（上接B475版）

务状况以及自2018年01月01日至2018年8月12日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,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;存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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、国家税务总局财税[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(以下简称“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。资管产品管理人未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的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018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》,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务,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（中债金融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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 长城基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司(“长城证券”) | 基金管理人股东、基金销售机构 |
| 东方证券股份有限公司(“东方证券”) | 基金管理人股东 |
| 中原信托有限公司 | 基金管理人股东 |
| 北方国际信托股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 长城嘉信资产管理有限公司 | 基金管理人控股子公司 |

注:于本期,并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年8月12日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 长城证券 | 27,335,615.73 | 49.97% | - | - |

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金于本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金于本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金于本期及上年度可比期间,均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年8月12日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 长城证券 | 25,457.54 | 49.97% | 25,457.54 | 98.58% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 长城证券 | - | - | - | - |

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等）。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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1月1日至2018年8月12日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 142,539.97 | 277,884.07 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 40,129.03 | 77,091.73 |

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1.00%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年8月12日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 31,358.83 | 61,134.47 |

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.22%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.22%/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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均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

注:本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金,于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

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

注:除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

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1月1日至2018年8月12日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 1,303,653.96 | 19,221.23 | 2,331,907.54 | 29,996.52 |

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 期末（2018年8月12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股票

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002450 | 康得新 | 2018年6月4日 | 重大事项停牌 | 17.08 | 2018年11月6日 | 15.31 | 15,073 | 274,327.34 | 257,446.84 | - |
| 002075 | 沙钢股份 | 2016年9月19日 | 重大事项停牌 | 21.31 | 2018年11月16日 | 14.48 | 7,800 | 112,008.00 | 166,218.00 | - |
| 002739 | 万达电影 | 2017年7月4日 | 重大事项停牌 | 23.79 | 2018年11月5日 | 31.10 | 6,003 | 303,820.06 | 142,811.37 | - |
| 002408 | 齐翔腾达 | 2018年6月19日 | 重大事项停牌 | 12.28 | 2018年11月14日 | 11.05 | 6,729 | 56,410.85 | 82,632.12 | - |
| 002310 | 东方园林 | 2018年5月25日 | 重大事项停牌 | 14.97 | 2018年8月27日 | 13.47 | 5,333 | 68,109.86 | 79,835.01 | - |
| 002573 | 清新环境 | 2018年6月19日 | 重大事项停牌 | 11.45 | 2018年10月11日 | 10.31 | 5,669 | 117,677.51 | 64,910.05 | - |
| 002602 | 世纪华通 | 2018年6月12日 | 重大事项停牌 | 32.50 | 2018年11月7日 | 18.23 | 1,800 | 35,010.00 | 58,500.00 | - |
| 002665 | 首航节能 | 2018年5月29日 | 重大事项停牌 | 5.80 | 2018年11月5日 | 5.22 | 9,459 | 89,848.65 | 54,862.20 | - |
| 002630 | 华西能源 | 2018年6月18日 | 重大事项停牌 | 6.54 | 2018年9月19日 | 5.90 | 8,080 | 64,649.15 | 52,843.20 | - |
| 002051 | 中工国际 | 2018年4月9日 | 重大事项停牌 | 15.27 | 2018年9月25日 | 13.74 | 3,331 | 61,474.61 | 50,864.37 | - |
| 002716 | 金贵银业 | 2018年5月3日 | 重大事项停牌 | 9.85 | 2018年8月31日 | 8.87 | 4,593 | 34,419.10 | 45,241.05 | - |
| 002437 | 誉衡药业 | 2018年6月11日 | 重大事项停牌 | 6.19 | 2018年8月13日 | 5.57 | 7,019 | 69,284.64 | 43,447.61 | - |
| 002263 | *ST东南 | 2018年2月26日 | 重大事项停牌 | 2.96 | 2018年8月28日 | 2.81 | 14,318 | 62,781.64 | 42,381.28 | - |
| 002147 | 新光圆成 | 2018年1月18日 | 重大事项停牌 | 14.76 | 2018年11月1日 | 13.28 | 2,500 | 29,788.46 | 36,900.00 | - |
| 002477 | 雏鹰农牧 | 2018年6月14日 | 重大事项停牌 | 3.29 | 2018年9月13日 | 2.96 | 10,185 | 57,078.56 | 33,508.65 | - |
| 002431 | 棕榈股份 | 2018年5月30日 | 重大事项停牌 | 6.71 | 2018年8月30日 | 6.04 | 4,983 | 49,864.24 | 33,435.93 | - |
| 002512 | 达华智能 | 2018年6月19日 | 重大事项停牌 | 9.66 | 2018年11月19日 | 8.69 | 3,200 | 51,232.00 | 30,912.00 | - |
| 002436 | 兴森科技 | 2018年6月14日 | 重大事项停牌 | 4.29 | 2018年9月20日 | 3.86 | 7,021 | 53,734.34 | 30,120.09 | - |
| 002102 | 冠福股份 | 2018年6月1日 | 重大事项停牌 | 4.02 | 2018年8月30日 | 3.62 | 7,100 | 32,442.74 | 28,542.00 | - |
| 002502 | 骅威文化 | 2018年6月5日 | 重大事项停牌 | 5.77 | 2018年11月22日 | 5.19 | 3,501 | 42,450.44 | 20,200.77 | - |
| 002011 | 盾安环境 | 2018年5月2日 | 重大事项停牌 | 6.40 | 2018年10月8日 | 5.76 | 2,800 | 22,073.94 | 17,920.00 | - |
| 002610 | 爱康科技 | 2018年6月5日 | 重大事项停牌 | 2.10 | 2018年10月8日 | 1.89 | 900 | 2,899.91 | 1,890.00 | - |

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年8月12日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无质押债券。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年08月12日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无质押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2其他事项

(1)公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、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。

各层次金融工具公允价值

于2018年8月12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14,520,991.27元,划分为第二层次的余额为人民币1,375,422.54元,无划分为第三层次的余额。于2017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20,580,018.80元,划分为第二层次的余额为人民币960,677.16元,无划分为第三层次的余额。

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和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

（2）截至资产负债表日,本基金的资产净值为人民币16,972,171.66元,已连续超过20个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。

(3)除上述事项外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 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 | 14,045,692.97 | 92.74 |
| | 其中:股票 | 14,045,692.97 | 92.74 |
| 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 | 1,071,887.31 | 7.08 |
| 8 | 其他各项资产 | 27,879.84 | 0.18 |
| 9 | 合计 | 15,145,460.12 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 213,366.00 | 1.44 |
| B | 采矿业 | 571,787.00 | 3.85 |
| C | 制造业 | 6,480,926.32 | 43.61 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 253,344.00 | 1.70 |
| E | 建筑业 | 216,612.00 | 1.46 |
| F | 批发和零售业 | 469,031.00 | 3.16 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 279,909.00 | 1.88 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 705,609.00 | 4.75 |
| J | 金融业 | 272,642.00 | 1.83 |
| K | 房地产业 | 487,744.00 | 3.28 |
| L | 租赁和商务服务业 | 424,260.00 | 2.85 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 221,645.00 | 1.49 |
| 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 | 516,928.00 | 3.48 |
| S | 综合 | 196,539.00 | 1.32 |
| | 合计 | 11,310,342.32 | 76.11 |

8.2.2 期末积极投资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 | 67,384.00 | 0.45 |
| C | 制造业 | 2,006,285.65 | 13.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 34,600.00 | 0.23 |
| F | 批发和零售业 | 96,568.00 | 0.65 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 176,877.00 | 1.19 |
| 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 | 107,588.00 | 0.72 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 67,590.00 | 0.45 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 141,226.00 | 0.95 |
| 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 | 37,232.00 | 0.25 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,735,350.65 | 18.41 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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

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 | 601928 | 凤凰传媒 | 35,200 | 279,488.00 | 1.88 |
| 2 | 000975 | 银泰资源 | 27,200 | 277,168.00 | 1.87 |
| 3 | 000656 | 金科股份 | 43,200 | 267,408.00 | 1.80 |
| 4 | 600161 | 天坛生物 | 12,300 | 261,375.00 | 1.76 |
| 5 | 601016 | 节能风电 | 109,200 | 253,344.00 | 1.70 |
| 6 | 002242 | 九阳股份 | 15,800 | 252,958.00 | 1.70 |
| 7 | 000049 | 德赛电池 | 8,600 | 246,648.00 | 1.66 |
| 8 | 600160 | 巨化股份 | 37,000 | 245,310.00 | 1.65 |
| 9 | 300133 | 华策影视 | 26,500 | 237,440.00 | 1.60 |
| 10 | 600312 | 平高电气 | 28,700 | 231,896.00 | 1.56 |

8.3.2 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五名股票投资明细

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 | 603043 | 广州酒家 | 1,500 | 40,620.00 | 0.27 |
| 2 | 600305 | 恒顺醋业 | 3,800 | 39,520.00 | 0.27 |
| 3 | 603338 | 浙江鼎力 | 700 | 39,424.00 | 0.27 |
| 4 | 603985 | 恒润股份 | 1,900 | 39,330.00 | 0.26 |
| 5 | 603606 | 东方电缆 | 4,305 | 38,443.65 | 0.26 |
| 6 | 000301 | 东方盛虹 | 7,000 | 38,220.00 | 0.26 |
| 7 | 300673 | 佩蒂股份 | 900 | 38,070.00 | 0.26 |
| 8 | 300391 | 康跃科技 | 3,900 | 37,908.00 | 0.26 |
| 9 | 603313 | 梦百合 | 1,800 | 37,818.00 | 0.25 |
| 10 | 300725 | 药石科技 | 700 | 37,681.00 | 0.25 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600673 | 东阳光科 | 485,192.00 | 3.26 |
| 2 | 000528 | 柳　工 | 472,521.00 | 3.18 |
| 3 | 600056 | 中国医药 | 451,015.50 | 3.03 |
| 4 | 600563 | 法拉电子 | 445,996.00 | 3.00 |
| 5 | 002191 | 劲嘉股份 | 439,297.00 | 2.96 |
| 6 | 600694 | 大商股份 | 422,770.00 | 2.84 |
| 7 | 601689 | 拓普集团 | 391,994.00 | 2.64 |
| 8 | 002410 | 广联达 | 319,001.00 | 2.15 |
| 9 | 601128 | 常熟银行 | 298,851.00 | 2.01 |
| 10 | 002463 | 沪电股份 | 298,745.00 | 2.01 |
| 11 | 600808 | 马钢股份 | 295,744.00 | 1.99 |
| 12 | 600760 | 中航沈飞 | 295,580.00 | 1.99 |
| 13 | 601717 | 郑煤机 | 287,839.00 | 1.94 |
| 14 | 601233 | 桐昆股份 | 280,815.00 | 1.89 |
| 15 | 601016 | 节能风电 | 277,368.00 | 1.87 |
| 16 | 000062 | 深圳华强 | 273,178.00 | 1.84 |
| 17 | 600633 | 浙数文化 | 271,004.00 | 1.82 |
| 18 | 600161 | 天坛生物 | 270,716.00 | 1.82 |
| 19 | 300058 | 蓝色光标 | 268,940.00 | 1.81 |
| 20 | 002028 | 思源电气 | 264,370.00 | 1.78 |

注:买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600673 | 东阳光科 | 509,162.00 | 3.43 |
| 2 | 600563 | 法拉电子 | 449,362.00 | 3.02 |
| 3 | 600808 | 马钢股份 | 435,485.00 | 2.93 |
| 4 | 002191 | 劲嘉股份 | 429,114.00 | 2.89 |
| 5 | 600282 | 南钢股份 | 364,683.00 | 2.45 |
| 6 | 601128 | 常熟银行 | 336,718.00 | 2.27 |
| 7 | 002463 | 沪电股份 | 319,082.00 | 2.15 |
| 8 | 002110 | 三钢闽光 | 315,380.00 | 2.12 |
| 9 | 600064 | 南京高科 | 279,357.00 | 1.88 |
| 10 | 002410 | 广联达 | 275,041.00 | 1.85 |
| 11 | 600633 | 浙数文化 | 273,292.00 | 1.84 |
| 12 | 601717 | 郑煤机 | 262,479.00 | 1.77 |
| 13 | 002028 | 思源电气 | 259,530.00 | 1.75 |
| 14 | 002332 | 仙琚制药 | 257,328.00 | 1.73 |
| 15 | 600757 | 长江传媒 | 256,711.00 | 1.73 |
| 16 | 600422 | 昆药集团 | 243,421.00 | 1.64 |
| 17 | 603228 | 景旺电子 | 241,771.00 | 1.63 |
| 18 | 600611 | 大众交通 | 237,382.00 | 1.60 |
| 19 | 600179 | 安通控股 | 234,084.00 | 1.58 |
| 20 | 000860 | 顺鑫农业 | 232,415.00 | 1.56 |

注:卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 32,274,201.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 31,266,411.51 |

注:买入股票成本和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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资股指期货,本期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,本期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.12.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 10,547.02 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 254.10 |
| 5 | 应收申购款 | 17,078.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 27,879.84 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 投资组合报告（转型前）

9.1 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 | 15,896,413.81 | 66.74 |
| | 其中:股票 | 15,896,413.81 | 66.74 |
| 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 | 1,304,776.23 | 5.48 |
| 8 | 其他资产 | 6,618,002.41 | 27.78 |
| 9 | 合计 | 23,819,192.45 | 100.00 |

9.2 期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 期末指数投资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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 33,508.65 | 0.20 |
| B | 采矿业 | 157,538.24 | 0.93 |
| C | 制造业 | 2,380,125.43 | 14.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 164,135.31 | 0.97 |
| F | 批发和零售业 | 42,168.00 | 0.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 752.94 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 303,838.25 | 1.79 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 208,270.00 | 1.23 |
| L | 租赁和商务服务业 | 307,663.00 | 1.81 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 64,910.05 | 0.38 |
| 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 | 142,811.37 | 0.84 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,805,721.24 | 22.42 |

9.2.1 9.2.2 期末积极投资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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 42,968.00 | 0.25 |
| B | 采掘业 | 330,770.00 | 1.95 |
| C | 制造业 | 6,931,428.80 | 40.84 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 660,606.00 | 3.89 |
| E | 建筑业 | 82,509.00 | 0.49 |
| F | 批发和零售业 | 747,534.00 | 4.40 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 536,899.00 | 3.16 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 655,556.00 | 3.86 |
| J | 金融业 | 496,985.00 | 2.93 |
| K | 房地产业 | 794,408.00 | 4.68 |
| L | 租赁和商务服务业 | 209,470.00 | 1.23 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 165,788.00 | 0.98 |
| 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 | 435,770.77 | 2.57 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 12,090,692.57 | 71.24 |

9.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

9.3.1 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

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 | 002450 | 康得新 | 15,073.00 | 257,446.84 | 1.52 |
| 2 | 002503 | 搜于特 | 76,204.00 | 256,045.44 | 1.51 |
| 3 | 002110 | 三钢闽光 | 10,900.00 | 217,782.00 | 1.28 |
| 4 | 002701 | 奥瑞金 | 38,943.00 | 214,186.50 | 1.26 |
| 5 | 002233 | 塔牌集团 | 15,400.00 | 208,516.00 | 1.23 |
| 6 | 002244 | 滨江集团 | 34,274.00 | 171,370.00 | 1.01 |
| 7 | 002180 | 纳思达 | 5,600.00 | 166,768.00 | 0.98 |
| 8 | 002075 | 沙钢股份 | 7,800.00 | 166,218.00 | 0.98 |
| 9 | 002517 | 恺英网络 | 28,600.00 | 166,166.00 | 0.98 |
| 10 | 002818 | 富森美 | 6,500.00 | 162,955.00 | 0.96 |

9.3.2 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

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 | 600578 | 京能电力 | 65,700.00 | 212,868.00 | 1.25 |
| 2 | 000519 | 中兵红箭 | 26,400.00 | 211,200.00 | 1.24 |
| 3 | 603025 | 大豪科技 | 10,800.00 | 206,604.00 | 1.22 |
| 4 | 000078 | 海王生物 | 48,800.00 | 206,424.00 | 1.22 |
| 5 | 600801 | 华新水泥 | 9,600.00 | 205,824.00 | 1.21 |
| 6 | 601016 | 节能风电 | 68,300.00 | 204,900.00 | 1.21 |
| 7 | 601717 | 郑煤机 | 34,100.00 | 203,577.00 | 1.20 |
| 8 | 000006 | 深振业A | 29,200.00 | 169,068.00 | 1.00 |
| 9 | 603225 | 新凤鸣 | 7,600.00 | 168,416.00 | 0.99 |
| 10 | 600179 | 安通控股 | 17,000.00 | 168,130.00 | 0.99 |

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年度报告正文。

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 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 | 002035 | 华帝股份 | 1,365,854.00 | 5.81 |
| 2 | 002027 | 分众传媒 | 1,190,408.00 | 5.06 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 960,043.00 | 4.08 |
| 4 | 002236 | 大华股份 | 750,474.00 | 3.19 |
| 5 | 002572 | 索菲亚 | 727,951.00 | 3.10 |
| 6 | 002008 | 大族激光 | 720,857.00 | 3.07 |
| 7 | 002399 | 海普瑞 | 714,047.00 | 3.04 |
| 8 | 002110 | 三钢闽光 | 621,969.00 | 2.64 |
| 9 | 002032 | 苏 泊 尔 | 568,702.05 | 2.42 |
| 10 | 002384 | 东山精密 | 566,030.00 | 2.41 |
| 11