

信息披露

Disclosure

(上接B069版)
办公地址：安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10—11层
(总部)
法定代表人:朱中文
联系人:梁晋
联系电话:0651-62870125
传真:0651-62870131
客服电话:400 626 9988
公司网址:htp://www.aiqib.com/
(98)上海聚泰基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号808层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
联系电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.52icban.com
(99)北京钱景基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街18号10层
办公地址:北京市海淀区中关村大街18号10层
法定代表人:陈东春
联系人:陈剑伟
联系电话:010-57418813
客服电话:400-893-6885
公司网址:www.qianjin.com
(91)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路101号
办公地址:北京市朝阳区东三环北路101号
法定代表人:闫振杰
电话:010-59601366
传真:010-62020355
联系人:崔文
客户服务电话:4008189000
公司网址:www.zhenhengl.com
(92)深圳前海微众银行股份有限公司
住所:深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
法定代表人:秦伟
电话:0755-2930513
传真:0755-26920530
联系人:阿珂
客户服务电话:400-930-0660
公司网址:www.ifzinv.com
(93)北京广源信基金销售有限公司
住所:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京花园4区13号楼润项中心B座19层
法定代表人:李剑峰
电话:4006236000
传真:010-82054898
联系人:王英
客户服务电话:400-623-6060
公司网址:www.niuniumifund.com
(94)上海中汇汇通基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙漕路2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙漕路2815号302室
法定代表人:黄欣
电话:021-33768132
传真:021-33768132-802
联系人:戴晓薇
客户服务电话:4006767523
公司网址:www.zhongzhengfund.com
(95)乾道盈泰基金销售有限公司(北京)有限公司
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
住所:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人:王兴吉
联系人:高雪超
联系电话:18801207732
电话:010-52067741
客服电话:4000898900
公司网址:www.qiandaoj.com
(96)深圳前海微众银行股份有限公司
住所:深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
法定代表人:秦敬
电话:0755-89462447
传真:0755-96700688
联系人:罗敏
客户服务电话:400-998-8877
公司网址:www.webank.com
(97)上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路618号A1002室
法定代表人:王翔
联系人:高杰
电话:021-65370077-220
传真:021-65085991
客户服务电话:021-65370077
网站:www.jiayufund.com
(98)北京鹏鼎基金销售有限公司
住所:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
办公地址:北京市朝阳区四惠东惠通惠群产业园1111号
法定代表人:许现良
电话:010-57649619
传真:010-57649620
联系人:朱翔宇
客户服务电话:010-57649619
公司网址:www.janmao.com
(99)一路财富(北京)信息科技有限公司
住所:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴海勇
电话:+8610188312877
传真:+8610188312877
联系人:徐慧
客户服务电话:400-011-1566
公司网址:htp://www.yilucaifu.com/
(100)南京苏宁基金销售有限公司
住所: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
法定代表人:王峰
电话:025-66966699-887226
传真:025-66908800-887226
联系人:张慧
客户服务电话:95177
公司网址:www.snjinfund.com
(101)北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
电话:010-61940688
传真:010-61940699
联系人:吴季林
客户服务电话:4000618518
公司网址:https://danjuanapp.com
(102)上海东谷基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
法定代表人:袁飞
电话:61621602
传真:61621602*819
联系人:袁振豪
客户服务电话:61621602
公司网址:www.g-fund.com.cn
(103)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
法定代表人:王伟刚
电话:010-56251471
传真:010-6280827
联系人:熊小娟
客户服务电话:400-619-9069
公司网址:www.hcjjin.com
(104)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法定代表人:高彬生
电话:0592-3122572
传真:0592-3122270
联系人:梁云波
客户服务电话:400-9180808
公司网址:www.xds.com.cn
(105)北京新浪乐石基金销售有限公司
住所:北京市海淀区北四环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5层518室
办公地址:北京市海淀区北四环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5层518室
法定代表人:李昭熙
电话:010-62676406
传真:8610-62675979
联系人:付文红
客户服务电话:010-62675369
公司网址:www.xinacoin.com
(106)天津国美基金销售有限公司
住所:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公D座2层
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦D座19层
法定代表人:丁东华
电话:010-59287984
传真:010-59287825
联系人:郭玉亮
客服电话:400-111-0889
公司网址:www.gomefund.com
(107)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:北京市朝阳区望月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:程刚
电话:010-58160168
传真:010-58160173
联系人:蔡阳
客户服务电话:400-810-6919
公司网址:www.fengd.com
(108)上海云湾基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区金桥路27号13号楼2层
办公地址:上海市浦东新区锦康路308号6号楼4楼
法定代表人:戴新装
电话:021-20638888
传真:021-20638999
联系人:王婧
客服电话:400-820-1515
公司网址:www.zhengtongfunds.com

(109)南京途牛基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区玄武大道689-1号
办公地址:南京市玄武区玄武大道689-1号
法定代表人:宋时琳
联系人:张士卿
联系电话:025-86853969
客服电话:4007-999-999
公司网址:http://tuniu.com
(110)上海得基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
联系电话:021-51327185
传真:021-50710161
客服电话:400-821-0203
公司网址:www.520fund.com.cn
(111)杭州利瑞瑞基金销售有限公司
住所:杭州市下城区武林时代商务中心1804室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人:陈丽
联系人:张丽霞
联系电话:0571-85262700
传真:0571-85269200
客服电话:0571-86915761
公司网址:www.ch121.com
(112)北京恒信基金销售有限公司
住所:北京市密云区兴盛南路8号院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:杨晓峰
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
传真:010-67767615
客服电话:400-680-2123
网站:www.zhixin.cn
(113)北京利瑞基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座
法定代表人:江卉
联系人:赵德赛
电话:4000988511/4000888616
传真:010-89188000
客服电话:95118
网站:htp://fund.jd.com/
(114)上海明永基金销售有限公司
住所:浦东新区上南路977号1幢B座812室
办公地址:上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法定代表人:廖冰
联系人:郑秋月
联系电话:021-80234898
传真:021-80234898
客服电话:4006991888
公司网址:www.999fund.com
(115)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所: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
联系人:徐英
电话:010-59336539
传真:010-59336099
客服电话:4008-909-998
(116)上海夏财财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路87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8层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋明
电话:010-88066632
传真:010-63136194
客服电话:400-817-5666
网站:www.amcfortune.com
(117)武汉市利嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
法定代表人:陶建
联系人:陆峰
客户服务电话:4000279899
公司网址:www.buyifund.cn
(118)和耕传承基金销售有限公司
住所:郑州市郑东新区东风南路东经三路互联网金融大厦六层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路东经三路互联网金融大厦六层
法定代表人:马海龙
联系人:申倩倩
客户服务电话:4008787077
公司网址:www.hsqh.net
(120)北京微众利基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人:李长军
联系人:何鹏
客户服务电话:400-819-6665
公司网址:www.buyiforyou.com.cn
(121)成都华羿恒信基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
办公地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
法定代表人:赵壁
联系人:徐利
客户服务电话:400-8010-009
公司网址:htp://www.huayihengxin.com
(122)上海财投基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02_03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02_03室
法定代表人:冷飞
联系人:李娟
联系电话:021-50810687
客服电话:021-50810673
公司网址:www.wacaijin.com
(123)上海大智慧基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元2号
法定代表人:申健
联系人:宋楠
联系电话:021-20219988
客服电话:021-20929201
网站:https://www.wq.com.cn/
(124)北京和信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公店大街4号5号楼一层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲9号文化创新工场四层204
法定代表人:刘勇
联系人:刘鹏
电话:010-58170905/010-58170876
传真:010-58100800
客户服务电话:400-818-8866
网站:www.shengshifund.com.cn
(126)北京上信基金销售有限公司
住所: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
联系人:曹煜辰
客户服务电话:400-066-8586
网站:www.igofund.com
(127)北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
客户服务电话:400-100-3391
公司网址:htp://www.dianyingfund.com/
(128)万家财富基金销售有限公司(天津)有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市丰台区丰盛国际28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修峰
联系人:邵玉磊
客户服务电话:010-59013925
公司网址:htp://www.wanjiawalth.com/
(129)深圳前海财厚基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层
法定代表人:刘明军
联系人:潘广峰
电话:09017(拨通后转1再转8)
网站:www.tianhuafund.com
(131)西藏东方财富证券股份有限公司
住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10号楼
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
法定代表人:陈宏
联系人:付佳
联系电话:021-23686603
客服电话:95357
公司网址:htp://www.18.cn
基金管理人可根据《有关法律、法规的要求,选择其他符合条件的机

构代理销售本基金,并及时公告。
(三)注册登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号2906-2908室及30层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2906-2908室及30层
法定代表人:杨皓鹏
总经理:杨皓鹏
成立日期:2004年3月18日
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
电话:021-39429808
传真:021-69413328
联系人:周琳
(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:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
法定代表人:韩炯
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:秦悦民、王利民
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:毛敏宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58153000
联系人:徐海
经办会计师:徐海、陶育华
四、基金的名称
五、基金的类型
股票型证券投资基金
六、基金的投资目标
本基金为股票指数增强型基金,在被动跟踪标的指数的基础上,加大主动选股力度,力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,跟踪误差不得超过1.75%。在控制基金净值跟踪误差的前提下力争取得高于业绩基准的稳定收益,追求长期的资本增值。
七、基金的投资范围
本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括上证50指数成份股及其备选成份股、新股、债券、以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种(如股指期货等),基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。
八、基金的投资理念
采用增强型指数化投资策略,以跟踪上证50指数为主,辅以适度增强的投资策略以追求对标的指数的适当超越,使投资者充分分享中国经济增长所带来的良好收益。
(1)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所: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
联系人:徐英
电话:010-59336539
传真:010-59336099
客服电话:4008-909-998
(116)上海夏财财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路87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8层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋明
电话:010-88066632
传真:010-63136194
客服电话:400-817-5666
网站:www.amcfortune.com
(117)武汉市利嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
法定代表人:陶建
联系人:陆峰
客户服务电话:4000279899
公司网址:www.buyifund.cn
(118)和耕传承基金销售有限公司
住所:郑州市郑东新区东风南路东经三路互联网金融大厦六层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路东经三路互联网金融大厦六层
法定代表人:马海龙
联系人:申倩倩
客户服务电话:4008787077
公司网址:www.hsqh.net
(120)北京微众利基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人:李长军
联系人:何鹏
客户服务电话:400-819-6665
公司网址:www.buyiforyou.com.cn
(121)成都华羿恒信基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
办公地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
法定代表人:赵壁
联系人:徐利
客户服务电话:400-8010-009
公司网址:htp://www.huayihengxin.com
(122)上海财投基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02_03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02_03室
法定代表人:冷飞
联系人:李娟
联系电话:021-50810687
客服电话:021-50810673
公司网址:www.wacaijin.com
(123)上海大智慧基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元2号
法定代表人:申健
联系人:宋楠
联系电话:021-20219988
客服电话:021-20929201
网站:https://www.wq.com.cn/
(124)北京和信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公店大街4号5号楼一层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲9号文化创新工场四层204
法定代表人:刘勇
联系人:刘鹏
电话:010-58170905/010-58170876
传真:010-58100800
客户服务电话:400-818-8866
网站:www.shengshifund.com.cn
(126)北京上信基金销售有限公司
住所: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
联系人:曹煜辰
客户服务电话:400-066-8586
网站:www.igofund.com
(127)北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
客户服务电话:400-100-3391
公司网址:htp://www.dianyingfund.com/
(128)万家财富基金销售有限公司(天津)有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市丰台区丰盛国际28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修峰
联系人:邵玉磊
客户服务电话:010-59013925
公司网址:htp://www.wanjiawalth.com/
(129)深圳前海财厚基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层
法定代表人:刘明军
联系人:潘广峰
电话:09017(拨通后转1再转8)
网站:www.tianhuafund.com
(131)西藏东方财富证券股份有限公司
住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10号楼
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
法定代表人:陈宏
联系人:付佳
联系电话:021-23686603
客服电话:95357
公司网址:htp://www.18.cn
基金管理人可根据《有关法律、法规的要求,选择其他符合条件的机

基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外因素导致基金净值不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。
(11)本基金与私募证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(12)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。
(13)相关法律法规及监管部门规定的其它投资限制。
《基金法》及其他相关法律法规或监管部门其它上述限制的,履行适当程序后,基金投资不受上述限制。
除上述第(6)、(10)、(11)项另有规定外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
2、为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金资产,但法律法规另有规定的除外。
(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。
(8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的行为。
若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述限制。
十二、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:
一年期银行定期存款利率(税后)×5%。
如果基金所跟踪的标的指数被中国证监会指定为上市公司停止发布,或由其他指数替代,或由指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数,或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的跟踪目标和投资对象,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。
十三、基金的风险收益特征
本基金属股票指数增强型证券投资基金,为证券投资基金中的较高风险较高预期收益品种。
十四、基金投资组合报告
基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金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。
本投资组合报告所载数据截至2018年12月31日报告期末的四季度报告数据,其中所列财务数据未经审计。
截至2018年12月31日,中海上证50指数增强型证券投资基金资产净值为146,271,931.60元,基金份额净值为1.065元,累计基金份额净值为1.065元。其资产净值情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	138,380,822.51	94.30
	其中:股票	138,380,822.51	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
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生产品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,675,613.61	1.14
8	其他资产	150,520.99	0.38
9	合计	146,271,932.11	100.00

2、期末按行业分类的股票投资组合
(1)指数投资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	-	-
B	采矿业	10,379,809.00	7.10
C	制造业	25,787,202.22	17.63
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	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	-	-
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	-	-
S	综合	134,547,886.21	91.98

(2)积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	816,156.64	0.56
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	3,842,966.30	2.63

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	372,101	20,874,896.10	14.27
2	600036	招商银行	588,287	14,320,832.40	9.79
3	600030	中信证券	739,137	11,833,593.37	8.09
4	600619	贵州茅台	13,626	8,038,886.25	5.50
5	601228	交通银行	1,302,166	7,539,541.14	5.15
6	601688	华泰证券	433,187	7,017,029.40	4.81
7	601166	兴业银行	356,001	5,215,966.94	3.63
8	601288	农业银行	1,469,891	5,201,667.80	3.62
9	601887	中国中铁	541,400	3,303,494.00	2.27
10	600887	中国神华	182,902	3,264,422.00	2.24

(2)期末积极投资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

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	600999	招商证券	163,317	2,188,447.80	1.50
2	600968	东方证券	98,886	788,217.06	0.54
3	600485	中国神华	70,731	709,431.93	0.49
4	603105	上机数控	1,346	66,039.50	0.06
5	601880	紫金矿业	15,970	50,146.80	0.03

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,135,879.60	4.19
其中:政策性金融债	6,135,879.60	4.19	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,135,879.60	4.19

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

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011806	国开1701	61,000	6,135,879.60	4.19

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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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
本基金本报告期末未持有贵金属。
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
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
(2)本基金股指期货投资的投资政策
根据基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。
根据基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。
(1)本期国债期货投资政策
根据基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。
(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
(3)本期国债期货投资评价
根据基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。
11、投资组合报告附注
(1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
(2)报告期内本基金投资的前十名股票中不存在在基金合同规定备选股票库之外的股票。
(3)截至2018年12月31日,本基金的其他各项资产构成如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,238.70
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	385,018.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	550,520.99

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(6) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的