

2018年半年度报告摘要

管理人薪酬=前一日基金资产净值×19%÷当年天数

6.48.2 基金托管费

单位：人民币

项目	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的基金托管费	4,408,084.24	3,165,807.67

注：本基金按前中国工商银行公布的托管费按照前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.48.3 与关联方发生银行间同业拆借市场交易和债券回购交易

本基金本报告期末上年度初均与关联方发生银行间同业拆借市场的债券（含回购）交易。

6.48.4 关联方投资本基金的情况

6.48.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末上年度初均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.48.4.2 报告期内与上年度初比较期间关联方投资本基金运用固有资金投资本基金的情况。

本基金本报告期末与上年度初均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

6.48.4.3 报告期内除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末与上年度末均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

6.48.5 由关联方托管的银行存余款及当期产生的利息收入

单位：人民币

资产减值准备	561,082,389.00	1,053,540.81	474,044,326.04	1,425,835.83
--------	----------------	--------------	----------------	--------------

注：本基金的银行存款存在委托受托人于银行进行保管，按银行同业利率计息。

645B 本基金的资产在资产负债表日与关联方公允价值变动

本基金未涉及关联方、非关联方期间均有存在承销期间与关联方公允价值变动的事项。

647C 其他关联方交易事项的说明

本基金本期涉及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

649 期末(2016年6月30日)本基金持有的流通受限证券

649C 确认认购/申购或发行于期末持有的流通受限证券

本基金期末未持有因认购/申购/增发存在流通受限的证券。

649Z 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

493 银行间市场和债券回购市场公允价值正回购中作为抵押的债券。

494 基本金融期末未交易的市场公允价值正回购中作为抵押的债券。

495 交易所市场和债券回购市场公允价值正回购中作为抵押的债券。

496 基本金融期末未交易的市场公允价值正回购中作为抵押的债券。

640 用于理解和分析会计准则要求说明的其他事项

①公允价值

②金融工具公允价值计量的方法

③公允价值计量金额的层次, 即对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次

定义:

第一层次, 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次, 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次, 相关资产或负债的不可观察输入值。

④持续的公允价值计量的金融工具

⑤非持续的公允价值计量的金融工具

⑥公允价值计量输入值的来源

例: 2018年6月30日, 本公司持有以公允价值计量的其发行日期最近的金融债券资产中属于第一层次为 2306455333.33 元, 第二层次的为 536.9625 元, (2017 年 2 月 28 日, 第一层次的为 3365.0012 元, 第二层次的为 7536.9625 元, 第三层次的为 0 元)

公允价值所属层次之间的重大转换

对于公允价值所属层次的重大转换, 若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括连续涨停时的交易不活跃) 和非正常交易行为等, 本基金公司于停牌日或交易恢复活跃日或限售期结束后, 按照公允价值所属的公允价值第一层次, 并相信估值过程中采用的不可观察输入值对于公允价值

(ii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额无。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日, 同)。

(4) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,310,240,533.33	79.96
	其中:股票	2,310,240,533.33	79.96

3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	资产重组投资	-	-
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	571,011,367.31	19.77
8	其他各项资产	7,414,068.63	0.26
9	合计	2,888,665,969.27	100.00

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	2,161,978,309.43	77.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	27,600,747.90	0.96
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	-	-
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	-	-
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	2,310,240,533.33	82.58

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	300296	利亚德	20,896,890	269,151,943.20	96.66

2	002217	合力泰	30,953,942	265,370,021.50	9.13
3	000661	长春高新	1,075,027	244,783,647.90	8.79
4	002737	葵花药业	10,568,823	228,603,641.49	8.17
5	000001	平安银行	4,696,333	600,233,640.00	7.99

6	600667	通化东宝	5,345,801	128,138,849.97	4.51
7	300476	胜宏科技	8,062,419	124,469,252.60	4.41
8	000963	华东医药	2,500,756	120,661,477.00	4.31

10	002563	森马服饰	6,775,152	96,884,673.80	3.41
----	--------	------	-----------	---------------	------

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半年度报告全文。

74.1 报告期内股票投资组合的重大变动

74.1.1 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

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	600340	华夏幸福	332,244,130.03	8.07
2	600703	三安光电	249,562,679.88	6.00
3	600577	鼎泰新材	200,285,000.00	5.00

4	601939	建设银行	233,213,749.64	5.62
5	600487	亨通光电	232,580,322.57	5.61

6	600566	济川药业	232,033,544.34	5.68
7	000661	长春高新	226,364,064.35	5.46

8	603799	华友钴业	210,707,723.59	5.08
9	002406	天齐锂业	200,506,569.62	4.84

10	600048	保利地产	175,317,786.73	42%
11	002415	尚康威视	156,543,886.51	37%

13	002236	大华股份	149,903,478.48	3.62
14	300349	金卡智能	144,372,899.85	3.48

15	300316	晶盛机电	142,475,904.72	3.4
16	601012	隆基股份	138,196,123.27	3.3

17	600867	通化东宝	135,754,641.83	3.2%
18	600036	招商银行	135,401,722.83	3.2%

19	000568	泸州老窖	132,486,232.24	3.21
20	002422	科伦药业	122,791,674.88	2.98

21	601155	新城控股	116,519,681.00	2.8
22	601155	新城控股	116,519,681.00	2.8
23	900182	康成股份	114,809,550.79	2.7

24	001298	农业银行	114,365,168.47	27
25	300323	华灿光电	109,606,933.85	26

26	000651	格力电器	92,302,883.50	2.27
27	300199	翰宇药业	88,805,877.84	2.14

28	002563	森马服饰	87,560,332.93	2.1%
29	300036	超图软件	86,302,637.05	2.0%

742 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
