

(上接B218版)

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、其他应收款项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次的余额为人民币5,945,708,689.94元，划分为第二层次的余额为人民币283,850,592.49元，无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639,667,366.13元，划分为第二层次的余额为人民币5,530,952.62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间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用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。

第三次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金期初无转入(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。

S 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	权证投资	6,229,559,282.43	88.91
	其中：股票	6,229,559,282.43	88.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
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：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	608,951,426.26	8.69
8	其他各项资产	168,096,352.78	2.40
9	合计	7,006,607,061.47	100.00

8.2 不按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	采矿业	250,194,614.89	3.80
C	制造业	2,679,508,056.06	40.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	110,111,016.24	1.67
E	建筑业	249,043,275.86	3.78
F	批发和零售业	107,043,971.68	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	182,623,110.92	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,542,974.72	1.37
J	金融业	1,921,109,983.47	29.17
K	房地产业	306,576,422.55	4.66
L	租赁和商务服务业	275,252,459.34	4.18
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	56,755,886.76	0.86
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,228,761,722.19	94.59

8.2.2 期末积极投资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	采矿业	250,194,614.89	3.80
C	制造业	2,679,508,056.06	40.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	110,111,016.24	1.67
E	建筑业	249,043,275.86	3.78
F	批发和零售业	107,043,971.68	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	182,623,110.92	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,542,974.72	1.37
J	金融业	1,921,109,983.47	29.17
K	房地产业	306,576,422.55	4.66
L	租赁和商务服务业	275,252,459.34	4.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
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	-	-
	合计	797,560.24	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通证券投资组合

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

8.3.1 期末指数组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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	6,920,492	484,296,030.16	7.35
2	600519	贵州茅台	534,660	372,920,003.40	5.66
3	000333	美的集团	4,871,123	270,006,347.89	4.10
4	601328	交通银行	39,989,002	248,331,702.42	3.77
5	601601	中国太保	5,408,400	227,322,859.36	3.45
6	601939	建设银行	24,688,321	191,219,105.28	2.90
7	000338	潍柴动力	22,434,405	187,102,937.70	2.84
8	601988	中国银行	45,577,900	180,944,263.00	2.75
9	601009	南京银行	22,764,200	176,194,908.00	2.68
10	601628	中国人寿	5,692,461	173,335,437.45	2.63

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 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十名股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002916	深南电路	3,068	267,621.84	0.00
2	002920	德赛西威	4,569	175,784.97	0.00
3	300735	光环新网	3,764	154,639.96	0.00
4	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
5	300730	科锐智能	281	33,603.53	0.00
6	300664	鹏鼎环境	3,640	32,323.20	0.00
7	300731	科创新源	808	30,914.08	0.00
8	002919	名臣健康	821	29,301.49	0.00
9	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
10	603161	科华控股	1,291	20,753.25	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

金额单位：人民币元

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

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

金额单位：人民币元

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

8.4.4 卖出金额为成交金额(成交量乘以成交数量)，未考虑相关交易费用。

8.4.5 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的明细

金额单位：人民币元

8.4.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券的明细

金额单位：人民币元

8.4.7 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的明细

金额单位：人民币元

8.4.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证的明细

金额单位：人民币元

8.4.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属的明细

金额单位：人民币元

8.4.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险的明细

金额单位：人民币元

8.4.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金的明细