富国天盛灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国农业银行股份有限公司
送出日期：	2019年08月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。

基金托管人中国农业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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天盛灵活配置混合
基金主代码	000634
交易代码	前端交易代码：000634 后端交易代码：000635
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年04月30日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	270,428,971.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选择，实现基金资产较高的长期回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	贺倩
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361634	010-68121816

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	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

§3 主要财务指标、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日至2019年06月30日)
本期已实现收益	33,538,959.31
本期利润	83,632,852.21
加权平均基金份额本期利润	0.3041
本期基金份额净值增长率	32.61%
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	0.1345
期末基金资产净值	327,372,775.40
期末基金份额净值	1.211

注：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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.2 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	6.98%	1.29%	3.70%	0.75%	3.28%	0.54%
过去三个月	2.20%	1.63%	−0.39%	0.99%	2.59%	0.64%
过去六个月	32.61%	1.49%	17.99%	1.00%	14.62%	0.49%
过去一年	20.96%	1.17%	8.67%	0.99%	12.29%	0.18%
过去三年	39.38%	1.03%	18.74%	0.72%	20.64%	0.31%
自基金合同生效日起至今	108.13%	1.41%	64.73%	1.01%	43.40%	0.40%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映A股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmarkt）按下列公式计算：

benchmarkt =65%* [沪深300指数t/(沪深300指数t−1)−1] +35%* [中债综合指数t/(中债综合指数t−1)−1]；

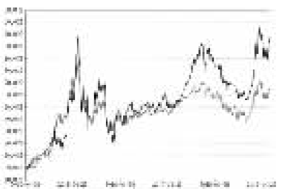
其中，t=1，2，3，…，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[ΠTt=1(1+benchmarkt)]−1

其中，T=2，3，4，…；ΠTt=1(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

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：1、截止日期为2019年6月30日。

2、本基金于2014年4月30日由原汉盛证券投资基金转型而成，建仓期6个月，从2014年4月30日至2014年10月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金5.2亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至2019年6月30日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债−1−3年国开行债券指数证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等一百三十七只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖威兵	本基金基金经理	2018-09-25	–	17	硕士，2002年5月至2002年12月任国元证券有限责任公司分析师；2003年4月至2005年6月任上海金信管理研究有限公司分析师；2005年6月至2006年3月任国金证券有限责任公司分析师；2006年4月至2009年8月任国泰基金管理有限公司分析师；2009年11月至2018年8月任海富通基金管理有限公司分析师、投资经理、组合经理；2018年8月加入富国基金管理有限公司，2018年9月起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年12月起任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年5月起任富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金、富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《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

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以为投资者减少和分散风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019上半年，上证指数、创业板综指分别上涨19.45%、20.94%，振幅分别为33.98%、44.75%。权益市场整体呈上行格局，主要是市场估值由低位向上摆动，同时，由于基本面预期波动较大，导致市场宽幅振荡。市场预期波动主要来自三个方面，首先是中美贸易谈判的波折前行，其次是国内防风险、稳增长等系列政策的推进和调整，再次是美联储货币政策的变化。面对复杂的经济、市场环境，本基金积极应对，加强基本面研究，重点配置了消费及其他行业的龙头公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，本基金份额净值为1.211元；份额累计净值为1.861元；本报告期，本基金份额净值增长率为32.61%，同期业绩比较基准收益率为17.99%

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，中美贸易谈判仍将是市场关注的焦点，国内的政策应对、美联储货币政策的走向还在不断演变。同时，在上半年市场回升的基础上，市场估值已经得到了一定的修复，向上的估值弹性将趋于收敛。我们在跟踪经济基本面的同时，将继续着眼于优秀公司的中长期核心竞争力，加强自下而上的深度研究。

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》、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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金对本报告期内利润共进行2次收益分配。于2019年4月8日公告每10份基金份额派发红利0.24元，共计派发红利6398313.66元；于2019年7月8日公告每10份基金份额派发红利0.27元，共计派发红利7346125.43元。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国天盛灵活配置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	22,787,138.77	150,917,981.44
结算备付金	1,542,008.05	588,589.48
存出保证金	348,322.20	383,329.33
交易性金融资产	305,524,582.52	53,844,805.96
其中：股票投资	305,524,582.52	48,334,459.56
基金投资	–	–
债券投资	–	5,510,346.40
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	–	67,500,000.00
应收证券清算款	–	–
应收利息	6,000.87	89,521.08
应收股利	–	–
应收申购款	107,572.48	58,557.80
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	330,315,624.89	273,382,785.09
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	–	–
应付赎回款	203,324.16	86,049.29
应付管理人报酬	383,512.01	351,796.15
应付托管费	63,918.67	58,632.71
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	723,508.49	255,104.15
应交税费	1,478,558.72	1,478,575.20
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	90,027.44	180,181.27
负债合计	2,942,849.49	2,410,338.77
所有者权益：		
实收基金	266,470,509.41	286,942,822.71
未分配利润	60,902,265.99	−15,970,376.39
所有者权益合计	327,372,775.40	270,972,446.32
负债和所有者权益总计	330,315,624.89	273,382,785.09

注：报告截止日2019年06月30日，基金份额净值1.211元，基金份额总额270,428,971.50份。

6.2 利润表

会计主体：富国天盛灵活配置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01月01日至2018年06月30日）
一、收入	88,426,151.29	−33,489,896.71
1.利息收入	374,270.14	942,705.48
其中：存款利息收入	321,536.53	402,548.48
债券利息收入	2,498.01	289,658.14
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	50,235.60	250,498.86
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“−”填列）	37,921,649.22	−14,709,821.65
其中：股票投资收益	34,854,204.22	−15,649,905.74
基金投资收益	–	–
债券投资收益	790,235.03	85,664.67
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具投资收益	–	–
股利收益	2,277,209.97	854,419.42
3.公允价值变动收益（损失以“−”号填列）	50,093,892.90	−19,842,015.83
4.汇兑收益（损失以“−”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“−”号填列）	36,339.03	119,235.29
减：二、费用	4,793,299.08	7,199,639.69
1．管理人报酬	2,261,919.80	2,655,975.45
2．托管费	376,986.61	442,662.55
3．销售服务费	–	–
4．交易费用	2,049,488.11	3,965,582.73
5．利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6．税金及附加	8.29	0.12
7．其他费用	104,896.27	135,418.84
三、利润总额（亏损总额以“−”号填列）	83,632,852.21	−40,689,536.40
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“−”号填列）	83,632,852.21	−40,689,536.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天盛灵活配置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）	286,942,822.71	−15,970,376.39	270,972,446.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	83,632,852.21	83,632,852.21
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）	−20,472,313.30	−361,896.17	−20,834,209.47
其中：1.基金申购款	21,351,056.11	4,021,913.83	25,372,969.94
2.基金赎回款	−41,823,369.41	−4,383,810.00	−46,207,179.41
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）	–	−6,398,313.66	−6,398,313.66
五、期末所有者权益（基金净值）	266,470,509.41	60,902,265.99	327,372,775.40
项目	上年度可比期间（2018年01月01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）	273,739,178.41	78,071,056.52	351,810,234.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	−40,689,536.40	−40,689,536.40
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）	20,236,361.11	7,864,431.78	28,100,792.89
其中：1.基金申购款	56,376,060.52	13,743,213.45	70,119,273.97
2.基金赎回款	−36,139,699.41	−5,878,781.67	−42,018,481.08
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）	–	−30,800,854.96	−30,800,854.96
五、期末所有者权益（基金净值）	293,975,539.52	14,445,096.94	308,420,636.46

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：

陈 戈	林志松	徐慧
基金管理公司负责人	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

根据汉盛证券投资基金（以下简称“基金汉盛”）基金份额持有人大会审议通过的《关于汉盛证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证券基金机构监管部部函[2014]67号《关于汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》）及上海证券交易所自律监管决定书[2014]172号文《关于终止汉盛证券投资基金上市的决定》的同意，基金汉盛于2014年4月30日终止上市，原《汉盛证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年4月30日起生效，基金汉盛更名为“富国天盛混合型证券投资基金”（以下简称“本基金”），基金正式转型为契约型开放式，存续期限调整为不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《富国天盛混合型证券投资基金招募说明书》和《富国天盛混合型证券投资基金集中申购结果暨原汉盛证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，基金管理人富国基金管理有限公司确定2014年6月4日为基金汉盛基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为1.015元，精确到小数点后第9位为1.014909401元（第10位舍去），本基金管理人按照1.014909401的折算比例对原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为1.000元，折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例，采用截尾法保留到整数位，所产生的误差归入基金财产。折算前原汉盛证券投资基金份额总额为2亿份，折算后基金份额总额为1,834,804,944.82份。富国基金管理有限公司已根据上述折算比例向登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司提出基金份额的变更登记申请，登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司已于2014年6月4日对各基金份额持有人持有的基金份额予以变更登记。

本基金于基金合同生效后自2014年5月12日至2014年5月30日止期间内开放集中申购，集中申购期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2014）验字第60467606_B06号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本基金集中申购期募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币108,841,235.65元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币7,914.39元，以上实收基金（本息）合计为人民币108,849,150.04元，折合108,849,150.04份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（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、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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的相关规定）。未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单、期权的，本基金可参与同业存单、期权的投资，不需召开持有人大会。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。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%－95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%－3%，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，现金或者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。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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，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2019年1月1日至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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

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征增值税试点的通知》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，未缴纳增值税的，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。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

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
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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

金额单位：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）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	445,482,186.17	31.45	863,853,392.77	33.46
申万宏源	158,817,123.00	11.21	184,870,612.83	7.16

6.4.8.1.2 权证交易

注：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

金额单位：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）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	6,368,237.90	100.00	–	–

6.4.8.1.4 回购交易

金额单位：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）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	–	–	30,000,000.00	11.24

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2019年01月01日至2019年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	144,730.60	11.12	49,213.13	6.80
海通证券	409,663.75	31.47	109,130.64	15.08
关联方名称	上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	169,857.54	7.15	169,857.54	13.21
海通证券	795,688.20	33.50	341,570.59	26.56

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	2,261,919.80	2,655,975.45
其中：支付销售机构的客户维护费	307,521.92	316,351.54

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。

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	376,986.61	442,662.55

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。

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：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（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

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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
中国农业银行股份有限公司	22,787,138.77	307,693.96	229,040,116.06	377,517.05

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

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

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

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股认购	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	–

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：截至本报告期末2019年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1公允价值

6.4.14.1.1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。

6.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1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305,490,712.58元，属于第二层次的余额为人民币33,869.94元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2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。

6.4.14.1.2.3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：

上年度末余额人民币1,285,431.69元，本期变动人民币−1,285,431.69元，本期末人民币0.00元。

6.4.14.2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。

6.4.14.3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	305,524,582.52	92.49
	其中：股票	305,524,582.52	92.49
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	24,329,146.82	7.37
8	其他各项资产	461,895.55	0.14
9	合计	330,315,624.89	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

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	1,234,595.70	0.38
C	制造业	219,982,461.09	67.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,063,024.00	0.94
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	6,951,612.00	2.12
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,449,861.76	11.74
J	金融业	20,500,193.69	6.26
K	房地产业	8,355,924.28	2.55
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	6,986,910.00	2.13
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	305,524,582.52	93.33

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	000858	五粮液	229,259	27,041,099.05	8.26
2	000568	泸州老窖	331,644	26,806,784.52	8.19
3	600519	贵州茅台	25,892	25,477,728.00	7.78
4	000651	格力电器	375,361	20,644,855.00	6.31
5	002001	新和成	871,906	16,819,066.74	5.14
6	000661	长春高新	42,047	14,211,886.00	4.34
7	603589	口子窖	208,856	13,454,503.52	4.11
8	300226	上海钢联	153,768	11,526,449.28	3.52
9	601601	中国太保	246,525	9,000,627.75	2.75
10	002304	洋河股份	72,200	8,776,632.00	2.68

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司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	002001	新和成	31,817,816.36	11.74
2	600216	浙江医药	21,942,571.74	8.10
3	000568	泸州老窖	21,197,813.03	7.82
4	600048	保利地产	20,705,236.26	7.64
5	000651	格力电器	20,443,305.53	7.54
6	000858	五粮液	19,689,424.54	7.27
7	002368	太极股份	18,971,383.17	7.00
8	000661	长春高新	18,588,886.00	6.86
9	000951	中国重汽	17,810,190.54	6.57
10	300226	上海钢联	17,721,358.00	6.54
11	600050	中国联通	16,224,247.19	5.99
12	000799	酒鬼酒	15,976,627.02	5.90
13	601211	国泰君安	15,631,928.84	5.77
14	002063	远光软件	15,617,605.15	5.76
15	600809	山西汾酒	14,176,806.00	5.23
16	002544	杰赛科技	13,329,699.39	4.92
17	300369	绿盟科技	12,861,216.00	4.75
18	002572	索菲亚	12,596,080.03	4.65
19	002304	洋河股份	12,554,798.99	4.63
20	601555	东吴证券	12,522,625.80	4.62
21	601601	中国太保	12,345,410.05	4.56
22	600085	同仁堂	12,256,047.67	4.52
23	603589	口子窖	11,793,238.00	4.35
24	600731	湖南海利	11,523,650.00	4.25
25	002741	光华科技	11,271,138.95	4.16
26	600498	烽火通信	11,015,462.24	4.07
27	002234	民和股份	10,950,824.38	4.04
28	002912	中新赛克	9,740,384.00	3.59
29	600990	四创电子	9,497,570.00	3.50
30	000333	美的集团	9,475,822.49	3.50
31	601318	中国平安	9,446,344.00	3.49
32	002439	启明星辰	9,362,908.34	3.46
33	600166	福田汽车	9,014,788.00	3.33
34	002458	益生股份	8,700,582.31	3.21
35	300101	振芯科技	8,545,357.00	3.15
36	300498	温氏股份	8,355,213.00	3.08
37	600779	水井坊	8,344,269.07	3.08
38	002142	宁波银行	8,208,058.10	3.03
39	601336	新华保险	8,115,460.93	2.99
40	000961	中南建设	7,947,947.98	2.93
41	601628	中国人寿	7,902,922.82	2.92
42	002935	天奥电子	7,847,047.76	2.90
43	002299	圣农发展	7,278,958.02	2.69
44	600104	上汽集团	6,573,454.00	2.43
45	300365	恒华科技	6,424,028.70	2.37
46	002352	顺丰控股	6,403,799.16	2.36
47	002440	闰土股份	6,332,681.96	2.34
48	603882	金域医学	6,310,374.00	2.33
49	000002	万科A	6,267,087.27	2.31
50	601128	常熟银行	6,243,710.95	2.30
51	600161	天坛生物	6,148,604.70	2.27
52	601688	华泰证券	6,140,404.54	2.27
53	002024	苏宁易购	6,129,187.00	2.26
54	601398	工商银行	6,121,290.00	2.26
55	601333	广深铁路	6,120,069.00	2.26
56	600036	招商银行	6,096,159.00	2.25
57	300294	博雅生物	6,092,418.00	2.25
58	600380	健康元	6,043,714.12	2.23
59	600702	舍得酒业	5,903,983.88	2.18
60	002683	宏大爆破	5,504,003.00	2.03
61	300377	赢时胜	5,466,700.55	2.02
62	601800	中国交建	5,440,521.00	2.01

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	600809	山西汾酒	20,126,537.95	7.43
2	000951	中国重汽	19,058,794.81	7.03
3	002368	太极股份	17,621,777.31	6.50
4	600050	中国联通	17,372,464.00	6.41
5	002458	益生股份	16,993,816.51	6.27
6	002234	民和股份	16,918,940.00	6.24
7	002001	新和成	16,859,204.13	6.22
8	000799	酒鬼酒	15,857,898.13	5.85
9	600216	浙江医药	13,927,181.73	5.14
10	601555	东吴证券	12,845,183.57	4.74
11	600048	保利地产	12,522,174.40	4.62
12	002572	索菲亚	11,949,535.00	4.41
13	600731	湖南海利	11,873,977.80	4.38
14	002741	光华科技	11,553,251.87	4.26
15	600498	烽火通信	11,213,093.00	4.14
16	601211	国泰君安	10,665,085.00	3.94
17	002063	远光软件	10,513,806.09	3.88
18	300369	绿盟科技	10,507,523.00	3.88
19	000568	泸州老窖	9,965,981.76	3.68
20	000858	五粮液	9,835,907.55	3.63
21	002299	圣农发展	9,779,686.66	3.61
22	002142	宁波银行	9,391,570.67	3.47
23	600990	四创电子	9,237,767.00	3.41
24	600166	福田汽车	8,944,026.49	3.30
25	600085	同仁堂	8,269,527.00	3.05
26	601628	中国人寿	8,069,302.90	2.98
27	601336	新华保险	7,869,437.00	2.90
28	002544	杰赛科技	7,711,855.00	2.85
29	300498	温氏股份	7,706,352.12	2.84
30	600519	贵州茅台	7,385,859.50	2.73
31	300226	上海钢联	7,290,766.32	2.69
32	000002	万科A	7,095,710.00	2.62
33	000961	中南建设	6,904,813.32	2.55
34	600702	舍得酒业	6,779,643.00	2.50
35	600380	健康元	6,645,145.46	2.45
36	002304	洋河股份	6,484,728.60	2.39
37	000661	长春高新	6,391,553.85	2.36
38	600104	上汽集团	6,363,324.00	2.35
39	300365	恒华科技	6,265,668.59	2.31
40	002746	仙坛股份	6,231,380.08	2.30
41	603589	口子窖	6,227,107.58	2.30
42	601128	常熟银行	6,030,045.63	2.23
43	300294	博雅生物	6,008,290.80	2.22
44	601398	工商银行	6,004,422.00	2.22
45	601688	华泰证券	5,986,532.00	2.21
46	600036	招商银行	5,983,486.88	2.21
47	002440	闰土股份	5,914,330.12	2.18
48	601333	广深铁路	5,888,789.00	2.17
49	002024	苏宁易购	5,844,688.00	2.16
50	601155	新城控股	5,485,774.05	2.02

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	794,410,135.95
卖出股票收入（成交）总额	622,104,585.37

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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投资。

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

公允价值变动总额合计(元)	–
股指期货投资本期收益(元)	–
股指期货投资本期公允价值变动(元)	–

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	–
国债期货投资本期收益（元）	–
国债期货投资本期公允价值变动（元）	–

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本报告期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	348,322.20
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	6,000.87
5	应收申购款	107,572.48
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	461,895.55

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

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
7,507	36,023.57	998,473.99	0.37	269,430,497.51	99.63

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	39,500.08	0.0146

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年04月30日)基金份额总额	2,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	291,209,583.86
本报告期基金总申购份额	21,671,314.23
减：本报告期基金总赎回份额	42,451,926.59
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	270,428,971.50

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2019年2月23日发布公告，薛爱东先生自2019年2月22日起不再担任公司董事长，由陈戈先生代行公司董事长职责。

本基金管理人于2019年3月28日发布公告，裴长江先生自2019年3月27日起担任公司董事长。

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
安信证券	2	63,584,538.40	4.49	–	–	–	–	–	–	57,944.54	4.45	–
光大证券	2	614,292,479.34	43.37	–	–	50,000,000.00	100.00	–	–	565,789.08	43.46	–
国海证券	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
国金证券	2	24,880,545.97	1.76	–	–	–	–	–	–	22,673.44	1.74	–
国泰君安	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
海通证券	2	445,482,186.17	31.45	6,368,237.90	100.00	–	–	–	–	409,663.75	31.47	–
华泰证券	1	46,767,157.02	3.30	–	–	–	–	–	–	42,619.14	3.27	–
申万宏源	2	158,817,123.00	11.21	–	–	–	–	–	–	144,730.60	11.12	–
银河证券	1	62,604,034.92	4.42	–	–	–	–	–	–	58,302.79	4.48	–
招商证券	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
中泰证券	1	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2019-01-01至2019-06-30	95,901,665.46	1,848,614.34	466,009.38	97,284,270.42	35.97%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							