安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2019年07月18日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信优势增长混合
基金主代码	001287
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年05月20日
报告期末基金份额总额	63,325,591.73份
投资目标	本基金将以严谨细致的逻辑和基本面分析为基础,通过自上而下和自下而上结合,把握经济转型发展期具有较高增长潜力的上市公司的投资机会,力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	资产配置方面,通过对基本面数据的分析和逻辑梳理,分析比较大类资产的风险收益比,主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例;股票投资方面,主要从行业配置和个股精选两个层面进行投资;固定收益类投资方面,根据宏观数据和市场交易情况,合理判断未来利率期限结构和中长期收益率变化趋势,构建固定收益类债券投资组合;此外,本基金还采用股指期货投资策略、权证投资策略、低风险套利型投资策略等衍生品投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	安信优势增长混合A	安信优势增长混合C
下属分级基金的交易代码	001287	002036
报告期末下属分级基金的份额总额	50,654,604.68份	12,670,987.06份

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

	安信优势增长混合A	安信优势增长混合C
1.本期已实现收益	3,947,746.63	604,812.42
2.本期利润	-1,026,974.09	405,522.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0227	0.0775
4.期末基金资产净值	80,650,521.38	20,058,591.52
5.期末基金份额净值	1.5922	1.583

注:1.所述基金业绩指标不包括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;

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。

3.2 基金净值表现

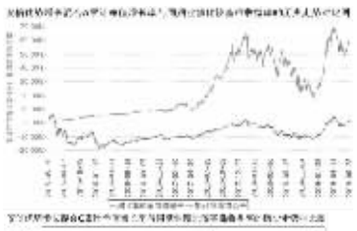
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信优势增长混合A						
阶段	净值增长率①	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	-1.45%	1.52%	-0.11%	0.75%	-1.34%	0.77%

安信优势增长混合C

阶段	净值增长率①	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	-1.50%	1.53%	-0.11%	0.75%	-1.39%	0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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.本基金基金合同生效日为2015年5月20日,本基金自2015年11月17日起增加C类份额。

2.本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
聂世林	本基金的基金经理	2016年2月18日	-	11.0年	聂世林先生,经济学硕士。历任安信证券股份有限公司资产管理部研究员、证券投资部研究员,安信基金管理有限责任公司研究部、权益投资部基金经理助理,现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合混合型证券投资基金的基金经理助理;现任安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合混合型证券投资基金的基金经理。

注:1.此处的"任职日期"、"离任日期"根据公司决定的公告(生效)日期填写。

2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《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,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度流动性层面稍有所收紧,包商银行的接管对于信贷市场构成较大冲击;华为被美列入实体名单,关键零部件遭到禁运,5G产业链相关公司的预期被破坏;招行、浦发等也接到美国的传票。各种外部风险事件接连爆发,这对于市场偏好构成一定负面冲击。从国内经济来看,多数宏观经济指标持续走弱(发电量、货运量、柴油消费量等),地产销售增速回落,基建投资有所企稳;汽车消费受排放标准升级以及基数原因,增速下滑明显;其他可选消费类消费品都面临较大压力,企业的盈利增速仍还未探明底部。

由于企业盈利依然处于下滑过程,中小企业的盈利压力更大,白马龙头的经营抗风险能力相对要强。本基金坚持自下而上选股,着重考察企业竞争优势,行业竞争格局,管理层的专注敬业以及估值等核心要素。行业配置方面,我们继续看好估值合理,竞争优势持续扩大的消费类龙头企业;地产产业链后周期受益于竣工回升,成交回暖,业绩可能会率先看到回升。此外,新能源汽车虽然短期受补贴退坡影响,但长期逻辑未改变;5G产业链确定性受益于未来2-3年的高强度投资建设。

从资金角度看,海外的主动和被动配置资金流入非常明确,龙头白马的估值已经修复到相对合理区间。如果资金的配置集中度进一步提升,需要提防估值泡沫的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金A类基金份额净值为1.5922元,本报告期基金份额净值增长率为-1.45%;截至本报告期末本基金C类基金份额净值为1.5830元,本报告期基金份额净值增长率为-1.50%;同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	91,342,369.42	90.18
	其中:股票	91,342,369.42	90.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,999.68	0.02
	其中:债券	23,999.68	0.02
	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	9,382,095.48	9.26
8	其他资产	545,475.00	0.54
9	合计	101,293,939.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	9,712,415.30	9.64
B	采矿业	60,105.05	0.06
C	制造业	48,755,796.10	48.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,992,120.00	3.96
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,469,112.00	8.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,541,540.00	1.53
H	住宿和餐饮业	4,078,910.00	4.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	549,083.76	0.55
J	金融业	4,853,941.61	4.82
K	房地产业	6,664,942.00	6.62
L	租赁和商务服务业	2,641,297.00	2.62
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	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	91,342,369.42	90.70

5.2.2 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。

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

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	601933	永辉超市	707,600	7,224,596.00	7.17
2	300498	温氏股份	147,400	5,285,764.00	5.25
3	600323	瀚蓝环境	236,500	3,992,120.00	3.96
4	002304	洋河股份	31,200	3,792,672.00	3.77
5	002311	海大集团	121,600	3,757,440.00	3.73
6	600519	贵州茅台	3,700	3,640,800.00	3.62
7	002415	海康威视	126,200	3,480,596.00	3.46
8	000651	格力电器	58,900	3,239,500.00	3.22
9	000333	美的集团	56,900	2,950,834.00	2.93
10	002027	分众传媒	499,300	2,641,297.00	2.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	23,999.68	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,999.68	0.02

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113028	环境转债	240	23,999.68	0.02

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资,以风险对冲、套期保值为主要目的,以控制股票投资组合的系统性风险。套期保值主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,结合股指期货的估值定价模型,与需要作风险对冲的股票现货资产进行匹配,在投资授权审批流程完成后进行股指期货套期保值投资,实现基金资产增值保值。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	128,425.62
2	应收证券清算款	229,112.83
3	应收股利	-
4	应收利息	5,028.15
5	应收申购款	183,908.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	545,475.00

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信优势增长混合A	安信优势增长混合C
报告期期初基金份额总额	34,147,256.41	3,870,714.31
报告期期间基金总申购份额	31,538,729.18	13,935,662.29
减:报告期期间基金总赎回份额	15,031,380.91	5,135,389.55
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	50,654,604.68	12,670,987.05

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话:4008-088-088

网址:http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
2019年07月18日

安信中证500指数增强型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:宁波银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月18日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信中证500指数增强
交易代码	006965
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月29日
报告期末基金份额总额	15,924,460.86份
投资目标	本基金为增强型指数基金,在力求有效跟踪标的指数,控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%的基础上,结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	本基金为增强型指数基金,在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上,通过数量化模型进行投资组合优化,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益,指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重,初步构建投资组合,并按照标的指数的调整规则作出相应调整,量化增强策略主要采用超额收益模型、风险模型和成本模型分别用以评估资产定价、控制风险和降低交易成本。基于模型结果,基金管理人结合市场环境和股票特性,产出投资组合,以追求超越标的指数表现的业绩水平。在股指期货投资方面,将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资。在债券投资方面,采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度,确定组合久期,进而根据各类资产的预期收益率,确定债券资产配置。此外,本基金还将采用资产配置策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等,更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	安信中证500指数增强A	安信中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	005965	005966
报告期末下属分级基金的份额总额	1,137,997.81份	14,786,463.05份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
	安信中证500指数增强A	安信中证500指数增强C
1.本期已实现收益	-67,384.81	-578,088.66
2.本期利润	-76,912.39	-5,430,371.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0672	-0.1633
4.期末基金资产净值	1,309,327.66	16,972,288.81
5.期末基金份额净值	1.1506	1.1478

注:1.所述基金业绩指标不包括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;

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。

3.2 基金净值表现

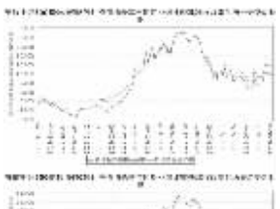
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信中证500指数增强A						
阶段	净值增长率①	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	-7.19%	1.66%	-10.21%	1.72%	3.02%	-0.06%

安信中证500指数增强C

阶段	净值增长率①	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	-7.29%	1.66%	-10.21%	1.72%	2.92%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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.本基金合同生效日为2018年11月29日。截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐婉玮	本基金的基金经理	2018年11月29日	-	12年	徐婉玮先生,理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金的基金经理;现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金的基金经理。

注:1.此处的"任职日期"、"离任日期"根据公司决定的公告(生效)日期填写。

2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《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,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度宏观经济仍处于回落区间,行业景气度多数下行,包商事件对市场情绪有影响,且中美贸易压力有所升温,经济下行压力和美国降息预期继续制约市场对货币政策的期待,货币政策中性偏宽松,市场流动性相对充裕,中美贸易谈判和金融供给侧改革的进展仍需继续观察。

本基金在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上,通过数量化模型进行投资组合优化。主要是运用量化多因子模型,综合评估公司的盈利、企业质量、估值、技术特征、市场趋势、投资者情绪等多个因素,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。建仓期间,根据量化模型逐步建立股票仓位。建仓期结束后,则根据模型定期调整仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金A类份额净值为1.1506元,本报告期基金份额净值增长率为-7.19%;截至本报告期末本基金C类基金份额净值为1.1478元,本报告期基金份额净值增长率为-7.29%;同期业绩比较基准收益率为-10.21%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现了连续20个工作日基金资产净值低于5000万的情形,时间范围为2019年5月7日至2019年6月30日。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,297,153.58	92.59
	其中:股票	17,297,153.58	92.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	600,396.97	3.21
	其中:债券	600,396.97	3.21
	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	574,676.35	3.08
8	其他资产	210,089.79	1.12
9	合计	18,682,315.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(指数投资部分)

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	237,216.00	1.30
B	采矿业	504,772.00	2.76
C	制造业	9,387,539.90	51.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	597,793.20	3.27
E	建筑业	270,023.20	1.48
F	批发和零售业	830,392.00	4.54
G	交通运输、仓储和邮政业	434,674.60	2.38
H	住宿和餐饮业	93,632.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,513,020.70	8.28
J	金融业	704,484.00	3.85
K	房地产业	754,208.80	4.13
L	租赁和商务服务业	184,271.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,937.60	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	41,190.00	0.23
Q	卫生和社会工作	126,506.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	594,101.00	3.25
S	综合	242,242.00	1.33
	合计	16,545,405.00	90.50

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(积极投资部分)

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	29,395.00	0.16
B	采矿业	1,989.00	0.01
C	制造业	549,740.58	3.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	40,984.00	0.22
F	批发和零售业	35,331.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	44,305.00	0.24
K	房地产业	1,206.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	41,088.00	0.22
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	7,710.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	751,748.58	4.11

5.2.2 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。

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

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	002439	启明星辰	4,900	131,810.00	0.72
2	300450	先导智能	3,400	114,240.00	0.62
3	000401	冀东水泥	6,400	112,704.00	0.62
4	002465	海格通信	11,700	111,618.00	0.61
5	002371	北方华创	1,600	110,800.00	0.61
6	300383	光环新网	6,600	110,682.00	0.61
7	002195	二三四五	28,010	108,968.90	0.60
8	600872	中炬高新	2,500	107,075.00	0.59
9	600699	均胜电子	5,000	106,800.00	0.58
10	000997	新大陆	6,300	106,407.00	0.58

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

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	002675	东诚药业	4,700	51,324.00	0.28
2	000063	中兴通讯	1,500	48,795.00	0.27
3	601318	中国平安	500	44,305.00	0.24
4	002398	建研集团	6,400	41,088.00	0.22
5	600170	上海建工	10,900	40,984.00	0.22

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	596,596.00	3.26
	其中:政策性金融债	596,596.00	3.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,799.97	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	600,395.97	3.28

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108901	农发1801	5,960	596,596.00	3.26
2	128068	和而转债	38	3,799.97	0.02

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-417,483.19
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-220,845.71

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的进行国债期货投资,将构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险,实现基金资产保值增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	93,815.86
2	应收证券清算款	95,768.13
3	应收股利	-
4	应收利息	11,086.02
5	应收申购款	9,419.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	210,089.79

5.11.4 报告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