

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票;
2、买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601089	中国神华	129,341,648.24	8.56
2	601088	中国铁建	123,006,330.62	8.21
3	600006	武钢股份	120,519,003.40	8.04
4	600019	宝钢股份	118,569,832.73	8.19
5	002276	万丰股份	100,467,184.34	7.83
6	600565	上海机电	100,018,871.93	7.69

8	600028	中国石化	93.063.323.77	6.28
9	000666	瀚市海药	91.230.041.06	6.47

30	000410	中国铝业	90,740,349.64	6.43
31	000106	中信特钢	89,981,971.08	6.20
32	000000	中国石化	89,768,263.61	6.17
33	000100	长江电力	89,084,348.68	6.04
34	000002	万科A	88,960,400.00	6.03
35	000009	金城股份	75,526,000.00	5.21
36	000005	上海电力	47,435,571.69	4.70
37	000020	深发展	45,431,034.83	4.45
38	000260	凯龙股份	40,976,660.04	3.86
39	000000	浦发银行	40,552,533.77	3.82
40	000101	华能电力	40,280,197.02	3.81
41	000103	华能国际	40,261,261.33	3.02

22	000000	新豐號	16,963,807.77	2186
23	000000	廣豐隆號	15,113,150.61	2187
24	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2188
25	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2189
26	000000	三昌隆號	10,926,540.53	2190
27	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2191
28	000000	林德隆號	47,404,150.53	2192
29	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2193
30	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2194
31	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2195
32	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2196
33	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2197
34	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2198
35	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2199
36	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2200
37	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2201
38	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2202
39	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2203
40	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2204
41	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2205
42	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2206
43	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2207
44	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2208
45	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2209
46	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2210
47	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2211
48	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2212
49	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2213
50	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2214
51	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2215
52	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2216
53	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2217
54	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2218
55	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2219
56	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2220
57	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2221
58	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2222
59	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2223
60	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2224
61	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2225
62	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2226
63	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2227
64	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2228
65	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2229
66	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2230
67	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2231
68	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2232
69	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2233
70	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2234
71	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2235
72	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2236
73	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2237
74	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2238
75	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2239
76	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2240
77	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2241
78	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2242
79	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2243
80	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2244
81	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2245
82	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2246
83	000000	廣發隆號	10,642,527.17	2247

41	000000	未分配利润	40,756,000.00	2389
42	000111	坏账准备	40,132,000.00	2389
43	000100	公允价值变动损益	20,922,311.88	2389
44	000130	交易性金融资产	10,474,323.39	2389
45	000101	存货跌价准备	20,481,000.00	2389
46	300100	可供出售金融资产	20,064,301.97	2389
47	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
48	000005	坏账准备	20,260,143.00	2389
49	000100	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
50	000000	公允价值变动损益	20,922,311.88	2389
51	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
52	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
53	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
54	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
55	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
56	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
57	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
58	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
59	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
60	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
61	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
62	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
63	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
64	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
65	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
66	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
67	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
68	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
69	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
70	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
71	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
72	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
73	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
74	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
75	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
76	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
77	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
78	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
79	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
80	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
81	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
82	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
83	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
84	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
85	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
86	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
87	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
88	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
89	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
90	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
91	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
92	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
93	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
94	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
95	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
96	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
97	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
98	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
99	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389
100	000000	公允价值变动损益	30,385,003.33	2389

16	600369	西南证券	33,319,620.42	2.36
16	600063	陆家嘴	33,287,287.91	2.36
17	600067	冠城大通	33,088,819.43	2.34
18	300033	同花顺	32,886,736.66	2.33

60	200274	阳光电源	21.948,927.20	2.26
61	000720	新宙邦	31.776,283.07	2.38

62	600007	中国神华	31,031,452.88	2.24
63	000489	海油工程	31,028,772.28	2.24
64	000009	新华百货	31,428,972.28	2.24
65	000118	华鲁恒升	30,385,399.28	2.16
66	000451	五洲药业	30,376,398.28	2.16
67	000004	华兰生物	29,536,271.08	2.16
68	000170	大冶有色	29,348,271.08	2.16
69	000149	汇金股份	29,188,126.08	2.16
70	000227	银禧食品	29,218,224.08	2.07
71	000077	华联控股	29,188,977.11	2.07
72	000005	圣农发展	28,933,992.07	2.06
73	000001	平安银行	28,933,992.07	2.06

注1：卖出主要指二级市场以上主动的卖出，换股、要约收购、发行回购及股权减少类的股票；

注2：卖出金额按成交金额（成交均价×成交数量）算列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 年末数据的部分已平仓及卖出股票的收入总额

	单位：人民币元
买入股票成本（元）总额	5,968,327,756.06
卖出股票收入（元）总额	4,943,116,888.43

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交均价×成交数量）算列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

		金额单位：人民币元	
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国债债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	99,406,444.00	0.79

	其中:政策性金融债	89,466,449.99	6.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

B 其他					
R 合计			100,406,443.00		0.27

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例之和及合计可能有尾差。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名证券投资明细

					金额单位：人民币元
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	018001	国开1801	100,240	100,406,443.00	0.27

7.7 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投资明细

本基金期末尚未有资产支持证券。

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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持仓,也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金于报告期内没有投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金于报告期内没有投资国债期货。

7.11.2 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持仓,也无期间损益。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资政策

本基金于报告期内没有投资国债期货。

7.12 投资衍生品合约情况

7.12.1 本基金持有的境外上市证券的发行主体未被中国证监会列入观察名单,或在报告披露前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金持有的前十名境外投资标的基金合同规定的备选股票清单。

7.12.3 本基金其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额

2	应收证券清算款	71,319,846.92
3	应收股利	--
4	应收利息	2,467,397.47
5	应收申购款	11,636,117.62
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	88,689,730.03

7.12.4 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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票名称	流通受限股份占总股本 (%)	占基金资产净值的比例 (%)	流通受限情况说明
1	000066	海南橡胶	16,367,625.52	6.06	重大资产重组
2	000010	桂东电力	80,626,041.69	5.71	重大资产重组

8.1 期末基金债券持有人户数及持有人结构

8.2 期末基金资产组合中公允价值计量项目公允价值变动情况

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构		公允价值变动情况	
		机构投资者	个人投资者	持有份额	公允价值变动比例
44,089	281,738.17	2,039,518.81	0.16%	1,264,738,626.27	99.84%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额(股)(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金		

8.2 期末基金管理人持有本基金开放式基金份额总量占总额的情况		
项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）	
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0	
本基金基金经理持有本开放式基金	0	
§9 开放式基金份额变动		
基金合同生效日：2016年9月16日	基金合同总额	1,997,160,297.94

单位：份

基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	1,662,666,770.21
基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	2,143,037,070.21
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额扣除基金总赎回份额(份额减少)之和	-
本报告期间基金总申购份额	1,266,779,345.06

注:1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;
2.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期,本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构/销售人人事变动

1、基金管理人

于2015年4月20日聘任王冠臣为招商证券资产管理有限公司副总经理,公司于2015年4月28日对外披露;曾二七

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
 本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变
 无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
 本报告期内审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。该审计机构自基金合同生效之日起担任本基金的审计机构。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或行政处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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

金额单位:人民币元						
券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总金额比例	佣金	占当期佣金总额比例	
长城证券	1	61,506,320.63	0.57%	16,996.72	0.03%	—
国信证券	1	2,896,356,389.48	26.03%	2,483,347.29	25.65%	—
国联证券	1	1,527,695,986.11	14.17%	1,380,894.34	14.37%	—
恒泰证券	1	—	—	—	—	—

国联证券	1	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—
华创证券	1	2,480,429,133.69	23.01%	2,194,933.63	22.67%

注:1.券商的选择标准和程序
2.截至2019年6月30日

(A) 券商财务状况良好, 经营行为规范, 风险管理先进, 投资风格稳健且与贵司有互补性, 在最近一年内有重大违法违规行为;

(B) 券商具有较好的综合研究能力, 全面、及时、提供高质量的研究于贵司, 行业、公司研究覆盖广;

(C) 券商具有较好的投研团队及其丰富的基金管理经验, 有较好的分析能力, 能根据贵司端所管理基金的特定要求, 提供专门研究服务, 具有有效促进资产配置和风险控制能力; 及能够协助贵司;

(3) 其他券商相比, 该券商能够提供更优质及更及时更优惠合理的投资建议;

(2) 选择程序

(A) 制定评价标准和流程, 以上标准对不同券商进行打分, 选择得分最高。券商评价和股权收益评价标准, 包括但不限于, 在公开市场, 研究团队和上市公司关系; 根据公司基本规范和股东关系等因素制定对合作券商的数量, 每年根据公司实际情况, 动态调整;

2.券商的评估、保留和更换程序

(1) 席位的租期用期暂定为一年,合同到期15天内,投资研究部门将根据各券商研究在报告期内的综合证券服务品质等情况,进行择优。

券种名称		债券交易		债券回购交易		权证交易	
		成交金额	成交当日的比例	成交金额	占当期债券回购成交金额的比例	成交金额	占当期权证成交金额的比例

长城证券	1,707,316.80	1.85%	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	90,471,202.50	98.15%	18,499,000,000.00	99.25%	—	—
华融证券	—	—	—	—	—	—

国泰君安	--	--	140,000,000.00	0.75%	--	--
国联证券	--	--	--	--	--	--
瑞银证券	--	--	--	--	--	--
华信证券	--	--	--	--	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。