财通福盛定增定期开放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:财通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年08月27日

§1 重要提示

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。

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1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	财通福盛定开混合发起
场内简称	财通福盛
基金主代码	501032
交易代码	501032
基金运作方式	上市契约型、定期开放。本基金以定期开放方式 运作,即本基金在一定期间内封闭运作,不接受 基金的申购、赎回;在封闭期结束和下一封闭期 开始之间设置开放期,受理本基金的申购、赎回 等申请。
基金合同生效日	2017年01月25日
基金管理人	财通基金管理有限公司
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	262,843,329.72份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017年4月21日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素,通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析,对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判,根据判断结果进行资产配置及组合的构建,确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态调整各资产类别的投资比例,在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。 本基金在价值投资理念的基础上,建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系,并根据市场环境的变化进行针对性运用:固定收益投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益;在严格控制风险的前提下进行权证投资;根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率 ×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金产品,属于中高风险、中高收益的基金产品。

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		财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武炜	郭明
	联系电话	021-20537888	010-66105799
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95588
传真		021-20537999	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.ctfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

§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)
本期已实现收益	-7,701,722.16
本期利润	10,239,364.97
加权平均基金份额本期利润	0.0390
本期基金份额净值增长率	5.30%
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	-0.2268
期末基金资产净值	203,237,208.46
期末基金份额净值	0.7732

注:(1)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;

(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) 期末可供分配利润为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)。

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

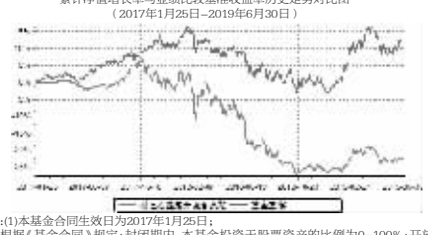
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.51%	0.37%	3.17%	0.65%	-2.66%	-0.28%
过去三个月	-2.34%	0.57%	-0.16%	0.84%	-2.18%	-0.27%
过去六个月	5.30%	0.56%	15.53%	0.85%	-10.23%	-0.29%
过去一年	-6.32%	0.62%	7.81%	0.84%	-14.13%	-0.22%
自基金合同生效起至今	-22.68%	0.82%	12.48%	0.65%	-35.16%	0.17%

注:(1)上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;

(2)本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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

财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年1月25日-2019年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日为2017年1月25日;

(2)根据《基金合同》规定:封闭期内,本基金投资于股票资产的比例为0~100%;开放期内,投资于股票资产的比例则为0~95%;非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%。开放期内,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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

如因法律法规、市场环境变化或其他因素导致本基金无法参与上市公司定向增发项目的,本基金将履行相应程序,并更名为"财通福盛定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金",基金的投资组合比例将不受上述"非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%"的限制,基金的投资目标、投资范围、运作方式等均保持不变。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率 ×45%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部颁布的《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(以下统称"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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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3号《半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)》及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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及自2019年1月1日起至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

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。

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,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金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,本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳销值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

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。

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。

6.4.7 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

本基金本报告期不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
财通基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、基金销售机构
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

注:下述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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

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01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,508,982.66	3,618,182.92
其中:支付销售机构的客户维护费	497,153.75	1,338,611.57

注:(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日计提,按月支付;

(2)基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数;

(3) 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 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01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	251,497.14	603,030.55

注:(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日计提,按月支付;

(2)基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

本基金本报告期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01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
基金合同生效日(2017年01月25日)持有的基金份额	10,000,350.00	10,000,350.00
报告期初持有的基金份额	10,000,350.00	10,000,350.00
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	10,000,350.00	10,000,350.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.8047%	1.9335%

注:(1)本基金以定期开放方式运作,即本基金在一定期间内封闭运作,不接受基金的申购、赎回;在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期,受理本基金的申购、赎回等申请;

(2)基金管理人运用固有资金10,000,000.00元作为发起资金认购本基金且承诺该部分基金份额持有期限不少于三年, 募集期产生的利息为1,350元,以上合计为人民币10,000,350.00元,折合10,000,350.00份基金份额。基金管理人认购本基金适用的费率为固定认购费用1,000元。

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

本基金本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01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
中国工商银行活期存款	11,141,923.96	192,128.35	228,434,227.82	218,667.85

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行间业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.8.7.2当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.9期末(2019年06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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000060	中金岭南	2017-07-03	2019-07-04	非公开发行限售	9.12	4.66	1,365,131	12,449,997.76	6,361,510.46	-
000060	中金岭南	2018-05-16	2019-07-04	非公开发行限售-转增	-	4.66	682,566	-	3,180,757.56	-
002276	万马股份	2017-07-10	2019-07-11	非公开发行限售	9.08	5.39	1,376,652	12,500,000.16	7,420,154.28	-
300075	数字政通	2017-08-18	2019-08-21	非公开发行限售	18.53	10.78	539,665	9,999,992.45	5,817,588.70	-
002431	棕榈股份	2017-07-07	2019-07-10	非公开发行限售	9.05	3.91	1,334,254	12,074,998.70	5,216,933.14	-
300310	宜通世纪	2017-07-10	2019-07-12	非公开发行限售	10.95	7.25	671,233	7,350,001.35	4,866,439.25	-
603889	新澳股份	2017-08-01	2019-07-29	非公开发行限售	13.01	6.70	411,222	5,349,998.22	2,755,187.40	-
603889	新澳股份	2019-06-12	2019-07-29	非公开发行限售-转增	-	6.70	123,367	-	826,558.90	-
000980	众泰汽车	2017-08-29	2019-08-30	非公开发行限售	9.63	4.02	794,392	7,649,994.96	3,193,455.84	-

注:(1)以上"可流通日"是根据上市公司公告估算的流通日期,最终日期以上市公司公告为准;

(2)本基金持有的非公开发行股票中金岭南,于2018年5月16日实施2017年度利润分配及资本公积金转增股本方案,以资本公积金向全体股东每10股转增5股,因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致;

(3)本基金持有的非公开发行股票新澳股份,于2019年6月12日实施2018年度权益分派方案,以资本公积金向全体股东每10股转增3股,因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10 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贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

2)以公允价值计量的金融工具

(1)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属于第一层次的余额为人民币8,538,545.00元,属于第二层次的余额为人民币141,058,000.00元,属于第三层次的余额为人民币39,638,585.53元。

于2018年12月31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属于第一层次的余额为人民币8,591,926.80元、属于第二层次的余额为人民币0元,属于第三层次的余额为人民币39,042,753.31元。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券,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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次;并根据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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期变动情况如下:

单位:人民币元

交易性金融资产

上年度末

39,042,753.31

转入第三层次

-

转出第三层次

7,769,772.18

当期计入损益的利得或损失总额

8,365,604.40

购买

-

出售

-

本期末

39,638,585.53

本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动

6,074,128.16

2、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。

3、其他事项

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	48,177,130.53	23.66
	其中:股票	48,177,130.53	23.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	141,058,000.00	69.28
	其中:债券	141,058,000.00	69.28
	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	11,141,923.96	5.47
8	其他各项资产	3,239,552.64	1.59
9	合计	203,616,607.13	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,166,531.44	12.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,476,423.14	2.69
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	10,684,027.95	5.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,309,854.00	2.12
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	1,540,294.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	48,177,130.53	23.70

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

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	000060	中金岭南	2,047,697	9,542,268.02	4.70
2	002276	万马股份	1,376,652	7,420,154.28	3.65
3	300075	数字政通	539,665	5,817,588.70	2.86
4	002431	棕榈股份	1,334,254	5,216,933.14	2.57
5	300310	宜通世纪	671,233	4,866,439.25	2.39
6	603889	新澳股份	534,589	3,581,746.30	1.76
7	000980	众泰汽车	794,392	3,193,455.84	1.57
8	600887	伊利股份	72,700	2,428,907.00	1.20
9	600340	华夏幸福	72,300	2,358,811.00	1.16
10	000002	万 科A	70,300	1,955,043.00	0.96

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金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	600284	浦东建设	3,201,124.60	1.66
2	600663	陆家嘴	3,198,533.60	1.66
3	600887	伊利股份	2,125,740.91	1.10
4	600340	华夏幸福	2,095,045.00	1.09
5	000002	万 科A	2,069,762.00	1.07
6	002739	万达电影	1,047,323.00	0.54
7	000681	视觉中国	1,044,114.00	0.54
8	600050	中国联通	1,034,545.00	0.54
9	002146	荣盛发展	1,006,295.00	0.52
10	000063	中兴通讯	983,488.00	0.51
11	300188	美亚柏科	978,067.00	0.51

注:"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601718	际华集团	6,516,787.10	3.38
2	600284	浦东建设	3,325,144.68	1.72
3	600663	陆家嘴	2,900,701.60	1.50
4	000717	韶钢松山	2,406,543.61	1.25
5	002044	美年健康	2,148,143.00	1.11
6	300146	汤臣倍健	2,126,308.00	1.10
7	300059	东方财富	1,602,005.00	0.83
8	002507	涪陵榨菜	1,563,006.24	0.81
9	000063	中兴通讯	1,398,202.00	0.72
10	300188	美亚柏科	1,131,026.00	0.59
11	002146	荣盛发展	1,092,258.00	0.57
12	600050	中国联通	1,003,516.00	0.52
13	002522	浙江众成	845,903.60	0.44
14	600986	科达股份	650,660.50	0.34

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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	18,784,038.11
卖出股票收入(成交)总额	28,710,205.33

注:本表"买入股票成本(成交)总额"、"卖出股票收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	141,058,000.00	69.41
	其中:政策性金融债	141,058,000.00	69.41
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	141,058,000.00	69.41

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	040225	04国开25	500,000	50,735,000.00	24.96
2	140227	14国开27	500,000	50,295,000.00	24.75
3	180410	18农发10	400,000	40,028,000.00	19.70

7.7 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。

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

本基金本报告期内未投资贵金属。

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

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

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

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 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持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内,宣通世纪(证券代码:300310)于2018年7月12日收到广州市公安局天河区分局出具的《立案告知书》,案件情况存在不确定性,于2018年9月20日收到广东证监局下发的《关于对方炎林采取责令改正措施的决定》([2018]66号)。除上述情况外,本基金投资的其他前九名证券的发行主体没有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。

本基金投资宣通世纪(证券代码:300310)的投资决策程序为:

1、投资决策委员会根据有关法律规定并结合各基金合同的规定和风险控制对流通受限证券的各项投资比例限制,对各基金给予一定的授权;

2、本基金经理在拟定投资计划时,必须充分认识该项投资的流动性风险,并考虑所管理投资组合的投资风格和流动性特点,严格遵守基金合同以及风险控制制度对流通受限证券的各项投资比例限制;

3、研究部要对拟投资的流通受限证券提供详尽内部研究报告,必须有明确的投资建议;

4、金融工程小组须对拟投资的流通受限证券提供风险评估报告并报风险管理部备案;

5、基金经理根据基金合同、投资决策委员会对各基金经理的授权、投资组合的规模变化以及当时市场状况等对流通受限证券拟定投资计划;

6、公司旗下产品在投资流通受限证券过程中的风险比例必须严格按照风险控制的相关规定执行;

7、投资决策委员会对投资计划的批准:公司旗下产品参与公开发行股票网下配售部分的投资按照董事会批准的相关制度,由投资决策委员会负责相关投资决策;

8、基金经理根据授权下达指令;

9、监察稽核部和风险管理部按照职责要求, 各自履行对投资于流通受限股票的事前、事中、事后的风险控制职能。

7.12.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的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	11,788.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,227,763.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,239,552.64

7.12.4 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。

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
1	000060	中金岭南	9,542,268.02	4.70