泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2018年8月27日

§1重要提示

1.1重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	泰达宏利红利先锋混合
基金主代码	162212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月3日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	138,011,522.28份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	力争实现基金资产的长期稳定增值和基金的持续稳定分红。
投资策略	1.资产配置策略 基金投资股票资产的最低比例为基金资产的60%,最高为95%,投资于债券资产的比例最高为40%,最低为0%。 2.股票投资策略 本基金兼顾投资于具有持续分红特征及潜力的红利股和具有成长潜力特征的上市公司,其中投资于红利股的比例不低于基金股票资产的80%。"红利股"应具备本基金对红利股定量筛选标准中的一项或多项特征。 3.债券投资策略 对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一,通过采用积极主动的投资策略,结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,运用久期调整、凸度控报、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略,权衡到期收益率与市场流动性,精选个券并构建和调整债券组合,在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。 4.权证投资策略 本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权证投资。
业绩比较基准	75%×标普中国A股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	田青
	联系电话	010-66577513	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-698-8888	010-67595096
传真		010-66577666	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	564,965.84
本期利润	-12,051,410.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0869
本期基金份额净值增长率	-7.92%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0401
期末基金资产净值	143,543,184.86
期末基金份额净值	1.040

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

3.2基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.28%	2.00%	-6.66%	1.03%	1.38%	0.97%
过去三个月	-5.87%	1.53%	-7.11%	0.81%	1.24%	0.72%
过去六个月	-7.92%	1.48%	-8.09%	0.86%	0.17%	0.62%
过去一年	-1.98%	1.28%	-7.02%	0.68%	5.04%	0.60%
过去三年	-34.20%	1.85%	-13.79%	1.16%	-20.41%	0.69%
自基金合同生效起至今	58.72%	1.61%	64.06%	1.11%	-5.34%	0.50%

注:本基金的业绩比较基准:75%×标普中国A股红利机会指数+25%×上证国债指数。

标普中国A股红利机会指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的具有高红利特征、盈利能力和利润增长率稳定且具有一定规模及流动性的股票作为样本股,以股息率的最大化及覆盖个股与行业的多样化为标准,使用股息率作为加权指标构建的指数。它可以综合反映沪深证券市场中高股息股票的整体状况和走势,比较符合本基金的投资策略和投资方向。

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的市场代表性。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

注:本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

§4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司,泰达荷银基金管理有限公司,成立于2002年6月,是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)、泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资团队全体人员的共同努力,力求实现基金财产的持续增值。

4.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
邓艺颖	本基金基金经理;投资副总监兼投资部总监	2015年4月3日	-	13	湖南大学金融学硕士;2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部职员;2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部副总监、投资副总监兼研究部总监,现任投资副总监兼基金投资部总监;具备13年基金从业经验,13年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程,并严格执行制度的规定。在投资管理活动中,本基金管理人公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令;对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内,未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控,风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估,向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾我们年初的看法,消费升级和先进制造两条腿走路的逻辑出现一定短期波动。在消费升级和个税调整预期下,食品饮料、医药、家电等相关个股均处于高位震荡阶段,估值和业绩的匹配度不高,行情进一步延伸到三四线城市、新兴消费领域的个股存在补涨和价值发现的机会。受中美贸易战和中兴通信事件引发对华技术封锁的背景下,科技板块尤其是5G和半导体板块存在技术可能短期难以突破的困境,难以形成持续性行情。与此同时,我们认为上半年最大的变化源自于资管新规后信用风险的暴露。这在一定程度上说明在新的金融监管框架和资管新规实施的背景下,金融活动中的监管机构和微观主力行为规则正在发生变化。这是一个信用风险开始进行暴露和重新定价的过程,也是一轮直接融资大跃进的过程,其中最重要的原因是新兴经济产业发展的趋势不再单方面依靠债权融资。中期来看,对整体A股市场国际化进程、制度成熟、投资者结构优化有帮助,但短期而言,经济预期和监管预期不稳定极大的影响了投资者的预期。

1季度我们的操作是:减持了部分保险、白酒、家电等防御性板块的龙头公司,增持了医药、信息安全、新能源汽车上游稀缺资源等龙头公司。2季度我们的操作是:减持部分保险、地产、证券等行业发展逻辑受到影响的个股,增持了医药、食品、计算机等板块个股。重点关注估值合理,内生业务增长能力稳健,尤其是具备行业核心竞争壁垒的公司。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.040元;本报告期基金份额净值增长率为-7.92%,业绩比较基准收益率为-8.09%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们对市场观点保持谨慎积极。理由:1.金融监管进一步协同合作,资管新规对操作执行细节形成稳定预期;2.新兴产业如工业互联网、人工智能、5G等行业发展提升整体经济的基本效率,实现经济可持续和高质量的发展;3.财税体制改革、医疗教育等行业发展得到更多的政策支持,提升人民群众生活水平;4.新兴产业龙头公司业绩持续稳健增长,提供市场长期资金的赚钱效应。在具体的投资操作中,我们的策略是采取均衡配置的方式,坚持以个股成长性为主要选股逻辑,弱化市场风格和行业属性,重点关注上市公司内生的创造现金流的能力,回避高负债、高股权质押、大额减持风险的个股。

参考海外市场的经验,我们认为高ROE、稳定成长的行业龙头公司将成为我们主要的投资标的,理由包括:1)经济结构背景处于从工业化往信息化、消费升级时代转变的过程中,行业龙头往往能够在总需求相对平稳的局面下获得更多的市场资源,有更强的资源要素掌控能力;2)资本市场不断成熟的过程中,市场监管政策的从严,使得资金短期逐利性降低,市场参与者相对理性,市场整体估值中枢下降。在这个过程中,只有通过业绩稳定增长才能抵御估值下行的风险;3)新的投资者进入带来不同的投资理念,提升了行业龙头的市场关注度。我们相对看好的方向是:1)龙头消费板块,尤其以白酒、旅游为核心,业绩增长确定性高,有一定的估值溢价;2)医疗服务和创新药,受益于消费升级和国家加快重要疾病领域临床用药的评审;3)计算机行业中的云计算、物联网和信息安全;4)半导体设备和材料等国家将加大技术力量和资源投入的基础技术领域。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任,成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人;委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论,发表相关意见和建议,但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内,本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况,本基金于2018年1月10日公告按每10份基金份额派发0.20元进行利润分配,权益登记日、除权日为2018年1月11日,红利发放日为2018年1月12日,共分配2,800,043.27元;本基金于2018年4月11日公告按每10份基金份额派发0.12元进行利润分配,权益登记日、除权日为2018年4月16日,红利发放日为2018年4月17日,共分配1,650,418.09元。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日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托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为4,450,461.36元。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		8,926,816.22	11,679,577.68
结算备付金		541,406.17	326,037.78
存出保证金		72,991.91	80,907.08
交易性金融资产		132,302,718.70	153,135,844.24
其中:股票投资		132,302,718.70	152,814,459.76
基金投资		-	-
债券投资		-	321,384.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,229,129.49	-
应收利息		3,133.37	3,378.75
应收股利		-	-
应收申购款		79,424.87	63,054.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		144,155,620.73	165,288,799.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		18,059.36	112,607.81
应付管理人报酬		178,751.85	210,613.15
应付托管费		29,791.99	35,102.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		308,970.99	229,673.08
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		76,861.68	380,027.55
负债合计		612,435.87	968,023.79
所有者权益:			
实收基金		138,011,522.28	141,494,664.33
未分配利润		5,531,662.58	22,826,111.55
所有者权益合计		143,543,184.86	164,320,775.88
负债和所有者权益总计		144,155,620.73	165,288,799.67

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.040元,基金份额总额138,011,522.28份。

6.2利润表

会计主体:泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一.收入		-9,686,848.03	19,141,304.92
1.利息收入		57,722.40	62,292.70
其中:存款利息收入		57,701.27	62,253.07
债券利息收入		21.13	39.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,865,887.64	1,105,875.62
其中:股票投资收益		2,226,952.03	317,163.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益		36,503.05	13,429.97
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		602,432.56	775,282.43
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-12,616,376.18	17,960,497.36
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		5,918.11	12,639.24
减:二.费用		2,364,562.31	3,214,151.30
1.管理人报酬		1,160,395.29	1,327,205.24
2.托管费		193,399.27	221,200.87
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		912,186.56	1,444,000.13
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用		98,581.19	221,745.06
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-12,051,410.34	15,927,153.62
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		-12,051,410.34	15,927,153.62

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	141,494,664.33	22,826,111.55	164,320,775.88
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-12,051,410.34	-12,051,410.34
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-3,483,142.05	-792,577.27	-4,275,719.32
其中:1.基金申购款	9,629,376.53	1,190,482.42	10,819,858.95
2.基金赎回款	-13,112,518.58	-1,983,059.69	-15,095,578.27
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-4,450,461.36	-4,450,461.36
五.期末所有者权益(基金净值)	138,011,522.28	5,531,662.58	143,543,184.86

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7投资组合报告

7.1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	132,302,718.70	91.78
	其中:股票	132,302,718.70	91.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
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	9,468,222.39	6.57
8	其他各项资产	2,384,679.64	1.65
9	合计	144,155,620.73	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末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	78,585,943.29	54.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,524,648.00	5.94
G	交通运输、仓储和邮政业	3,275,844.00	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,450,533.90	7.28
J	金融业	4,502,372.88	3.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,784,775.69	9.60
M	科学研究和技术服务业	3,298,657.95	2.30
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,727,157.00	6.78
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	132,302,718.70	92.17

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3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

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	601888	中国国旅	135,109	8,702,370.69	6.06
2	600519	贵州茅台	11,769	8,608,552.74	6.00
3	002371	北方华创	147,000	7,301,490.00	5.09
4	600763	通策医疗	143,400	6,979,278.00	4.86
5	603019	中科曙光	121,645	5,579,856.15	3.89
6	300073	当升科技	142,800	4,863,768.00	3.39
7	600276	恒瑞医药	61,362	4,648,785.12	3.24
8	000860	顺鑫农业	119,000	4,462,500.00	3.11
9	600884	杉杉股份	194,900	4,307,290.00	3.00
10	002507	涪陵榨菜	167,300	4,296,264.00	2.99

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601888	中国国旅	10,489,803.00	6.38
2	603019	中科曙光	7,007,351.00	4.26
3	002371	北方华创	6,976,470.00	4.25
4	000710	贝瑞基因	6,698,703.97	4.08
5	300601	康泰生物	6,636,393.57	4.04
6	002466	天齐锂业	6,397,419.75	3.89
7	600570	恒生电子	6,133,341.10	3.73
8	300413	快乐购	6,089,910.00	3.71
9	300059	东方财富	6,069,797.80	3.69
10	002180	纳思达	6,062,699.00	3.69
11	300482	万孚生物	6,011,889.00	3.66
12	600028	中国石化	5,893,552.20	3.59
13	601111	中国国航	5,555,849.00	3.38
14	600519	贵州茅台	5,551,015.29	3.38
15	603993	洛阳钼业	4,818,554.23	2.93
16	001979	招商蛇口	4,669,421.00	2.84
17	002507	涪陵榨菜	4,613,338.00	2.81
18	300633	开立医疗	4,597,998.00	2.80
19	601009	南京银行	4,540,683.00	2.76
20	300073	当升科技	4,531,201.00	2.76
21	002635	安洁科技	4,486,903.00	2.73
22	000860	顺鑫农业	4,478,571.36	2.73
23	600884	杉杉股份	4,422,730.00	2.69
24	002433	太安堂	4,041,688.25	2.46
25	600703	三安光电	4,017,998.00	2.45
26	600048	保利地产	3,986,423.00	2.43
27	000977	浪潮信息	3,924,519.00	2.39
28	603799	华友钴业	3,855,056.00	2.35
29	300197	铁汉生态	3,849,462.00	2.34
30	002268	卫士通	3,841,369.00	2.34
31	300383	光环新网	3,828,330.00	2.33
32	300723	一品红	3,815,756.00	2.32
33	603259	药明康德	3,768,833.60	2.29
34	300206	理邦仪器	3,552,259.68	2.16
35	002043	兔宝宝	3,413,102.00	2.08
36	601398	工商银行	3,411,120.00	2.08
37	600196	复星医药	3,410,640.00	2.08
38	600036	招商银行	3,410,192.00	2.08
39	300618	寒锐钴业	3,395,319.00	2.07
40	002146	荣盛发展	3,354,942.00	2.04

注:"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	9,071,738.00	5.52
2	601398	工商银行	8,803,526.83	5.36
3	000858	五粮液	7,663,793.89	4.66
4	300601	康泰生物	7,550,409.60	4.59
5	600276	恒瑞医药	7,518,913.20	4.58
6	000710	贝瑞基因	6,917,195.09	4.21
7	601318	中国平安	6,747,133.00	4.11
8	000651	格力电器	6,360,771.07	3.87
9	300482	万孚生物	5,879,043.00	3.58
10	601601	中国太保	5,737,584.00	3.49
11	000538	云南白药	5,665,702.40	3.45
12	000063	中兴通讯	5,555,831.00	3.38
13	002180	纳思达	5,443,503.00	3.31
14	600028	中国石化	5,330,956.00	3.24
15	002466	天齐锂业	5,239,508.00	3.19
16	000002	万科A	4,861,759.80	2.96
17	300633	开立医疗	4,826,164.75	2.94
18	601111	中国国航	4,767,800.00	2.90
19	002142	宁波银行	4,651,083.10	2.83
20	603993	洛阳钼业	4,646,819.90	2.83
21	000333	美的集团	4,638,794.00	2.82
22	002050	三花智控	4,637,910.90	2.82
23	600519	贵州茅台	4,625,372.00	2.81
24	002714	牧原股份	4,520,255.00	2.75
25	002285	世联行	4,401,537.56	2.68
26	002268	卫士通	4,338,945.10	2.64
27	601989	中国重工	4,309,120.90	2.62
28	002202	金风科技	4,068,390.50	2.48
29	601766	中国中车	3,983,703.00	2.42
30	001979	招商蛇口	3,850,980.00	2.34
31	601888	中国国旅	3,789,447.02	2.31
32	603799	华友钴业	3,720,445.00