（上接B120版）

6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

§6 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：中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年5月14日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年5月14日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,575,042.01	7,836,618.25
结算备付金		260,152.00	43,978.31
存出保证金		51,487.73	90,324.15
交易性金融资产	6.4.7.2	28,227,501.00	32,797,165.57
其中：股票投资		5,332,447.00	10,361,212.57
基金投资		–	–
债券投资		22,895,054.00	22,435,953.00
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产	6.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	6.4.7.4	–	–
应收证券清算款		–	746,641.02
应收利息	6.4.7.5	244,362.33	414,676.12
应收股利		–	–
应收申购款		9,270.22	160.06
递延所得税资产		–	–
其他资产	6.4.7.6	–	–
资产总计		41,367,815.29	41,929,563.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年5月14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	6.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		1,986,625.63	–
应付赎回款		80,103.96	–
应付管理人报酬		22,263.92	52,899.80
应付托管费		3,710.64	8,816.64
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	6.4.7.7	22,513.74	39,693.98
应交税费		882,713.10	883,526.44
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	6.4.7.8	35,284.71	35,000.00
负债合计		3,033,235.70	1,019,936.86
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	26,321,590.95	32,429,393.72
未分配利润	6.4.7.10	12,013,008.64	8,470,232.90
所有者权益合计		38,334,599.59	40,909,626.62
负债和所有者权益总计		41,367,815.29	41,929,563.48

注1：报告截止日2019年5月14日（转型前最后运作日），基金份额净值为人民币1.0489元，基金份额总额36,546,152.32份。

6.2 利润表

会计主体：中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月14日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年5月14日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		6,963,206.50	-1,090,412.41
1.利息收入		248,211.70	838,542.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	63,651.67	47,776.57
债券利息收入		179,477.29	721,744.56
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		7,082.74	66,021.03
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,913,367.10	-1,660,501.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,969,527.13	-1,741,536.22
基金投资收益		–	–
债券投资收益	6.4.7.13	1,963,839.97	-52,104.16
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	–	–
贵金属投资收益	6.4.7.14	–	–
衍生工具收益	6.4.7.15	–	–
股利收益	6.4.7.16	–	133,138.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	483,987.11	-268,244.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	307,639.59	2,791.00
减：二、费用		525,970.91	1,443,967.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	247,366.35	442,475.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	41,227.69	73,745.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	–	–
4. 交易费用	6.4.7.19	182,117.61	785,041.83
5. 利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6. 税金及附加		235.46	1,232.25
7. 其他费用	6.4.7.20	54,973.80	141,462.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,427,234.59	-2,534,370.29
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,427,234.59	-2,534,370.29

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月14日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月14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）	32,429,393.72	8,470,232.90	40,909,626.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	6,427,234.59	6,427,234.59
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）	-6,117,802.77	-2,884,458.85	-9,002,261.62
其中：1.基金申购款	29,068,420.21	12,930,722.69	41,999,142.90
2.基金赎回款	-35,186,222.98	-15,815,181.54	-51,001,404.52
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）	26,321,590.95	12,013,008.64	38,334,599.59
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）	50,607,250.99	22,363,275.64	72,970,526.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-2,534,370.29	-2,534,370.29
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）	-15,802,667.61	-6,891,996.83	-22,694,664.44
其中：1.基金申购款	393,563.96	174,387.41	567,951.37
2.基金赎回款	-16,196,231.57	-7,066,384.24	-23,262,615.81
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）	34,804,583.38	12,736,908.52	47,541,491.90

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：

_____杨皓鹏_____ _____宋宇_____ _____周琳_____

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

中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金（原名为“中海安鑫保本混合型证券投资基金”，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]369号文《关于核准中海安鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人中海基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2013年7月31日正式生效，首次设立募集规模为313,835,907.37份基金份额，经江苏公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）苏公W[2013]B079号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的保本周期每2年为一个周期。本基金的第一个保本周期为两年，自2013年7月31日开始至2015年7月31日止。第一个保本周期届满时，如符合保本基金存续条件，本基金进入下一保本周期。

根据《中海安鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期转入第二个保本周期的过渡期折算结果的公告》和《关于中海安鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期及转入下一保本周期的相关规则公告》，本基金将在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始日之间设置过渡期，过渡期时间自2015年8月8日（含）至2015年9月7日（含）。过渡期最后一个工作日（即下一保本周期起始日前一工作日）为基金份额折算日。折算后基金份额净值调整为1.00元。经本基金管理人计算，并经本基金的基金托管人复核，2015年9月7日本基金折算前的基金份额净值为1.388元，依据前述折算规则确定的折算比例为1.388079651。折算后本基金的总份额由486,047,922.07份调整为674,673,229.98份。折算日的下一个工作日为下一保本周期起始日，保本周期两年，第二个保本周期自2015年9月8日至2017年9月8日，如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。

根据《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的规定和《中海基金管理有限公司关于中海安鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》，本基金在第二个保本周期届满时，由于本基金不再符合保本基金存续条件，因此按照本基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金”。同时，本基金的到期操作期间为保本周期到期日及之后5个工作日(含第5个工作日)，即2017年9月8日至2017年9月15日。在本基金到期操作期间截止日次日，即2017年9月16日起“中海安鑫保本混合型证券投资基金”转型为“中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金”，《中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金存续期限不定，本基金的基金管理人和注册登记机构为中海基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×30%+中证全债指数收益率×70%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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）》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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。

6.4.6.2 增值税

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，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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《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》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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。

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
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构

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

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期及上年度可比期间没有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14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	247,366.35	442,475.51
其中：支付销售机构的客户维护费	79,797.61	162,182.56

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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14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	41,227.69	73,745.91

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间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

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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14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
上海浦东发展银行股份有限公司	12,575,042.01	60,166.25	5,903,330.42	42,429.73

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2019年1月1日至2019年5月14日（转型前最后运作日）年度获得的利息收入为人民币1,132.90元（2018年半年度获得的利息收入为人民币4,470.03元），2019年5月14日（转型前最后运作日）结算备付金余额为人民币260,152.00元（2018年半年末末结算备付金余额为人民币596,346.20元）。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.10 期末（2019年5月14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

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

§7 投资组合报告（转型后）

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	15,144,138.59	40.22
	其中：股票	15,144,138.59	40.22
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	365,947.00	0.95
	其中：债券	365,947.00	0.95
	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	21,833,399.19	57.99
8	其他各项资产	319,870.16	0.85
9	合计	37,663,354.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	8,114,225.05	22.31
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	117,096.00	0.32
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	6,368,419.54	17.51
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	544,398.00	1.50
S	综合	–	–
	合计	15,144,138.59	41.64

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600446	金证股份	16,500	324,060.00	0.89
2	603000	人民网	17,100	304,893.00	0.84
3	002475	立讯精密	11,900	296,001.00	0.81
4	000725	京东方A	84,500	290,680.00	0.80
5	002463	沪电股份	20,900	284,658.00	0.78
6	002368	太极股份	8,400	284,520.00	0.70
7	000066	中国长城	23,600	242,608.00	0.67
8	300033	同花顺	2,300	226,228.00	0.62
9	002600	领益智造	38,000	225,340.00	0.62
10	002371	北方华创	3,200	221,600.00	0.61

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002463	沪电股份	222,368.00	0.61
2	002371	北方华创	217,718.00	0.60
3	002916	深南电路	203,767.00	0.56
4	300352	北信源	179,517.00	0.49
5	300604	长川科技	168,489.00	0.46
6	600745	闻泰科技	165,544.00	0.46
7	600728	佳都科技	164,470.94	0.45
8	300188	美亚柏科	164,174.00	0.45
9	300271	华宇软件	163,854.00	0.45
10	300223	北京君正	157,706.00	0.43
11	300047	天源迪科	157,512.00	0.43
12	002273	水晶光电	155,459.00	0.43
13	603501	韦尔股份	147,325.00	0.41
14	300253	卫宁健康	146,787.00	0.40
15	600845	宝信软件	145,175.00	0.40
16	600588	用友网络	142,992.00	0.39
17	603690	至纯科技	142,855.00	0.39
18	000156	华数传媒	135,178.12	0.37
19	002313	日海智能	134,393.00	0.37
20	300059	东方财富	134,160.00	0.37

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。7.4.2 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	600588	用友网络	109,060.00	0.30
2	300115	长盈精密	103,230.00	0.28
3	000503	国新健康	87,563.00	0.24
4	002517	恺英网络	63,960.00	0.18
5	002368	太极股份	37,587.00	0.10
6	600446	金证股份	37,360.00	0.10

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	10,064,846.89
卖出股票收入（成交）总额	438,760.00

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	355,947.00	0.98
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	355,947.00	0.98

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019308	18国债08	3,540	355,947.00	0.98

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	56,798.19
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	12,062.49
5	应收申购款	207,989.37
6	其他应收款	–
7	待摊费用	43,023.11
8	其他	–
9	合计	319,870.16

7.12.4 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

7.12.5 期末前十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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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。

§7 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	5,332,447.00	12.89
	其中：股票	5,332,447.00	12.89
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	22,895,054.00	55.35
	其中：债券	22,895,054.00	55.35
	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	12,835,194.01	31.03
8	其他资产	305,120.28	0.74
9	合计	41,367,815.29	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	2,740,094.00	7.15
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	2,592,353.00	6.76
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	5,332,447.00	13.91

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600446	金证股份	13,300	272,650.00	0.71
2	603000	人民网	11,800	231,044.00	0.60
3	002368	太极股份	6,900	216,315.00	0.56
4	000725	京东方A	57,900	196,281.00	0.51
5	002475	立讯精密	8,300	188,576.00	0.49
6	002600	领益智造	26,100	170,955.00	0.45
7	002439	启明星辰	5,700	147,288.00	0.38
8	000066	中国长城	16,200	145,800.00	0.38
9	603160	汇顶科技	1,100	145,321.00	0.38
10	300033	同花顺	1,700	144,721.00	0.38

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300047	天源迪科	2,389,229.00	8.28
2	300059	东方财富	3,002,526.80	7.34
3	603383	剑桥科技	2,565,245.00	6.28
4	300134	大富科技	2,440,077.00	5.96
5	600745	闻泰科技	1,941,609.00	4.75
6	601231	环旭电子	1,854,377.00	4.53
7	000063	中兴通讯	1,754,709.00	4.29
8	601162	天风证券	1,699,779.00	4.15
9	300168	万达信息	1,584,853.00	3.87
10	002384	东山精密	1,566,463.00	3.83
11	002273	水晶光电	1,478,838.00	3.61
12	002670	国盛金控	1,433,675.00	3.50
13	002236	大华股份	1,378,392.00	3.37
14	300451	创业慧康	1,346,642.00	3.29
15	300604	长川科技	1