长城久泰沪深300指数证券投资基金

2019年第二季度报告

2019年6月30日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§1 重要提示

本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。

本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07月16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。

本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

基金简称	长城久泰沪深300指数
基金主代码	200002
交易代码	200002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月21日
报告期末基金份额总额	510,897,065.91份
投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数,分享中国经济的长期增长,在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	(1)资产配置策略:本基金为增强型指数基金,股票投资以沪深300指数作为目标指数。在正常情况下,本基金投资于股票的比例为基金净资产的90-95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。(2)股票投资策略:本基金的指数化投资采用分层抽样法,实现对沪深300指数的跟踪,即按照沪深300指数的行业配置比例构建投资组合,投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整,股票投资范围以沪深300指数的成份股为主,少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票,并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3)债券投资策略:本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标,主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险,获取市场平均收益。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	长城久泰沪深300指数A	长城久泰沪深300指数C
下属分级基金的交易代码	200002	006912
下属分级基金的前端交易代码	200002	-
下属分级基金的后端交易代码	201002	-
报告期末下属分级基金的份额总额	508,232,412.14份	2,664,653.77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4月1日-2019年6月30日)	
	长城久泰沪深300指数A	长城久泰沪深300指数C
1. 本期已实现收益	34,198,618.34	200,458.32
2. 本期利润	20,406,834.27	-21,551.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0413	-0.0079
4. 期末基金资产净值	867,861,135.51	4,552,272.85
5. 期末基金份额净值	1.7076	1.7084

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。

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

长城久泰沪深300指数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	2.12%	1.47%	-1.10%	1.45%	3.22%	0.02%

长城久泰沪深300指数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	2.09%	1.47%	-1.10%	1.45%	3.19%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为:本基金投资于股票的比例为基金净资产的90%-95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

§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		
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理,长城久泰、长城品牌、长城核心优势的基金经理	2004年5月21日	-	19年	男,中国籍,北京大学力学系理学学士,北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券股份有限公司投资银行部,2001年10月进入长城基金管理公司,曾任研究部总经理和公司总经理助理,基金经理助理,“长城安心回报混合型证券投资基金”、“长城中小盘成长混合型证券投资基金”、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”、“长城久兆中小板300指数分级证券投资基金”、“长城中证500指数增强型证券投资基金”和“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”的基金经理。
雷俊	量化与指数投资部总经理,长城中证500指数增强型、长城久泰沪深300指数、长城创业板指数、长城核心优选混合、长城量化精选股票的基金经理	2018年11月30日	-	11年	北京大学理学学士、工学硕士。曾就职于南方基金管理有限公司,2017年11月进入长城基金管理有限公司,现任量化与指数投资部总经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久泰沪深300 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在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

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《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与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的5%的现象。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,A股市场窄幅震荡,但随着年报等信息的逐步披露市场关注点聚焦上市公司基本面,报告期内价值股回归,相对超额收益业绩表现出色,本基金产品运作坚持指数价值增强的投资风格,获取价值回归与业绩驱动下的长期超额回报。

本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果,采用量化多因子模型,基于上市公司的历史数据,借助数量化的技术手段,寻找对股票收益有预测性的指标作为因子;在组合层面上,根据基准指数的特点严格控制行业偏离以及个股偏离,并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化,力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城久泰A级份额净值为1.7076,净值增长率为2.12%;长城久泰C级基金份额净值为1.7084,净值增长率为2.09%;同期业绩比较基准收益率为-1.10%。

4.6 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,本基金无需要说明的情况。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	827,045,574.32	94.61
	其中:股票	827,045,574.32	94.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,974,400.00	3.66
	其中:债券	31,974,400.00	3.66
	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	14,206,096.70	1.63
8	其他资产	911,978.66	0.10
9	合计	874,138,049.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1 报告期末按申万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	1,178,148.64	0.14
B	采矿业	2,079,503.65	0.24
C	制造业	236,924,871.34	27.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,928,996.39	2.86
E	建筑业	21,003,914.61	2.41
F	批发和零售业	20,885,940.75	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	17,077,390.82	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,462,846.10	2.12
J	金融业	305,237,718.04	34.99
K	房地产业	34,787,847.44	3.99
L	租赁和商务服务业	10,476,020.23	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,207.45	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,252.18	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,997,003.20	0.23
S	综合	-	-
	合计	695,048,659.84	79.67

5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	11,048,958.85	1.27
C	制造业	76,674,045.90	8.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,243,348.96	0.37
E	建筑业	3,493,477.19	0.40
F	批发和零售业	3,585,236.72	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	10,846,273.08	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,545,935.76	0.41
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	8,591,131.64	0.98
L	租赁和商务服务业	1,001.25	0.00
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	7,303,010.19	0.84
S	综合	3,630,625.00	0.42
	合计	131,996,914.48	15.13

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

5.3.1 报告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

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	601318	中国平安	767,546	68,012,251.06	7.80
2	600519	贵州茅台	66,630	65,563,920.00	7.52
3	601166	兴业银行	1,658,547	30,334,824.63	3.48
4	000333	美的集团	582,058	30,185,527.88	3.46
5	600036	招商银行	660,912	23,779,613.76	2.73
6	000858	五粮液	191,552	22,593,558.40	2.59
7	601328	交通银行	3,660,492	22,402,211.04	2.57
8	601398	工商银行	2,871,215	16,911,456.35	1.94
9	600000	浦发银行	1,423,252	16,623,583.36	1.91
10	600837	海通证券	1,148,087	16,291,354.53	1.87

5.3.2 报告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

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	300014	亿纬锂能	152,000	4,629,920.00	0.53
2	000999	华润三九	138,400	4,060,656.00	0.47
3	601100	恒立液压	126,274	3,962,478.12	0.45
4	002092	中泰化学	480,400	3,823,984.00	0.44
5	002128	露天煤业	440,644	3,811,570.60	0.44

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	31,974,400.00	3.67
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,974,400.00	3.67

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	019611	19国债01	320,000	31,974,400.00	3.67
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

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、信息披露方式等,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

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

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除交通银行和浦发银行外,其他证券的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。

根据中国银行保险监督管理委员会(简称银保监会)于2018年12月7日公布的行政处罚信息公开表,交通银行股份有限公司(简称交通银行)因内控管理不严、违规经营等案由,于2018年11月9日被中国银保监会处以罚款。

根据中国人民银行公布的行政处罚公示:

交通银行股份有限公司(简称交通银行)因反洗钱相关违法行为,于2018年7月26日被中国人民银行处以罚款。

上海浦东发展银行股份有限公司(简称浦发银行)因反洗钱相关违法行为,于2018年7月26日被中国人民银行处以罚款。

本基金经理分析认为,长城久泰基金是一只采取指数复制策略为主的增强指数基金,复制标的指数的成分股及其权重、控制跟踪误差是本基金运作的主要目标,上述事项不影响本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度对交通银行和浦发银行进行投资。

5.11.2 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

本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	276,656.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	337,198.87
5	应收申购款	298,122.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	911,978.66

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五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

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长城久泰沪深300指数A	长城久泰沪深300指数C
报告期期初基金份额总额	497,394,248.82	2,190,316.10
报告期期间基金总申购份额	49,802,305.67	3,227,104.56
减:报告期期间基金总赎回份额	38,964,142.35	2,752,766.89
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	508,232,412.14	2,664,653.77

§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

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期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

注:本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准长城久泰沪深300指数证券投资基金设立的文件
2.《长城久泰沪深300 指数证券投资基金基金合同》
3.《长城久泰沪深300 指数证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件 营业执照
6. 基金托管人业务资格批件 营业执照
7. 中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅,如有疑问,可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话:0755-23982338
客户服务电话:400-8868-666
网站:www.ccfund.com.cn

长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

2019年6月30日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§1 重要提示

本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。

本基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月16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。

本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

基金简称	长城久富混合(LOF)
场内简称	长城久富
基金主代码	162006
交易代码	162006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年2月12日
报告期末基金份额总额	626,950,200.35份
投资目标	投资于具有核心竞争力的企业,分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益,力争为基金持有人实现稳定的超额回报。
投资策略	本基金投资的核心策略是“自下而上、精选个股”,同时根据市场偏好适度配置主题类资产以保持组合的均衡性。精选原则侧重承基企久富以往富有成效的核心企业评价体系,以“具备核心竞争力,能够在市场中获取超额收益的企业”为主,构建均衡的投资组合。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金,但低于股票基金。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-12,247,462.64
2.本期利润	-46,071,840.35
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0729
4.期末基金资产净值	655,696,039.61
5.期末基金份额净值	1.0459

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。

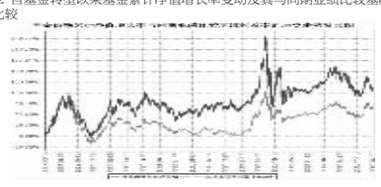
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

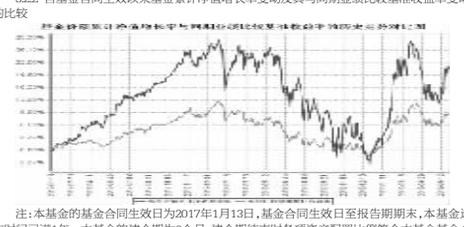
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.58%	1.51%	-0.61%	1.14%	-5.97%	0.37%

3.2.2 自基金转型以来基金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:本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率(税后)×60%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的基金合同生效日为2017年1月13日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间已满1年。本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为2017年1月13日至2019年6月30日。

§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		
陈良栋	长城久鼎保本、长城新兴产业混合、长城久祥混合、长城久富混合的基金经理	2018年12月28日	-	8年	男,中国籍,清华大学工学与经济学双学士、清华大学工学硕士。2011年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理助理,“长城保本混合型证券投资基金”、“长城久益保本混合型证券投资基金”、“长城久祥保本混合型证券投资基金”、“长城久安保本混合型证券投资基金”的基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在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

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《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与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的5%的现象。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4月中上旬市场在对中国宏观经济和中美贸易战的乐观预期中,延续一季度的上涨,而4月底到6月初,中美贸易摩擦再次升级超出市场预期,社融和PM1等宏观数据低预期,以及包商银行信用风险事件影响,导致市场重新担忧宏观经济下行风险,风险偏好快速下降。6月中下旬,随着国家宏观经济逆周期调节政策推出,以及中美贸易战有所转机,市场反弹。二季度市场严重分化,沪深300指数下跌1.2%,而创业板指数下跌10.8%,食品饮料、家电、银行行业指数分别上涨13.0%、3.5%、2.9%,而传媒、轻工制造、纺织服装行业指数分别下跌15.8%、13.7%、11.7%。本基金继续保持中性偏高的仓位,加大了大消费行业配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-6.58%,业绩比较基准收益率为-0.61%。

4.6 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,本基金无需要说明的情况。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	541,628,175.02	81.59
	其中:股票	541,628,175.02	81.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,013,200.00	6.63
	其中:债券	44,013,200.00	6.63
	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	50,000,000.00	7.53
	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	19,881,871.82	2.99
8	其他资产	8,314,614.00	1.25
9	合计	663,837,860.84	100.00

5.2 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	49,364,903.34	7.53
B	采矿业	12,341,266.25	1.88
C	制造业	266,690,315.63	40.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,709,221.00	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	2,730,000.00	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,523,161.94	13.04
J	金融业	58,354,332.22	8.90
K	房地产业	18,684,468.00	2.85
L	租赁和商务服务业	11,994,345.00	1.83
M	科学研究和技术服务业	10,309,955.04	1.57
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	926,206.60	0.14
S	综合	-	-
	合计	541,628,175.02	82.60

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	600984	建设机械	4,933,760	32,316,128.00	4.93
2	300498	温氏股份	772,454	27,700,200.44	4.22
3	300078	思创医惠	2,540,578	25,939,301.38	3.96
4	601933	永辉超市	2,420,100	24,709,221.00	3.77
5	000568	泸州老窖	304,700	24,628,901.00	3.76
6	300349	金卡智能	1,353,271	24,061,158.38	3.67
7	603589	口子窖	365,147	23,522,769.74	3.59
8	002402	和而泰	2,338,600	22,146,542.00	3.38
9	002714	牧原股份	368,510	21,664,702.90	3.30
10	000651	格力电器	350,500	19,277,500.00	2.94

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	44,013,200.00	6.71
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,013,200.00	6.71

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	019544	16国债16	440,000	44,013,200.00	6.71
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注: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。

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

注: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。

5.10.2 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,期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

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除建设机械发行主体外,其他证券的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。

根据上海证券交易所公布的纪律处分决定书:陕西建设机械股份有限公司(简称建设机械)因信息披露相关违规情形,于2019年4月10日被上海证券交易所予以通报批评。

本基金管理小组分析认为,相关违规事项已经调查完毕,行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小,对于公司的未来财务并无重大影响。本基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对股票(600984)建设机械进行了投资。

5.11.2 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

本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	784,295.35
2	应收证券清算款	6,523,348.02
3	应收股利	-
4	应收利息	996,201.82
5	应收申购款	10,768.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,314,614.00

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注: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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	650,074,616.67
报告期期间基金总申购份额	4,826,907.81
减:报告期期间基金总赎回份额	27,951,324.13
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	626,950,200.35

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,702,120.00
报告期期间买入/申购总份额	-