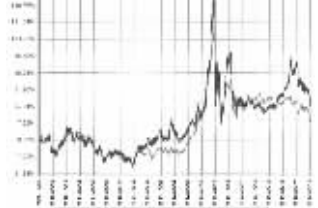


招商中小盘精选混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

2.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图例：1.招商中小盘精选混合型证券投资基金累计净值增长率变动；2.招商中小盘精选混合型证券投资基金业绩比较基准收益率变动



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
报告期内，从宏观经济看，国内经济基本平稳，货币政策维持中性的态势，金融领域的去杠杆持续推进，随着中美贸易关系的缓和及美国加息的进行，汇率呈现出一定的贬值，沪深300指数在报告期内下跌5.9%，食品饮料、餐饮旅游、医药、石油石化、家电板块表现较好，通信、电力设备、有色金属、钢铁等行业表现偏弱。
本基金在报告期内对市场保持中性的策略，结构配置上以消费、医药、科技股为主。
4.5 报告期内基金业绩表现说明
报告期内，本基金净值增长率12.08%，同期业绩比较基准为-10.63%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
报告期内，本基金未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。

5 投资组合报告

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	122,087,404.58	79.07
2	其中:股票	122,087,404.58	79.07
3	固定收益投资	105.00	0.00
4	其中:债券	105.00	0.00
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	20,500,000.00	13.29
8	其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和拆出资金	10,002,812.21	6.33
10	其他资产	943,101.31	0.59
11	合计	154,136,014.00	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	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	-	3,729,226.41	2.44
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	76,225,443.38	49.07
E 建筑业	-	3,617,033.65	2.37
F 批发和零售业	-	12,239,794.93	7.93
G 交通运输、仓储和邮政业	-	3,292,969.29	2.16
H 信息传输、软件和信息技术服务业	-	5,943,826.30	3.87
I 金融业	-	1,389,006.00	0.89
J 房地产业	-	2,145,413.09	1.39
K 租赁和商务服务业	-	106,522.00	0.07
L 科学研究和技术服务业	-	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
N 卫生和社会工作	-	-	-
O 文化、体育和娱乐业	-	3,066,122.00	2.00
P 综合	-	-	-
合计	-	122,087,404.58	80.43

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	-	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E 建筑业	-	-	-
F 批发和零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
H 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	-
I 金融业	-	-	-
J 房地产业	-	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
N 卫生和社会工作	-	-	-
O 文化、体育和娱乐业	-	-	-
P 综合	-	-	-
合计	-	-	-

5.3 报告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

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300113	中科曙光	26,044	601,116.04	0.39
2	603016	思瑞新材	27,700	606,970.00	0.39
3	603026	广汇能源	146,440	594,496.00	0.38
4	603033	德棉股份	32,442	579,755.34	0.37
5	603232	德棉股份	68,700	674,670.00	0.43
6	603309	今创集团	26,300	566,194.00	0.36
7	600519	中国石化	72,000	565,466.00	0.36
8	300274	汇川技术	62,000	545,213.00	0.35
9	300056	红日药业	154,100	542,406.00	0.35
10	300038	鹏辉能源	80,102	542,162.00	0.35

5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000069	金岭铁矿	144,410	1,046,972.00	0.69
2	000019	招商局港口	96,800	403,032.00	0.26
3	002011	新钢股份	22,700	400,362.00	0.26
4	300018	海康威视	38,100	406,146.00	0.26
5	300039	海康威视	73,000	398,650.00	0.26

5.4 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128021	元和转债	1,115.20	0.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	国债期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名商品期货投资明细

序号	商品期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.10 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券回购投资明细

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.13 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.15 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.17 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.19 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.21 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.23 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.25 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.27 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.29 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.31 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.33 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.35 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.37 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.39 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.41 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.43 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.45 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.47 报告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证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	1,115.20	0.00

5.49 报告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证投资明细