(上接B281版)

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2)其他金融工具的公允价值 (年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§1 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

报告截止日：2019年5月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年5月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：		
银行存款	1,677,148.01	1,428,247.37
结算备付金	-	-
存出保证金	329.88	1,112.04
交易性金融资产	7,573,278.97	10,627,027.79
其中：股票投资	7,573,278.97	10,627,027.79
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	2,966,027.36	-
应收利息	5,716.43	282.82
应收股利	-	-
应收申购款	-	8,428.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,222,500.65	12,065,098.42
负债和所有者权益	**本期末 2019年5月30日**	**上年度末 2018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	20,616.25	-
应付管理人报酬	10,255.58	10,642.91
应付托管费	2,051.12	2,128.59
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,765.38	9,603.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	47,402.24	85,000.00
负债合计	83,090.57	107,374.50
所有者权益：		
实收基金	15,559,159.42	16,508,595.03
未分配利润	-3,419,749.34	-4,550,871.11
所有者权益合计	12,139,410.08	11,957,723.92
负债和所有者权益总计	12,222,500.65	12,065,098.42

注：报告截止日2019年5月30日，基金份额净值0.990元，基金份额总额12,256,031.65份。

6.2 利润表

会计主体：诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年5月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	900,760.75	-4,111,230.55
1.利息收入	7,932.21	6,419.51
其中：存款利息收入	7,932.21	6,419.51
债券利息收入	-	-
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)	-737,634.59	-2,274,931.39
其中：股票投资收益	-805,279.93	-2,368,172.44
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	67,645.34	93,241.05
3. 公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	1,602,284.38	-1,845,771.90
4. 汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	28,178.75	3,053.23
减：二、费用	250,436.89	329,886.27
1.管理人报酬	57,596.99	96,132.13
2.托管费	11,519.38	19,226.40
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,778.78	26,191.74
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	173,541.74	188,336.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	650,323.86	-4,441,116.82
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	650,323.86	-4,441,116.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5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）	16,508,595.03	-4,550,871.11	11,957,723.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	650,323.86	650,323.86
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）	-949,435.61	480,797.91	-468,637.70
其中：1.基金申购款	24,588,629.29	-2,406,296.28	22,182,333.01
2.基金赎回款	-25,538,064.90	2,887,094.19	-22,650,970.71
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	15,559,159.42	-3,419,749.34	12,139,410.08
项目	**上年度可比期间 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）	16,117,298.80	4,453,849.28	20,571,148.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,441,116.82	-4,441,116.82
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）	20,848.58	67,323.39	88,171.97
其中：1.基金申购款	2,466,570.54	570,639.88	3,037,210.42
2.基金赎回款	-2,445,721.96	-503,316.49	-2,949,038.45
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	16,138,147.38	80,055.85	16,218,203.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____奥成文_____ _____薛有为_____ _____薛有为____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《关于核准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可〔2011〕1705号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2012年3月29日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为1,209,176,634.92份基金份额，其中认购资金利息折合918,652.82份基金份额 。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称"诺安创业成长份额")、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称"诺安稳健份额"）与诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额（以下简称"诺安进取份额"）。其中，诺安稳健份额、诺安进取份额的基金份额配比始终保持4:6 的比例不变。

在诺安稳健份额、诺安创业成长份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照基金合同的规则进行基金的定期份额折算。诺安稳健份额和诺安进取份额按照基金合同进行参考净值计算，对诺安稳健份额的应得收益进行定期份额折算，每10份诺安创业成长份额将按4份诺安稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。对于诺安稳健份额期末的约定应得收益，即诺安稳定份额每个会计年度12月31日份额参考净值超出1.000元部分，将折算为场内诺安创业成长份额分配给诺安稳健份额持有人。诺安创业成长份额持有人持有的每10份诺安创业成长份额将按4份诺安稳健份额获得新增诺安创业成长份额的分配。持有场外诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外诺安创业成长份额的分配；持有场内诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内诺安创业成长份额的分配。经过上述份额折算，诺安稳健份额和诺安创业成长份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对诺安稳健份额和诺安创业成长份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当诺安创业成长份额的基金份额净值达到2.000元；当诺安进取份额的基金份额参考净值达到0.250 元。当诺安创业成长份额的基金份额净值达到2.000元后，本基金将分别对诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额的基金份额净值均调整为4:6，份额折算后诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额的基金份额净值均调整为1 元。当诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺安稳健份额和诺安进取份额的比例为4:6，份额折算后诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额净值均调整为1 元。

基金合同生效后，诺安创业成长份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。诺安稳健份额与诺安进取份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》和《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证创业成长指数成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%-100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证创业成长指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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；权证投资占基金资产净值的比例为0-3% 。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金于2019年5月31日起转型为诺安创业板指数增强型证券投资基金。

本基金的财务报表于2019年8月22日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称"财政部"）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2019年5月30日(基金合同失效前日)的财务状况、自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税〔2015〕101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2005] 103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008] 16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、直销机构
中国银行股份有限公司	托管人

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间内及其上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间内及其上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间内及其上年度可比期间内均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,596.99	96,132.13
其中：支付销售机构的客户维护费	15,866.96	26,879.69

注：本基金的管理费率为年费率1.0%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.0%÷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

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,519.38	19,226.40

注：本基金的托管费率为年费率0.2% 。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.9.4.2 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

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.9.5 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 2019年1月1日至2019年5月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,677,148.01	7,840.52	1,596,232.06	6,293.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.10 期末（2019年5月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2019年5月30日(基金合同失效前日)止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 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
002323	*ST百特	2018年8月17日	重大事项	1.31	-	-	4,816	51,503.91	6,308.96	-

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

于2019年5月30日(基金合同失效前日)，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

于2019年5月30日(基金合同失效前日)，基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2019年5月30日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为7,566,970.01元，属于第二层次的余额为6,308.96元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次10,620,718.83 元，第二层次6,308.96元，无属于第三层次的余额)。

自2019年1月1日至2019年5月30日(基金合同失效前日)止期间，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年5月30日(基金合同失效前日)，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2018年12月31日：无）。

(2)其他金融工具的公允价值 (年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§6 投资组合报告（转型后）

6.1 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	1,927,854.07	9.95
	其中：股票	1,927,854.07	9.95
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	17,339,041.61	89.52
8	其他各项资产	102,085.41	0.53
9	合计	19,368,981.09	100.00

6.2 期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,654,720.11	9.17
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	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	266,825.00	1.48
S	综合	-	-
	合计	1,921,545.11	10.65

6.2.2 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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,308.96	0.03
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,308.96	0.03

6.3 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

1.1.1 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	300136	信维通信	17,206	420,686.70	2.33
2	300450	先导智能	9,715	326,424.00	1.81
3	300413	芒果超媒	6,500	266,825.00	1.48
4	300285	国瓷材料	15,000	255,150.00	1.41
5	300296	利亚德	32,107	251,397.81	1.39
6	300316	晶盛机电	13,800	175,122.00	0.97
7	300747	锐科激光	900	126,009.00	0.70
8	300308	中际旭创	2,940	99,930.60	0.55

6.3.1 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	002323	*ST百特	4,816	6,308.96	0.03

1.1 报告期内股票投资组合的重大变动

6.3.2 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

本基金本报告期未买入股票。

6.3.3 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	300122	智飞生物	427,315.50	2.37
2	300601	康泰生物	341,406.05	1.89
3	002352	顺丰控股	311,842.50	1.73
4	002127	南极电商	297,190.00	1.65
5	002601	龙蟒佰利	195,804.67	1.08
6	002110	三钢闽光	193,830.00	1.07
7	002408	齐翔腾达	162,550.00	0.90
8	002310	东方园林	155,960.00	0.86
9	000040	东旭蓝天	151,200.00	0.84
10	002168	惠程科技	145,083.00	0.80
11	300567	精测电子	143,180.00	0.79
12	002366	台海核电	130,410.00	0.72
13	603707	健友股份	128,060.00	0.71
14	002180	纳思达	122,206.00	0.68
15	300355	蒙草生态	119,606.60	0.66
16	002640	跨境通	115,526.72	0.64
17	300176	派生科技	113,050.00	0.63
18	600621	华鑫股份	112,995.00	0.63
19	000016	深康佳A	107,360.00	0.59
20	002215	诺 普 信	91,845.00	0.51

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

6.3.4 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	-
卖出股票收入(成交)总额	5,769,046.60

注：卖出股票收入按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

6.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

6.6 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。

6.7 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。

6.8 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。

6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.9.1 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投资股指期货。

6.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

6.10.2 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投资国债期货。

6.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

6.11 投资组合报告附注

6.11.1 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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

6.11.2 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，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

6.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,111.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,332.07
5	应收申购款	96,641.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,085.41

6.11.4 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。

6.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.1.1.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

1.1.1.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002323	*ST百特	6,308.96	0.03	重大事项

6.11.6 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。

§1 投资组合报告（转型前）

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	7,573,278.97	61.96
	其中：股票	7,573,278.97	61.96
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	1,677,148.01	13.72
8	其他资产	2,972,073.67	24.32
9	合计	12,222,500.65	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,310,050.93	43.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	150,304.00	1.24
E	建筑业	276,966.44	2.28
F	批发和零售业	116,758.64	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	317,133.00	2.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	162,190.00	1.34
J	金融业	182,953.00	1.51
K	房地产业	28,980.00	0.24
L	租赁和商务服务业	342,980.00	2.83
M	科学研究和技术服务业	103,854.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	231,844.00	1.91
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	342,956.00	2.83
S	综合	-	-
	合计	7,566,970.01	62.33

7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,308.96	0.05