

(上接 B218 版)

7.4.10 有助于理解和分析公司不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层次的余额为人民币 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归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次;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。

第三层次公允价值近期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;本基金本期无净转入(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	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	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
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 期末按行业分类的股票投资组合

		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	2,679,508,005.86	40.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	111,110,016.24	1.67
E	建筑业	249,043,275.86	3.78
F	批发和零售业	107,043,977.88	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	182,623,110.92	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,542,974.2	1.37
J	金融业	1,921,109,980.47	29.17
K	房地产业	306,576,422.25	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	2,679,508,005.86	40.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	111,110,016.24	1.67
E	建筑业	249,043,275.86	3.78
F	批发和零售业	107,043,977.88	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	182,623,110.92	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,542,974.2	1.37
J	金融业	1,921,109,980.47	29.17
K	房地产业	306,576,422.25	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	-	-
C	制造业	697,532.37	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,603.53	0.00
J	金融业	-	-
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	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

8.3.1 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

投资组合明细			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	占基金资产净值的比例（%）
1	601318	中国平安	6,920,492	484,296,030.16	7.35
2	600519	贵州茅台	534,660	372,920,030.40	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	5,488,408	227,329,859.36	3.45
6	601939	建设银行	24,898,321	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明细

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	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.00
2	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.00
3	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
4	002915	中微器材	1,085	38,181.15	0.00
5	300730	科信信息	821	33,603.53	0.00
6	300664	鼎湖新材	3,640	32,323.20	0.00
7	300731	奇信股份	809	30,914.06	0.00
8	002919	名臣健康	821	29,301.48	0.00
9	002922	伊戈尔	1,245	22,347.15	0.00
10	603161	科华控股	1,239	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

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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002916	深南电路	3,068	287,621.64	0.00
2	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.00
3	300735	光弘科技	3,748	54,163.96	0.00
4	002915	中微器材	1,085	38,181.15	0.00
5	300730	科信信息	821	33,603.53	0.00
6	300664	鼎湖新材	3,640	32,323.20	0.00
7	300731	奇信股份	809	30,914.06	0.00
8	002919	名臣健康	821	29,301.48	0.00
9	002922	伊戈尔	1,245	22,347.15	0.00
10	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00

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	601318	中国平安	487,210,169.58	71.41
2	600519	贵州茅台	413,802,561.92	60.65
3	601328	交通银行	318,484,334.16	46.68
4	000333	美的集团	284,038,906.63	41.63
5	601939	建设银行	284,026,738.41	41.63
6	601601	中国太保	252,296,316.64	36.98
7	601009	南京银行	248,981,580.83	36.50
8	000338	潍柴动力	242,729,414.55	35.58
9	000651	格力电器	239,641,685.38	35.13
10	000415	渤海金控	238,512,722.31	34.96
11	601628	中国人寿	238,453,902.05	34.95
12	601186	中国铁建	234,082,415.01	34.31
13	601398	工商银行	232,761,128.57	34.12
14	600383	金地集团	231,293,675.61	33.90
15	000725	京东方 A	225,650,274.43	33.08
16	601818	光大银行	212,069,525.56	31.08
17	600036	招商证券	202,220,867.82	29.64
18	601988	中国神华	199,643,470.70	29.26
19	600309	万华化学	195,234,150.88	28.63
20	601899	紫金矿业	192,716,528.81	28.25
21	601006	大秦铁路	190,958,642.60	27.98
22	000959	首钢股份	179,225,029.25	26.27
23	002146	荣成发展	178,468,028.16	26.16
24	601390	中国中铁	177,467,107.86	26.01
25	000425	徐工机械	173,963,515.44	25.50
26	600188	兖州煤业	169,433,389.38	24.84
27	601997	招商证券	167,346,174.90	24.53
28	600010	包钢股份	162,148,982.34	23.77
29	601169	北京银行	159,612,898.46	23.40
30	601877	正海磁材	148,391,567.10	21.75
31	002195	二三四五	144,932,880.47	21.24
32	600900	长江电力	142,033,622.92	20.82
33	601669	中国电建	136,041,748.83	19.94
34	000800	一汽轿车	135,000,110.02	19.54
35	600741	华鲁汽车	132,163,448.64	19.37
36	600332	白云山	131,414,486.16	19.26
37	600585	海螺水泥	126,494,434.60	18.54
38	600061	国投证券	119,252,567.59	17.48
39	600986	中国神华	115,262,060.16	16.89
40	601028	杭州银行	114,239,256.05	16.75
41	600183	生益科技	113,282,621.85	16.60
42	000413	东旭光电	108,720,313.36	15.94
43	600958	东方证券	107,171,190.48	15.71
44	600009	上海机场	106,531,198.31	15.62
45	000709	河钢股份	106,231,006.34	15.57
46	600703	三七互娱	106,579,616.62	15.57
47	601225	陕西煤业	104,785,272.48	15.36
48	600406	国电南瑞	101,893,476.99	14.94
49	601231	环旭电子	96,522,673.19	14.44
50	600816	安信信托	97,858,165.08	14.34
51	002142	宁波银行	97,656,070.64	14.31
52	600690	青岛海尔	96,819,224.90	14.19
53	600887	伊府股份	96,650,625.57	14.17
54	002310	东方园林	93,071,415.03	13.73
55	600402	金鹰网	93,435,459.01	13.73
56	002315	鼎点科技	83,543,319.81	12.25
57	600297	广弘济世	82,313,327.47	12.07
58	600704	物产中大	79,776,639.70	11.68
59	300357	民士达	79,619,915.22	11.67
60	600566	济川药业	78,848,192.98	11.56
61	002448	中顺内配	75,888,198.23	11.12
62	600325	华发股份	74,759,237.14	10.96
63	603025	大豪科技	74,072,166.09	10.86
64	600663	陆家嘴	73,155,068.17	10.72
65	002174	游族网络	71,579,058.34	10.49
66	600015	华夏银行	66,748,279.87	9.78
67	600018	上海集团	66,348,732.61	9.73
68	600409	三友化工	64,788,094.21	9.49
69	601919	中国铝业	64,578,889.75	9.44
70	600153	建发股份	64,342,182.29	9.43
71	000488	鲁西药业	62,941,030.83	9.22
72	600012	招商局港口	62,848,192.98	9.22
73	600011	华能国际	62,848,192.98	9.22
74	600019	宝钢股份	62,848,192.98	9.22
75	600016	民生银行	62,848,192.98	9.22
76	600017	招商局港口	62,848,192.98	9.22
77	600018	上海集团	66,348,732.61	9.73
78	600019	宝钢股份	62,848,192.98	9.22
79	600020	安泰集团	62,848,192.98	9.22
80	600021	上海石化	62,848,192.98	9.22
81	600022	招商局港口	62,848,192.98	9.22
82	600023	上海石化	62,848,192.98	9.22
83	600024	招商局港口	62,848,192.98	9.22
84	600025	上海石化	62,848,192.98	9.22
85	600026	招商局港口	62,848,192.98	9.22
86	600027	上海石化	62,848,192.98	9.22
87	600028	招商局港口	62,848,192.98	9.22
88	600029	上海石化	62,848,192.98	9.22
89	600030	招商局港口	62,848,192.98	9.22
90	600031	上海石化	62,848,192.98	9.22
91	600032	招商局港口	62,848,192.98	9.22
92	600033	上海石化	62,848,192.98	9.22
93	600034	招商局港口	62,848,192.98	9.22
94	600035	上海石化	62,848,192.98	9.22
95	600036	招商局港口	62,848,192.98	9.22
96	600037	上海石化	62,848,192.98	9.22
97	600038	招商局港口	62,848,192.98	9.22
98	600039	上海石化	62,848,192.98	9.22
99	600040	招商局港口	62,848,192.98	9.22
100	600041	上海石化	62,848,192.98	9.22