富荣福锦混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:富荣基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
送出日期:2019年08月27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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富荣福锦混合	
基金主代码	005164	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年03月16日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	236,914,021.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣福锦混合A	富荣福锦混合C
下属分级基金的交易代码	005164	005165
报告期末下属分级基金的份额总额	234,172,28份	236,679,849.15份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合,在严格控制风险的基础上,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等),并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型,动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*30%+沪深300指数收益率*70%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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		富荣基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	滕大江	李帅帅
	联系电话	0755-84356633	0755-25878287
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4006855600	95511-3
传真		0755-83230902	0755-82080387

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.furamc.com.cn/
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§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01月01日-2019年06月30日)	
	富荣福锦混合A	富荣福锦混合C
本期已实现收益	20,266.82	16,504,743.45
本期利润	8,220.20	30,034,909.67
加权平均基金份额本期利润	0.2263	0.4454
本期基金份额净值增长率	14.23%	14.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0673	-0.0763
期末基金资产净值	218,423.49	218,611,831.66
期末基金份额净值	0.9327	0.9237

注:①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;

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期末可供分配利润是采用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;

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

富荣福锦混合A

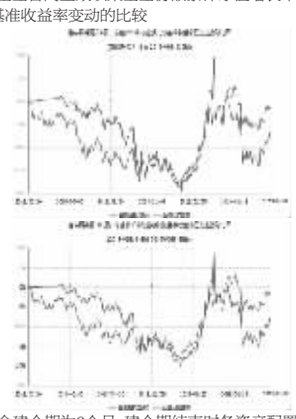
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.56%	1.07%	3.95%	0.81%	2.61%	0.26%
过去三个月	-4.08%	1.48%	-0.50%	1.06%	-3.58%	0.42%
过去六个月	14.23%	1.67%	19.36%	1.08%	-5.13%	0.59%
过去一年	-4.72%	1.40%	8.87%	1.07%	-13.59%	0.33%
自基金合同生效起至今	-6.73%	1.24%	-1.32%	1.01%	-5.41%	0.23%

富荣福锦混合C

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	6.55%	1.08%	3.95%	0.81%	2.60%	0.27%
过去三个月	-4.10%	1.49%	-0.50%	1.06%	-3.60%	0.43%
过去六个月	14.18%	1.67%	19.36%	1.08%	-5.18%	0.59%
过去一年	-5.14%	1.40%	8.87%	1.07%	-14.01%	0.33%
自基金合同生效起至今	-7.63%	1.24%	-1.32%	1.01%	-6.31%	0.23%

注:本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率×30%+沪深300指数收益率×70%

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:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各资产配置比例符合合同约定。

§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

富荣基金管理有限公司成立于2016年1月25日,是中国证监会批准成立的国内第101家公募基金管理公司。公司注册地为广州市南沙区,办公地位于深圳市福田区深圳证券交易所广场, 注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于"综合金融服务商",围绕客户需求,贯彻投资人利益优先原则,秉持"规范创造价值,创新推动成长"的经营理念,努力打造企业核心竞争力,整合产业上下游资源,为各类投资者提供充分满足个性需求的产品,并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优质的服务回报投资者的信任,与投资者共同分享中国经济发展的成果,致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领先者。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓宇翔	权益投资部总监、基金经理	2018-03-30	-	13	硕士学历,持有基金从业资格证书,中国籍籍,曾任西南证券股份有限公司资深投资经理、深圳东新佳投资有限公司投资经理。2017年2月22日加入富荣基金。

注:1、"任职日期"对外公告的聘任日期。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。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

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》和公司制定的公平交易相关制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析,报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2019年上半年,一季度在央行降准、商誉减值落地、社融数据超预期、MSCI提高纳入比例、科创板落地、中美经贸关系缓和、美联储暂缓加息等一系列利好因素推动下,A股大幅反弹, 估值修复至历史均值水平。随后随着二季度央行重提"总闸门",政治局会议微幅转向重提"结构性去杠杆",中美经贸关系再次出现波折,A股从高位回落、震荡调整,市场风险偏好降低,上证综指在3000附近盘整。

报告期内,本基金主要配置业绩稳健、确定性较高、基本面向好的细分行业龙头,行业选择上以消费、交运、受政策影响较小的医疗服务与器械等为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣福锦混合A基金份额净值为0.9327元,本报告期内, 该类基金份额净值增长率为14.23%, 同期业绩比较基准收益率为19.36%;截至报告期末富荣福锦混合C基金份额净值为0.9237元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为14.18%,同期业绩比较基准收益率为19.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面,经济下行压力仍存,下半年政策有望加码。中美贸易摩擦,投资者将对摩擦长期化有所预期,中美问题对市场的影响也将边际弱化;微观层面,上市公司业绩有望在下半年触底但预计弱反弹可能性较大,更多的是各行业板块结构性机会;最后,基于下半年外资、保险等长期资金的加速流入各行业的头部公司在资金面将占优。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、基金事务部、监察稽核部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;A 类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同;本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权; 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金的基金合同于2018年3月16日生效,截止2019年6月30日,根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金自2019年3月13日至2019年6月3日出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形,未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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,平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》,基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期,本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富荣福锦混合型证券投资基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	17,918,628.53	31,250,749.86
结算备付金	89,408.00	692,219.63
存出保证金	135,336.74	123,198.24
交易性金融资产	201,146,221.57	42,006,019.20
其中:股票投资	201,146,221.57	42,006,019.20
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	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	2,797,032.03
应收利息	6,299.93	5,328.09
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	219,295,894.77	106,874,547.05
负债和所有者权益	本期末 2019年06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	-	28,008,537.68
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	149,819.07	103,109.90
应付托管费	14,981.94	10,310.98
应付销售服务费	9,983.01	6,871.81
应付交易费用	226,388.83	103,705.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	64,466.77	135,000.00
负债合计	465,639.62	28,367,536.18
所有者权益:		
实收基金	236,914,021.43	97,036,325.18
未分配利润	-18,083,766.28	-18,529,314.31
所有者权益合计	218,830,255.15	78,507,010.87
负债和所有者权益总计	219,295,894.77	106,874,547.05

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额236,914,021.43份。A类基金份额净值人民币0.9327元,基金份额总额234,172.28份。C类基金份额净值人民币0.9237元,基金份额总额236,679,849.15份。

6.2 利润表

会计主体:富荣福锦混合型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06月30日
一、收入	31,405,160.70	-1,657,892.86
1.利息收入	142,646.96	1,214,299.13
其中:存款利息收入	54,878.98	869,510.62
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	87,767.98	344,788.51
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	17,744,394.14	-1,631,836.33
其中:股票投资收益	16,921,428.64	-1,882,630.33
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	822,965.50	250,794.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	13,518,119.60	-1,240,747.86
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	392.20
减:二、费用	1,362,030.83	958,280.35
1. 管理人报酬	445,683.33	594,393.91
2. 托管费	44,568.32	59,439.39
3. 销售服务费	29,696.48	108,247.93
4. 交易费用	777,615.93	145,224.59
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	64,466.77	50,974.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	30,043,129.87	-2,616,173.21
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	30,043,129.87	-2,616,173.21

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富荣福锦混合型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06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)	97,036,325.18	-18,529,314.31	78,507,010.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,043,129.87	30,043,129.87
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)	139,877,696.25	-29,597,581.84	110,280,114.41
其中:1.基金申购款	219,888,339.86	-25,697,349.86	194,190,990.00
2.基金赎回款	-80,010,643.61	-3,900,231.98	-83,910,875.59
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)	236,914,021.43	-18,083,766.28	218,830,255.15

项 目	上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06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)	202,029,938.37	-	202,029,938.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,616,173.21	-2,616,173.21
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)	-89,841,273.04	-329,016.90	-90,170,289.94
其中:1.基金申购款	15,151,187.78	-120,783.39	15,030,404.39
2.基金赎回款	-104,992,460.82	-208,233.51	-105,200,694.33
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)	112,188,665.33	-2,945,190.11	109,243,475.22

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:

郭容辰	黄文飞	黄文飞
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 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
富荣基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人

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。

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.4.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	445,683.33	594,393.91
其中:支付销售机构的客户维护费	41,271.62	189.48

注:基金管理费每日计提,按月支付。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为前一日基金资产净值

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,568.32	59,439.39

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%/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

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福锦混合A	富荣福锦混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	24,944.19	24,944.19
平安银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	24,944.19	24,944.19

	上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06月30日		
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福锦混合A	富荣福锦混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	108,244.84	108,244.84
合计	0.00	108,244.84	108,244.84

注:销售服务费每日计提,按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费。2018年4月16日前本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%。自2018年4月16日起本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×基金份额的销售服务费年费率/当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富荣福锦混合A

份额单位:份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06月30日
基金合同生效日(2018年03月16日)持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

富荣福锦混合C

份额单位:份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06月30日
基金合同生效日(2018年03月16日)持有的基金份额	17,000,944.44	17,000,944.44
报告期初持有的基金份额	17,000,944.44	17,000,944.44
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	17,000,944.44	17,000,944.44
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.18%	15.16%

注:1、申购含转换入份额、红利再投资份额;赎回含转换出份额。

2、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

6.4.4.4.2 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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.4.5 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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年03月16日(基金合同生效日)至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	17,918,628.53	46,415.34	38,365,441.95	97,748.21

注:本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管,按约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金无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。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金无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。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币201,146,221.57元,无划分为第二层次的余额,无划分为第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票,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,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券,若出现交易不活跃的情况, 本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次;根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入(转出)的情况。

(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。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月26日经本基金的基金管理人批准。

§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	201,146,221.57	91.72
	其中:股票	201,146,221.57	91.72
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	18,008,036.53	8.21
8	其他各项资产	141,636.67	0.06
9	合计	219,295,894.77	100.00

7.2 报告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

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	12,441,160.82	5.69
B	采矿业	10,650.00	0.00
C	制造业	96,143,582.35	43.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,364,480.00	3.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	23,504,868.90	10.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,300,800.00	1.97
J	金融业	8,535,068.00	3.90
K	房地产业	16,825,180.00	7.69
L	租赁和商务服务业	17,486,212.50	7.99
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	14,534,221.00	6.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	201,146,221.57	91.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期未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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600809	山西汾酒	274,647	18,964,375.35	8.67
2	600009	上海机场	215,505	18,055,008.90	8.25
3	601888	中国国旅	197,250	17,486,212.50	7.99
4	600519	贵州茅台	17,316	17,038,944.00	7.79
5	600007	中国国贸	1,153,200	16,825,188.00	7.69
6	002223	鱼跃医疗	592,600	14,589,812.00	6.67
7	300015	爱尔眼科	469,300	14,534,221.00	6.64
8	601012	隆基股份	575,600	13,302,116.00	6.08
9	300498	温氏股份	346,937	12,441,160.82	5.69
10	000858	五粮液	100,500	11,853,975.00	5.42

提示: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http://www.furamc.com.cn/ 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	300498	温氏股份	18,937,556.34	24.12
2	600809	山西汾酒	17,537,338.81	22.34
3	601012	隆基股份	16,840,502.64	21.45
4	600519	贵州茅台	16,480,592.00	20.99
5	600007	中国国贸	16,419,344.28	20.91
6	600009	上海机场	16,204,867.39	20.64
7	601888	中国国旅	16,098,018.26	20.51
8	000858	五粮液	15,679,316.00	19.97
9	002223	鱼跃医疗	13,790,213.10	17.57
10	300015	爱尔眼科	13,647,805.70	17.38
11	601009	南京银行	8,750,616.00	11.15
12	601881	中国银河	7,824,577.32	9.97
13	600886	国投电力	6,664,123.00	8.49
14	601166	兴业银行	6,415,700.00	8.17
15	600585	海螺水泥	6,346,268.81	8.08
16	002458	益生股份	5,697,779.00	7.26
17	600004	白云机场	5,472,758.99	6.97
18	600233	圆通速递	5,400,827.55	6.88
19	002746	仙乐股份	5,014,897.00	6.39
20	002916	深南电路	4,472,348.00	5.70
21	600588	用友网络	4,399,133.30	5.60
22	002234	民和股份	4,264,410.00	5.43
23	600025	华能水电	4,090,000.00	5.21
24	603899	晨光文具	4,057,697.00	5.17
25	600031	三一重工	4,028,430.00	5.13
26	000876	新希望	3,709,177.00	4.72
27	600570	恒生电子	3,534,331.75	4.50
28	002299	圣农发展	3,517,002.56	4.48
29	600728	佳都科技	3,356,200.00	4.27
30	300394	天孚通信	3,262,134.00	4.16
31	603833	欧派家居	3,205,889.00	4.08