器。
3.12 化成分电影器

到特殊行动。如果是一种企业的企业的企业的企业。

到限信息公司的企业的企业的企业。

"规则实有,及放信用资源等加速,如果大家交易未在规定审查排出。未得整理。则是有,二单其实 光创银行为2004万元。

"从创银行为2004万元。

"从创银行为2004万元。

"从创银行为2004万元。

"从创银行为2004万元。

"从创银行为2004万元。

"从创银行为2004万元。

"从创银行的企业。

"从创银行为2004万元。

"从创银行的企业。

"从创银行为企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行动的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行的企业。

"从创银行动的企业。

"从创金、
"

序号	名称	单位:人
1	存出保证金	14,239.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	171,262.72
5	应收申购款	365,018.57
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
0	tzak	

股票名称 液涌尋閱情况说明 金额单位:人民

流通受限部分的公允价 值 股票名称 流通受限情况说明 **重大事项停** § 9 基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

12,074.2 0.00879 3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间

1.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称 备注 成交金額 佣金 比例 长江证券 19.82% 30,294.32 21.079 光大证券 16.97% 25.930.59 18.03 申万宏源 7.35% 11,225.44 国泰君安 函藏东方则 4.49% 5,389.40 3.759 富证差 6,141.80 国信证券 4.02% 华泰证券 3.17% 4.836.80 海通证券 东方证券 1,123.0

注2:本报告期内本基金新增了东方证券的深圳交易单元。退租了安信证券的上海交易单元,和齐鲁证券

的深圳区島单元。 由3:上述佣金使用场佣金属计算,已和除由中国证券登记結算有限责任公司收取、并由券育承租的证券 结算风险基金后的停服列示。 在4 由于四台百入的期限,分项之和与合计项之间可能存在规范。 11.22 基金用证券公司收支制中立进行其他证券投资的情况。

成交金額 或交金额 成交金額