中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:中科沃土基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中科沃土沃鑫成长混合发起
基金主代码	003125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月25日
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,162,639.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金秉承成长投资的理念,在严格控制风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下,通过积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解,在把握经济周期性波动的基础上,动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。基于成长投资的理念,投资于优选行业中的绩优股票;对于债券投资,采用期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等;适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资,进行分散投资,力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期收益和预期风险低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹萍	郭明
	联系电话	020-37128608	010-66105799
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-018-3610	95588
传真		020-23388997	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心21楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	590,148.53
本期利润	3,777,453.50
加权平均基金份额本期利润	0.0991
本期基金份额净值增长率	7.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1373
期末基金资产净值	91,588,671.02
期末基金份额净值	0.8627

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.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。表中的"期末"均指报告期最后一个自然日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.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。

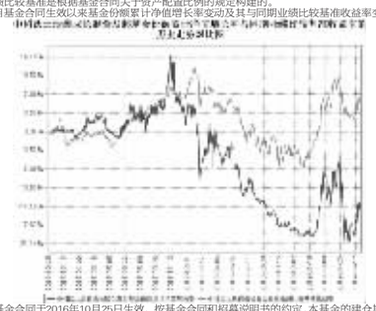
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	4.66%	1.04%	2.84%	0.58%	1.82%	0.46%
过去三个月	-2.74%	1.81%	-0.72%	0.75%	-2.02%	1.06%
过去六个月	7.06%	1.68%	13.65%	0.77%	-6.59%	0.91%
过去一年	-3.39%	1.21%	5.89%	0.75%	-9.28%	0.46%
自基金合同生效起至今	-13.73%	1.03%	6.19%	0.57%	-19.92%	0.46%

注:业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:本基金合同于2016年10月25日生效,按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937号文批准,于2015年9月6日正式成立,注册资本1.42亿元,是国内第101家公募基金管理公司,也是一家拥有PE背景的公募基金管理公司。中科沃土带着11年超募、博科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因,始终贯彻"持有人利益至上"的理念,坚守准则,遵循诚信、规范、稳健的经营方针,崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格,致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务,创造成长价值,汇聚阳光财富。截至2019年6月30日,中科沃土旗下共管理7只开放式基金:中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土轮胎升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。此外,公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李茂	副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理	2016年10月25日	2019年5月8日	23年	管理学硕士,曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理,黄华基金管理有限公司专户管理部副总监,专户管理部负责人,基金管理部基金经理、基金管理部副总监,中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理,中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土轮胎升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃安中短债债券型证券投资基金和中科沃土沃安债券型证券投资基金基金经理,中国国籍,具有基金从业资格。
乐瑞祺	总经理助理、基金经理	2019年5月8日	-	14年	数量经济学硕士,曾任赢泰软件定量分析师、产品经理,博时基金基金经理助理,民生加银基金基金经理,投资部总监、投资全委员,方圆360资产管理有限公司执行总经理,投资经理,第一创业证券资产管理部投资总监,现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理,中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃安中短债债券型证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,中国国籍,具有基金从业资格。
辛佳蕾	基金经理助理	2017年12月15日	2019年2月11日	6年	会计学硕士,曾任安信证券股份有限公司分析师,中科沃土基金管理有限公司专户投资经理、研究部行业研究员,现任中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理助理,中国国籍,具有基金从业资格。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,李茂的"任职日期"为基金合同生效之日,乐瑞祺、辛佳蕾的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并围绕交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年特别是1季度,宏观环境整体处于财政政策,货币政策双宽松状态,导致年初出现了股债齐涨的局面,股票市场的上涨绝大部分原因是对2018年市场大幅下跌的一种估值修复,债券市场的上涨则主要源于流动性的宽松。

在上半年的操作中,我们提高了组合股票的仓位水平,组合更为均衡,估值更为合理,组合稳定性也得到了较大幅度的提高。在接下来的操作中,我们仍将侧重于精选优质公司,摒弃仓位大幅变动的操作,我们希望通过持有权益市场上的优质标的,为投资者创造价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.8627元;本报告期基金份额净值增长率为7.06%,业绩比较基准收益率为13.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,贸易战仍将出现反复,中美关系的博弈将是一种常态,逆全球化的贸易战将会对全球经济造成不利影响,在全球经济出现放缓迹象的同时,各大央行放松货币政策似乎成了一种潮流,在这样的背景下,我们认为国内下半年仍有放松货币政策的必要,但是鉴于房住不炒的前提,采用何种方式的放松成为人们更为关心的问题。

鉴于目前股票市场的估值水平,我们认为市场下跌空间有限,精选优质公司,分享公司的业绩增长仍然是我们组合的策略核心。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,定期对估值政策和程序进行评价。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

基金日常估值由基金事务部具体执行,并确保和托管行核对一致。投资研究人员彩极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素,提出估值建议,确保估值的公允性。监察风控部负责对基金估值程序和方法进行核查,确保估值相关各项决策得以有效执行,以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理不参与估值的具体流程,但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况,可提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议,由其按合同约定提供相关固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中"基金收益与分配"之"(三)基金收益分配原则"的相关规定,本基金本报告期内未进行利润分配,符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——中科沃土基金管理有限公司在中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实,准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:			
银行存款		5,432,453.73	14,885,406.96
结算备付金		269,638.31	287,550.59
存出保证金		80,713.58	52,952.06
交易性金融资产		85,518,033.94	2,141,999.33
其中:股票投资		85,518,033.94	2,141,999.33
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		-	10,000,000.00
应收证券清算款		669,866.40	-
应收利息		2,123.13	12,937.37
应收股利		-	-
应收申购款		99.85	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		91,972,928.94	27,380,846.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6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		851.54	-
应付管理人报酬		66,105.02	34,296.32
应付托管费		11,017.49	5,716.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		139,117.52	301,675.24
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		167,166.35	275,000.00
负债合计		384,257.92	616,687.61
所有者权益:			
实收基金		106,162,639.11	33,214,590.25
未分配利润		-14,573,968.09	-6,450,431.55
所有者权益合计		91,588,671.02	26,764,158.70
负债和所有者权益总计		91,972,928.94	27,380,846.31

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.8627元,基金份额总额106162639.11份。

6.2 利润表

会计主体:中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6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		4,771,275.55	-3,504,947.38
1.利息收入		89,675.21	45,888.07
其中:存款利息收入		35,886.10	37,967.52
债券利息收入		20,887.71	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,901.40	7,920.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,492,633.68	-3,784,351.27
其中:股票投资收益		910,120.82	-3,921,410.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益		11,351.39	-
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		571,161.47	137,058.77
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		3,187,304.97	225,471.51
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,661.69	8,044.31
减:二、费用		993,822.05	1,202,749.54
1.管理人报酬		239,723.52	261,646.63
2.托管费		39,953.94	43,607.81
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		698,253.18	757,412.24
5.利息支出		3,072.66	-
其中:卖出回购金融资产支出		3,072.66	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用		12,818.75	140,082.86
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		3,777,453.50	-4,707,696.92
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		3,777,453.50	-4,707,696.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	33,214,590.25	-6,450,431.55	26,764,158.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,777,453.50	3,777,453.50
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)	72,948,048.86	-11,900,990.04	61,047,058.82
其中:1.基金申购款	74,561,775.86	-12,098,910.41	62,462,865.45
2.基金赎回款	-1,613,727.00	197,920.37	-1,415,806.63
五、期末所有者权益(基金净值)	106,162,639.11	-14,573,968.09	91,588,671.02
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)	44,375,628.61	1,275,619.30	45,651,247.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,707,696.92	-4,707,696.92
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)	-10,216,058.05	-222,258.84	-10,438,316.89
其中:1.基金申购款	1,627,622.52	-548.65	1,627,073.87
2.基金赎回款	-11,843,680.57	-221,710.19	-12,065,390.76
五、期末所有者权益(基金净值)	34,159,570.56	-3,654,336.46	30,505,234.10

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:

程文卫 傅军 李茂
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

中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金"或"基金")根据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1561号),由基金发起人中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")发起募集。本基金募集资金经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资,并由其出具《验证报告》(安永华明(2016)验字第61247680_G06号)。经向中国证监会备案,本基金基金合同于2016年10月25日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为:包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、货币市场工具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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019上半年度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会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《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〔2012〕85号)、《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〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36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〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《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〔2016〕140号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税。

(三) 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。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内未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。

6.4.7.2 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
中科沃土基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广东中科科创创业投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
广东省粤科金融集团有限公司	基金管理人的股东
广东中广投资管理有限公司	基金管理人的股东

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无需支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6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	239,723.52	261,646.63
其中:支付销售机构的客户维护费	85,007.06	115,627.86

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H = E × 1.5 % ÷ 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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6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	39,953.94	43,607.81

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
期初持有的基金份额	4,975,124.38	4,975,124.38
期末持有的基金份额	4,975,124.38	4,975,124.38
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.69%	14.56%

注:基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广东中科科创创业投资管理有限责任公司	2,976,293.76	2.80%	2,976,293.76	8.96%
广东省粤科金融集团有限公司	1,000,000.00	0.94%	1,000,000.00	3.01%
广东中广投资管理有限公司	197,642.23	0.19%	197,642.23	0.60%

注:关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6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
中国工商银行股份有限公司	5,432,453.73	24,399.53	23,227,600.85	32,439.50

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:截至本报告期末2019年6月30日止,本基金无因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末2019年6月30日止,本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参考最近一期年报。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2019年6月30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级的余额为85,518,033.94元,无属于第二层级和第三层级的余额。(2018年12月31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级的余额为2,141,999.33元,无属于第二层级和第三层级的余额。)

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、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二层级或第三层级,上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

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	85,518,033.94	92.98
	其中:股票	85,518,033.94	92.98
7	银行存款和结算备付金合计	5,702,092.04	6.20
8	其他各项资产	752,802.96	0.82
9	合计	91,972,928.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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(%)
B	采矿业	1,201,057.00	1.31
C	制造业	35,784,012.00	39.07
E	建筑业	1,872,200.00	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	3,569,339.00	3.90
I	信息传输、软件和信息技术服务业	834,680.00	0.91
J	金融业	37,142,432.94	40.55
K	房地产业	2,259,783.00	2.47
L	租赁和商务服务业	2,854,530.00	3.12
	合计	85,518,033.94	93.37

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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

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	601318	中国平安	90,754	8,041,711.94	8.78
2	600519	贵州茅台	8,000	7,872,000.00	8.59
3	600036	招商银行	170,900	6,148,982.00	6.71
4	600887	伊利股份	133,300	4,453,553.00	4.86
5	601601	中国太保	111,800	4,081,818.00	4.46
6	600585	海螺水泥	95,700	3,971,550.00	4.34
7	601166	兴业银行	206,600	3,778,714.00	4.13
8	600276	恒瑞医药	52,100	3,438,600.00	3.75
9	600030	中信证券	127,600	3,038,156.00	3.32
10	601888	中国国旅	32,200	2,854,530.00	3.12

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半年度报告正文。

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	601318	中国平安	9,828,271.00	36.72
2	600519	贵州茅台	8,973,807.98	33.53
3	600036	招商银行	6,132,822.83	22.91
4	002157	正邦科技	5,808,897.00	21.70
5	300498	温氏股份	5,198,519.00	19.42
6	002124	天邦股份	4,987,450.50	18.63
7	002792	通宇通讯	4,657,815.00	17.40
8	601166	兴业银行	4,640,431.00	17.34
9	002714	牧原股份	4,562,322.50	17.05
10	601688	华泰证券