

(上接B216版)  
7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末,本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末,本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项  
截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。  
2. 其他事项  
(1) 公允价值  
本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的金额为人民币224,079,266.12元,划分为第二层次的金额为人民币3,840,956,21元,划分为第三层次的余额。(于2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币41,595,119.04元,划分为第二层次的余额为人民币3,047,947.89元,无划分为第三层次的余额。)

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层;并根据估值调整中所采用的输入值的可观察性和重要性,确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券,若出现交易不活跃的情况,本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层;根据估值调整中所采用的输入值的可观察性和重要性,确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金在报告期末未持有公允价值划分为第三层次的金融工具;本基金期间无转入(转出)第三层次。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	227,920,222.33	91.43
其中:股票		227,920,222.33	91.43
2 债券投资		-	-
其中:债券		-	-
货币支持证券		-	-
4 贵金属投资		-	-
5 金融衍生品投资		-	-
6 买入返售金融资产		-	-
其中:质押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	21,327,751.20	8.56	
8 其他各项资产	49,346.24	0.02	
9 合计	249,297,319.77	100.00	

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业		-	-
B 矿业	8,099,521.00	3.27	
C 制造业	124,370,704.40	50.16	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,187,675.20	1.69	
E 建筑业	4,791,166.00	1.93	
F 批发和零售业	8,984,568.00	3.62	
G 交通运输、仓储和邮政业	9,369,269.44	3.78	
H 餐饮和住宿业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	7,423,896.53	2.99	
J 金融业	33,117,286.00	13.36	
K 制造业	12,353,363.80	4.98	
L 租赁和商务服务业	7,978,571.26	3.22	
M 科学研究、技术服务及专业服务业	-	-	
N 水利、环境和公共设施管理业	2,328,878.20	0.94	
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	
P 教育	-	-	
Q 卫生和社会工作	4,256,560.00	1.72	
R 文化、体育和娱乐业	658,762.00	0.027	
S 综合	-	-	
合计	227,920,222.33	91.91	

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	14,500	10,113,605.00
2	601318	中国平安	98,900	6,922,022.00
3	601006	中国太保	733,000	6,648,310.00
4	000338	格力电器	791,700	6,602,778.00
5	601328	建设银行	849,500	5,275,395.00
6	000415	招商银行	915,200	5,271,552.00
7	000333	美的集团	81,800	4,534,174.00
8	601288	农业银行	1,158,900	4,438,587.00
9	600572	康师傅	619,100	4,377,037.00
10	300015	爱尔眼科	138,200	4,256,660.00

注:投资者欲了解本基金报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读披露于基金管

理人网站的年度报告全文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,596,242.92	22.94
2	000338	格力电器	9,016,482.43	17.83
3	000415	招商银行	7,713,822.94	15.26
4	601318	中国平安	7,461,933.82	14.76
5	000725	中国太保	7,460,209.00	14.76
6	601288	农业银行	7,206,414.00	14.25
7	601006	大秦铁路	7,169,398.12	14.18
8	601328	建设银行	6,723,036.70	13.30
9	002146	欧亚集团	6,456,958.24	12.77
10	002424	苏宁易购	6,360,269.40	12.58
11	600566	浦发银行	6,268,510.70	12.40
12	000776	广发证券	6,018,350.00	11.90
13	600015	华泰证券	6,012,128.65	11.89
14	600312	国泰君安	5,930,749.62	11.84
15	000800	一汽轿车	5,540,560.00	10.98
16	600663	陆家嘴	5,271,347.40	10.26
17	000816	安信信托	5,165,300.00	10.22
18	600616	国元证券	5,165,244.00	10.22
19	600900	万向德农	5,144,574.00	10.17
20	000651	中国医药	4,793,153.98	9.48
21	000507	紫金矿业	4,726,941.80	9.35
22	000572	康恩贝	4,633,743.12	9.17
23	000418	跨境通	4,534,174.00	8.93
24	600426	招商银行	4,516,531.00	8.89
25	601318	中国平安	4,510,161.92	8.87
26	600383	金地集团	4,502,550.00	8.86
27	000325	华安证券	4,500,000.00	8.85
28	000254	美的集团	4,496,560.00	8.84
29	000572	康恩贝	4,494,574.00	8.83
30	000572	康恩贝	4,494,574.00	8.83
31	600153	建发股份	4,274,511.00	8.45
32	000418	跨境通	4,240,451.00	8.43
33	000338	格力电器	4,230,000.00	8.42
34	600005	万向德农	4,220,000.00	8.41
35	000572	康恩贝	4,210,000.00	8.40
36	000572	康恩贝	4,210,000.00	8.40
37	000572	康恩贝	4,210,000.00	8.40
38	000572	康恩贝	4,210,000.00	8.40
39	000572	康恩贝	4,210,000.00	8.40
40	000383	金地集团	4,200,000.00	8.39
41	000572	康恩贝	4,200,000.00	8.39
42	000572	康恩贝	4,200,000.00	8.39
43	000572	康恩贝	4,200,000.00	8.39
44	601601	中国太保	4,192,437.82	7.76
45	600010	包钢股份	3,859,405.00	7.63
46	601919	中远海能	3,842,603.82	7.60
47	600565	通达动力	3,834,527.00	7.58
48	600808	马钢股份	3,825,968.00	7.58
49	300015	爱尔眼科	3,750,928.86	7.42
50	300357	我武生物	3,734,547.18	7.39
51	601997	招商银行	3,731,003.00	7.38
52	600883	老百姓	3,721,559.00</	