富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:富荣基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年03月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年02月11日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富荣福泰混合	
基金主代码	004788	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月11日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	19,168,386.02份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣福泰混合A	富荣福泰混合C
下属分级基金的交易代码	004788	004789
报告期末下属分级基金的份额总额	168,386.02份	19,000,000.00份

2.2 基金产品简介

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合,在严格控制风险的基础上,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等),并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型,动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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		富荣基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	滕大江	张燕
	联系电话	0755-84356633	0755-83199084
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-685-5600	95555
传真		0755-83230787	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.furamc.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2018年02月11日(基金合同生效日)-2018年12月31日	
	富荣福泰混合A	富荣福泰混合C
本期已实现收益	-28,905.77	-9,296,860.00
本期利润	-35,229.72	-10,289,958.52
加权平均基金份额本期利润	-0.4093	-0.2198
本期基金份额净值增长率	-29.07%	-29.15%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.2907	-0.2915
期末基金资产净值	119,435.59	13,461,973.33
期末基金份额净值	0.7093	0.7085

注:①上述基金业绩指标不包括持有人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;
②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;
③期末可供分配利润是采用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;
④本基金合同生效日为2018年2月11日,至本报告期末不满一年。

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

富荣福泰混合A

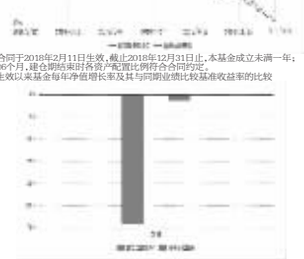
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.79%	0.85%	-1.79%	0.49%	-15.00%	0.36%
过去六个月	-21.65%	0.97%	-1.35%	0.44%	-20.30%	0.53%
自基金合同生效起至今	-29.07%	0.90%	-1.32%	0.40%	-27.75%	0.50%

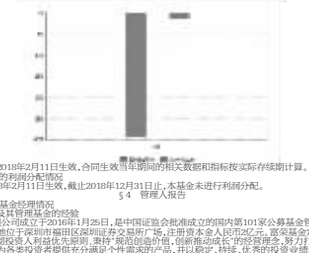
富荣福泰混合C

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
过去三个月	-16.81%	0.85%	-1.79%	0.49%	-15.02%	0.36%
过去六个月	-21.70%	0.97%	-1.35%	0.44%	-20.35%	0.53%
自基金合同生效起至今	-29.15%	0.90%	-1.32%	0.40%	-27.83%	0.50%

注:本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%

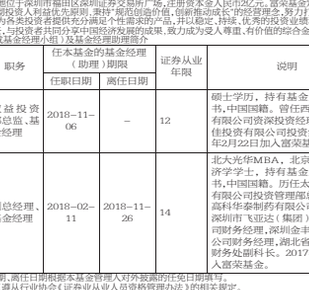
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

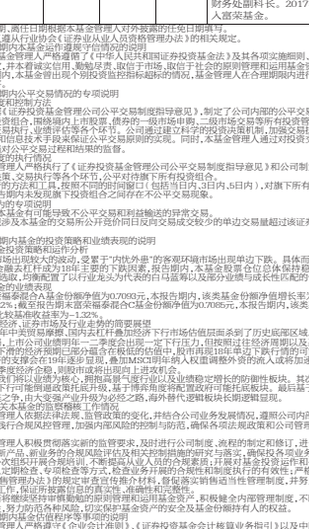




注:①本基金基金合同于2018年2月11日生效,截止2018年12月31日止,本基金成立未满一年;
②本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:本基金合同于2018年2月11日生效,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于2018年2月11日生效,截止2018年12月31日止,本基金未进行利润分配。

§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

富荣基金管理有限公司成立于2016年1月25日,是中国证监会批准成立的国内第101家公募基金管理公司。公司注册地为广州市南沙区,办公地位于深圳市福田区深圳证券交易所广场,注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于"综合金融服务商",围绕客户需求,贯彻投资人利益优先原则,秉持"规范创造价值,创新推动成长"的经营理念,努力打造业内核心竞争力,整合产业上下游资源,为各类投资者提供充分满足个性需求的产品,并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优质的服务回报投资者的信任,与投资者共同分享中国经济发展的成果,致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领先者。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策流程介绍

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑宇翔	权益投资部总监、基金经理	2018-11-06	-	12	硕士学历,持有基金从业资格证书,中国国籍。曾任西南证券股份有限公司资深投资经理、深圳东新佳投资有限公司投资经理。2017年2月21日加入富荣基金。
胡长虹	副总经理、基金经理	2018-02-11	2018-11-26	14	北大光华MBA,北京工商大学经济学学士,持有基金从业资格证书,中国国籍。历任太平财产保险有限公司投资管理部总经理,北大高科华泰制药有限公司副总经理,深圳市飞亚达(集团)股份有限公司财务经理,深圳金丰泰对外发展公司财务经理,湖北省粮食局计划财务处副科长。2017年5月2日加入富荣基金。

注:1.上述任职日期,离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2.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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金管理人没有任何投资监督指标超标的情况,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了公司内部的公平交易制度,该制度所规范的范围涵盖旗下各类投资组合,围绕境内上市股票、债券一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,并涵盖投权、研究分析、投资决策、交易执行、组合管理优等各个环节,以期通过建立科学的投资决策机制、加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和信息技术手段来保证公平交易原则的实现。同时,本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具,按照不同时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析,报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

2018年以来权益市场出现较大的波动,受累于"内忧外患"的客观环境市场出现单边下跌。具体而言中美贸易摩擦来回往复,宏观经济下行、金融去杠杆成为10年主要的下跌因素,报告期内,本基金股票仓位总体保持稳定,标的主要为沪深300、中证500成分股中选取,均衡配置了以行业龙头为代表的白马蓝筹以及部分业绩与成长性匹配的优质成长股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为0.7093元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-29.07%,同期业绩比较基准收益率为-1.32%;截至报告期末富荣福泰混合C基金份额净值为0.7085元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-29.15%,同期业绩比较基准收益率为-1.32%。

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2019年:2018年中美贸易摩擦、国内去杠杆叠加经济下行市场估值层面未到了历史底部区域。展望2019年我们认为到今天要考虑宏观、上市公司业绩明年一二季度会出现一定下行压力,但按照过往经济周期以及基数原因有望在19年三季度见底,且当前下滑幅度相较三季度会有收敛趋势,因此再提出年底会有一定的可能性不大。中央经济工作会议后政策对经济的支撑会在19年显现,叠加MSCI明年纳入权重调整外资的流入或将加速,市场将出现结构性机会。具有19年一二季度经济企稳,则股市或将出现向上进攻机会。

展望下半期中,我们将以逆向思维为核心,拥抱高景气、高业绩稳定增长的防御性板块。其次,政策作为影响经济周期的重要变量,经济下行可能倒逼政策托底开始,基于博弈角度我们认为,在19年下半期,中美摩擦最后的体现是产业链之争,由大变强产业升级为必经之路,海外替代逻辑板块长期逻辑显现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人依据法律法规、监管政策的变化、业务发展情况,遵照公司内部控制的整体要求,不断完善内控建设,积极践行合规风控管理,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规政策和公司管理制度的落实,确保基金合规运作的资产稳健打。

报告期内,本基金管理人积极贯彻监察的监管要求,及时进行公司制度、流程的制定和修订,进一步完善了公司内控体系;全面配与各类新业务、新业务的合规风险评估及相关控制措施的研究与落实,确保应各项业务的合规开展;建立人员合规培训机制,及多次组织开展合规培训,不断强化员工合规意识,并编制基金投资运作和公司经营管理的合规性指标,通过实时监控、定期检查、专项检查等方式,检查业务开展的合规性和制度执行的有效性,严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料,督促落实销售适当性管理制度,并努力做好投资者教育工作,完成各项信息披露工作,保证外部监管信息的真实性、准确性和完整性。

本基金管理人承诺将继续坚持审慎勤勉的原则管理和运用基金资产,积极建立内部控制制度,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,切实保护基金资产的安全及基金份额持有人的权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人参与了《证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金估值业务的指引(试行)》《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、基金事务部、监察稽核部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、报告基金估值业务,估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格,专业胜任能力和相关工作经历,估值小组成员不存在重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议调整某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当调整,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未实行估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资;投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取申购费用,而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同;本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

(2) 增值税及附加、企业所得税

自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的资产买入返售金融商品业务,买断式买入返售金融商品业务,同业存款,同业存单以及存放金融信息服务取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局联税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;根据财政部、国家税务总局税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的,资管产品运营业务不得适用于简易计税方法,对资管产品在2015年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,发生的贷款利息支出,按照以下规定确定进项税额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债全额估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司处取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富荣基金管理有限公司("富荣基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行	基金托管人
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人的股东
深圳嘉年实业股份有限公司	基金管理人的股东
湖南典勤投资开发有限公司	基金管理人的股东

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年02月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	240,466.35
其中:支付销售机构的客户维护费	178.80

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.60%/当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年02月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	40,077.73

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.10%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年02月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福泰混合A	富荣福泰混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	40,013.02	40,013.02
招商银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	40,013.02	40,013.02

注:销售服务费每日计提,按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费,本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。销售服务费计提的计算公式如下:
H=E×基金份额的销售服务费年费率/当年天数
H为每日应计提的销售服务费
E为前一日的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富荣福泰混合A

份额单位:份

项目	本期 2018年02月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金合同生效日(2018年02月11日)持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

富荣福泰混合C

份额单位:份

项目	本期 2018年02月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金合同生效日(2018年02月11日)持有的基金份额	19,000,000.00
报告期初持有的基金份额	19,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	19,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	100.00%

注:1.申购含转换入份额,红利再投资份额;赎回含转换出份额。
2.投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。
3.本基金本报告期实际存续日为2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年02月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	771,778.42	86,800.78

注:本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行间业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与或不参与承销证券的情况

本基金于本报告期内未在承销期内参与或不参与承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、 重要事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重要事项。

2、 其他事项

(1) 公允价值

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

各应收金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币7,360,606.15元,无划分为第二层次及第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关股票公允价值列入第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券,若出现交易不活跃的情况,本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次;根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第二层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期期末持有公允价值划分为第三层次的金融工具,本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入(转出)的情况。

(2) 截至资产负债表日,本基金的资产净值在该20个工作日低于人民币5,000万元。

(3) 除公允价值及上述事项外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.11 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处于转股期的可转换债券。

7.4.12 期末前一个月内发行的可交换债券、可转换债券情况

本基金本报告期内未发行可交换债券、可转换债券。

7.4.13 报告期末债券回购融出资金余额及质押债券明细

本基金于本报告期内未进行债券回购融出资金。

7.4.14 报告期末卖出回购金融资产款余额及质押债券明细

本基金于本报告期内未进行卖出回购金融资产款。

7.4.15 报告期末本基金投资的前十名证券明细

7.4.15.1 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

序号	股票代码	股票名称	本期末证券市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000089	深圳机场	1,006,808.00	7.41
2	002004	华邦健康	983,313.00	7.24
3	603486	科沃斯	962,821.00	7.02
4	002038	双鹭药业	890,803.06	6.56
5	002127	南极电商	816,920.00	6.01
6	601128	常熟银行	673,036.10	4.96
7	002640	跨境通	667,440.00	4.91
8	300315	掌趣科技	470,549.00	3.46
9	002839	张家港行	457,760.00	3.37
10	600611	大众交通	303,639.00	2.24

报告期末按市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	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000089	深圳机场	6,927,110.00	51.00
2	600029	南方航空	6,456,296.00	47.53
3	300450	先导智能	5,860,404.00	43.15
4	600271	航天信息	5,335,225.89	39.28
5	002008	大族激光	4,800,476.00	35.35
6	002195	二三四五	4,715,230.00	34.72
7	601628	中国人寿	4,249,666.00	31.29
8	002273	水晶光电	4,079,284.40	30.04
9	601588	北辰实业	4,012,353.44	29.54
10	601009	南京银行	3,974,018.00	29.26
11	000338	潍柴动力	3,942,300.00	29.03
12	002475	立讯精密	3,850,200.66	28.35
13	601288	农业银行	3,807,703.00	28.04
14	300073	杨杰科技	3,604,587.00	26.54
15	002223	鱼跃医疗	3,598,365.00	26.49
16	600598	北大荒	3,517,160.00	25.90
17	002916	深南电路	3,419,397.00	25.18
18	600031	三一重工	3,297,050.00	24.28
19	600398	海澜之家	2,994,733.00	22.05
20	002555	三七互娱	2,897,000.00	21.33
21	002458	益生股份	2,657,475.00	19.57
22	002078	太阳纸业	2,651,119.60	19.52
23	600073	梅花生物	2,232,262.00	16.44
24	300063	欧比特	2,196,000.00	16.16
25	600028	中国石化	2,087,800.00	15.37
26	000899	赣能股份	2,058,404.00	15.16
27	601006	大秦铁路	1,960,500.00	14.44
28	300070	碧水源	1,921,474.00	14.15
29	002001	新和成	1,896,000.00	13.96
30	002624	完美世界	1,862,724.00	13.72
31	300073	当升科技	1,696,133.00	12.49
32	600536	中国软件	1,623,300.00	12.03
33	300136	信维通信	1,624,833.00	11.96
34	000564	供销大集	1,569,000.00	11.55
35	601111	中国国航	1,526,003.00	11.24
36	002038	双鹭药业	1,486,710.90	10.95
37	002153	石基信息	1,470,000.00	10.82
38	000960	锡业股份	1,458,956.00	10.74
39	600030	中信证券	1,458,750.00	10.74
40	600309	万华化学	1,456,048.00	10.72
41	000425	徐工机械	1,454,378.00	10.71
42	300433	蓝思科技	1,449,293.00	10.67
43	002124	天邦股份	1,432,000.00	10.54
44	300196	长海股份	1,401,716.00	10.32
45	600611	大众交通	1,397,300.00	10.29
46	002004	华邦健康	1,392,011.00	10.25
47	603486	科沃斯	1,374,967.00	10.12
48	000690	宝新能源	1,367,911.00	10.07
49	600019	宝钢股份	1,360,500.00	10.02
50	601398	工商银行	1,320,863.00	9.73
51	000060	深圳市A	1,275,400.00	9.39
52	002138	顺络电子	1,268,400.00	9.34
53	601158	重庆水务	1,231,346.86	9.07
54	600067	冠门象印	1,191,500.00	8.77
55	002387	维信诺	1,172,749.00	8.63
56	300476	胜宏科技	1,172,300.00	8.63
57	002127	南极电商	1,101,065.00	8.11
58	603816	顺丰控股	1,091,517.00	8.04
59	603113	金能科技	1,075,913.00	7.92
60	300166	东方国信	1,028,386.00	7.57
61	300197	铁汉生态	1,026,500.00	7.56
62	600674	川投能源	1,019,920.00	7.51
63	002371	北方华创	991,079.00	7.30
64	603214	爱婴室	972,005.00	7.16
65	002640	跨境通	956,193.00	7.04
66	601128	常熟银行	936,707.00	6.90
67	600068	葛洲坝	932,800.00	6.87
68	000961	中国国贸	925,768.00	6.82
69	000063	中兴通讯	920,500.00	6.78
70	600887	伊利股份	915,544.00	6.74
71	600754	锦江股份	895,546.00	6.59
72	600739	辽宁成大	868,500.00	6.39
73	601933	永辉超市	863,626.00	6.36
74	000822	山东海化	853,000.00	6.28
75	300284	苏交科	851,958.00	6.27
76	600688	上海石化	847,650.00	6.24
77	300568	星源材质	847,018.00	6.24
78	601818	光大银行	825,000.00	6.07
79	300470	日机密封	806,000.00	5.93
80	002415	海康威视	794,800.00	5.85
81	000768	中航飞机	792,500.00	5.84
82	002320	海峡股份	785,900.00	5.79
83	300146	汤臣倍健	757,306.00	5.58
84	002709	天赐材料	756,400.00	5.57
85	601618	中国中冶	756,000.00	5.57
86	002023	海特高新	739,713.72	5.45
87	300438	鹏辉能源	720,500.00	5.31
88	300315	掌趣科技	719,935.00	5.30
89	300058	蓝色光标	717,300.00	5.28
90	002340	格林美	711,000.00	5.24
91	600050	中国联通	703,894.00	5.18
92	600585	海螺水泥	654,200.00	4.82
93	601318	中国平安	650,000.00	4.79
94	601186	中国铁建	632,386.00	4.66
95	600967	内蒙一机	630,000.00	4.64
96	600570	恒生电子	624,020.00	4.59
97	601966	玲珑轮胎	623,060.24	4.59
98	300316	晶盛机电	622,906.00	4.59
99	000821	京山轻机	616,987.00	4.54
100	603688	石英股份	609,182.70	4.49
101	000672	上峰水泥	602,650.00	4.44
102	603589	口子窖	589,900.00	4.42
103	002717	岭南股份	585,250.00	4.34
104	600837	海通证券	587,500.00	4.33
105	300020	银江股份	586,000.00	4.31
106	603308	应流股份	582,145.00	4.29
107	000888	峨眉山A	581,075.00