

## 招商核心价值混合型证券投资基金

### 2018年第二季度报告

少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度市场波动较大,各大股指基本是从季度初跌到季度末,而且周期股、成长股和消费股都经历了一波较大调整。本组合持仓在季度内也有比较大的调整,周期股的仓位大幅下调,增加了一些白酒上的消费类或成长类的股票仓位,同时下降了一些股票总仓位。但是基金净值仍然在季度内出现较大调整。报告期间,本基金的权益以外的资产主要是通过交易所逆回购为主动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为-11.15%,同期业绩比较增长率为-5.08%。

4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

#### § 投资报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	794,385,271.53	72.06
2	其中:股票	794,385,271.53	72.06
3	固定收益投资	70,046,340.00	6.49
4	其中:债券	70,046,340.00	6.49
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	80,000,000.00	7.41
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	143,596,230.00	13.00
10	其他资产	1,827,463.04	0.17
合计		1,079,884,199.77	100.00

5.2 报告期末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	30,277,102.10	4.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	666,779,142.18	60.13
D	电力、热力、燃气及生产供应业	71,569.08	0.01
E	建筑业	11,363,770.29	1.05
F	批发和零售业	18,726,000.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	62,391,414.13	6.51
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	37,010,360.00	3.34
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	20,356,462.06	3.09
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,091,786.00	1.88
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		794,385,271.53	81.62

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.63 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.65 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.69 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.71 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.72 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.76 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.77 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.78 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.79 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.80 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.81 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.82 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.83 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.84 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.85 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.86 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.87 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.88 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.89 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.90 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.91 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.92 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.93 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.94 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.95 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.96 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.97 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.98 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.99 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.100 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.101 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.102 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.103 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资