



(上接B433版)

| 项目                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应<br>支付的管理费  | 653,808.50                     | 763,743.32                          |
| 其中:支付销售机构<br>的客户维护费 | 104,111.28                     | 137,943.99                          |

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。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

| 项目                 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 |
|--------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应<br>支付的托管费 | 108,968.07                     | 127,290.55                          |

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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:本基金于本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。

6.4.8.4 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:本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金份额,于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

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:除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

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

| 关联方名称  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30<br>日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|--------|--------------------------------|----------------------------|
| 中国建设银行 | 996,184.88                     | 611,802.00                 |
| 当期利息收入 | 6,396.76                       | 20,854.31                  |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,并按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
注:本基金于本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。

6.4.9 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

| 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  | 单位估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------|-----------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 601261 | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年7月5日 | 新股上市   | 3.46  | 3.46   | 9,789    | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |
| 300788 | 中信出版 | 2019年6月27日 | 2019年7月5日 | 新股上市   | 14.85 | 14.85  | 1,556    | 23,106.60 | 23,106.60 | -  |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票  
注:本基金本期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券

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为0.00元,无质押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购  
截止本报告期末2019年06月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无质押证券。

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

管理层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68,516,343.46元,划分为第二层次的余额为人民币4,658,356.54元,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和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃等情

况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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。

§7 投资组合报告  
7.1 期末基金资产组合情况

| 序号                | 项目            | 金额            | 占基金总资产的比例(%) |
|-------------------|---------------|---------------|--------------|
| 1                 | 权益投资          | 68,573,320.00 | 79.42        |
| 其中:股票             | 68,573,320.00 | 79.42         |              |
| 2                 | 基金投资          | -             | -            |
| 3                 | 固定收益投资        | 4,601,380.00  | 5.33         |
| 其中:债券             | 4,601,380.00  | 5.33          |              |
| 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      | 10,000,000.00 | 11.58        |
| 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  | 2,112,043.54  | 2.45         |
| 8                 | 其他各项资产        | 1,051,032.79  | 1.22         |
| 9                 | 合计            | 86,337,776.33 | 100.00       |

7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 行业类别           | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----------------|---------------|--------------|
| A 农、林、牧、渔业     | 5,944,479.00  | 6.95         |
| F 采矿业          | 1,481,933.65  | 1.73         |
| C 制造业          | 34,519,672.35 | 40.34        |
| D 电力、热力、燃气及生产  | -             | -            |
| 和供应业           | -             | -            |
| E 建筑业          | -             | -            |
| F 批发和零售业       | 2,766,910.00  | 3.23         |
| 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 | 12,087,171.36 | 14.12        |
| 服务业            | -             | -            |
| J 金融业          | 6,124,388.04  | 7.16         |
| K 房地产业         | 2,433,332.00  | 2.84         |
| L 租赁和商务服务业     | 1,531,375.00  | 1.81         |
| M 科学研究和技术服务业   | 1,640,952.00  | 1.92         |
| 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    | 23,106.60     | 0.03         |
| S 综合           | -             | -            |
| 合计             | 68,573,320.00 | 80.13        |

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

| 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  | 600984 | 建设机械 | 673,500 | 4,411,425.00 | 5.15         |
| 2  | 002402 | 和而泰  | 395,600 | 3,746,332.00 | 4.38         |
| 3  | 300498 | 蓝氏股份 | 99,700  | 3,575,242.00 | 4.18         |
| 4  | 300078 | 思创医惠 | 335,131 | 3,421,687.51 | 4.00         |
| 5  | 300349 | 金卡智能 | 180,600 | 3,211,068.00 | 3.75         |
| 6  | 000568 | 泸州老窖 | 39,400  | 3,184,702.00 | 3.72         |
| 7  | 601933 | 永辉超市 | 271,000 | 2,766,910.00 | 3.23         |
| 8  | 603589 | 口子窖  | 40,800  | 2,628,336.00 | 3.07         |
| 9  | 300271 | 华宇软件 | 133,600 | 2,538,400.00 | 2.97         |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 45,600  | 2,508,000.00 | 2.93         |

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

| 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  | 000651 | 格力电器 | 7,029,152.00 | 8.72           |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 6,346,731.92 | 7.87           |
| 3  | 600837 | 海通证券 | 5,820,274.00 | 7.22           |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 5,291,270.00 | 6.57           |
| 5  | 002124 | 天邦股份 | 5,085,668.52 | 6.31           |
| 6  | 002714 | 牧原股份 | 5,041,804.00 | 6.26           |
| 7  | 002236 | 大华股份 | 4,966,454.00 | 6.16           |
| 8  | 000002 | 万科A  | 4,449,462.00 | 5.52           |
| 9  | 600984 | 建设机械 | 4,408,429.90 | 5.47           |
| 10 | 002157 | 正邦科技 | 4,399,347.00 | 5.46           |
| 11 | 603985 | 恒润股份 | 4,193,130.70 | 5.20           |
| 12 | 002548 | 金新农  | 4,141,356.12 | 5.14           |
| 13 | 300271 | 华宇软件 | 4,083,064.00 | 5.07           |
| 14 | 002402 | 和而泰  | 3,690,190.86 | 4.58           |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 3,675,738.00 | 4.56           |
| 16 | 300349 | 金卡智能 | 3,656,627.89 | 4.54           |
| 17 | 002129 | 中环股份 | 3,511,855.00 | 4.36           |
| 18 | 002035 | 华帝股份 | 3,472,174.00 | 4.31           |
| 19 | 002304 | 洋河股份 | 3,381,389.00 | 4.20           |
| 20 | 603816 | 欧家家居 | 3,296,919.00 | 4.09           |
| 21 | 600438 | 通威股份 | 3,267,453.90 | 4.05           |
| 22 | 000401 | 黄东水泥 | 3,185,826.35 | 3.95           |
| 23 | 000625 | 长安汽车 | 3,138,246.00 | 3.89           |
| 24 | 002624 | 完美世界 | 3,101,367.40 | 3.85           |
| 25 | 002508 | 老板电器 | 2,992,493.00 | 3.71           |
| 26 | 300348 | 长亮科技 | 2,991,101.30 | 3.71           |
| 27 | 300498 | 蓝氏股份 | 2,957,721.00 | 3.67           |
| 28 | 600340 | 华夏幸福 | 2,856,241.00 | 3.54           |
| 29 | 300166 | 东方国信 | 2,726,960.00 | 3.38           |
| 30 | 601336 | 新华保险 | 2,715,947.24 | 3.37           |
| 31 | 603601 | 再升科技 | 2,688,520.76 | 3.34           |
| 32 | 601933 | 永辉超市 | 2,632,685.00 | 3.27           |
| 33 | 000858 | 五粮液  | 2,622,662.00 | 3.25           |
| 34 | 300339 | 润和软件 | 2,617,782.00 | 3.25           |
| 35 | 603589 | 口子窖  | 2,532,124.00 | 3.17           |
| 36 | 600732 | ST新梅 | 2,522,481.00 | 3.13           |
| 37 | 601877 | 正泰电器 | 2,363,063.00 | 2.93           |
| 38 | 002746 | 仙坛股份 | 2,323,657.32 | 2.88           |
| 39 | 300207 | 欣旺达  | 2,215,877.40 | 2.75           |
| 40 | 002080 | 中材科技 | 2,085,934.10 | 2.59           |
| 41 | 002020 | 金风科技 | 2,002,245.26 | 2.48           |
| 42 | 600926 | 杭州银行 | 1,947,033.00 | 2.42           |
| 43 | 600919 | 江苏银行 | 1,944,906.00 | 2.41           |
| 44 | 601688 | 华泰证券 | 1,886,452.00 | 2.34           |
| 45 | 300327 | 中顺电子 | 1,871,732.00 | 2.32           |
| 46 | 002373 | 千方科技 | 1,866,326.00 | 2.32           |
| 47 | 002398 | 建研集团 | 1,864,534.20 | 2.31           |
| 48 | 600031 | 三一重工 | 1,862,808.50 | 2.31           |
| 49 | 601668 | 中国建筑 | 1,855,100.00 | 2.30           |
| 50 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 1,848,536.00 | 2.29           |
| 51 | 600466 | 蓝光发展 | 1,842,983.81 | 2.29           |
| 52 | 300244 | 迪安诊断 | 1,841,855.00 | 2.29           |
| 53 | 002110 | 三钢闽光 | 1,840,494.22 | 2.28           |
| 54 | 300633 | 开立医疗 | 1,829,972.00 | 2.27           |
| 55 | 600845 | 宝信软件 | 1,828,386.00 | 2.27           |
| 56 | 600271 | 航天信息 | 1,816,844.58 | 2.25           |
| 57 | 300458 | 金志科技 | 1,795,980.00 | 2.23           |
| 58 | 002444 | 巨星科技 | 1,783,965.00 | 2.21           |
| 59 | 000717 | 韶钢松山 | 1,764,383.00 | 2.19           |
| 60 | 300316 | 晶盛机电 | 1,757,147.00 | 2.18           |
| 61 | 601198 | 东兴证券 | 1,754,493.00 | 2.18           |
| 62 | 000783 | 长江证券 | 1,736,842.00 | 2.15           |
| 63 | 002368 | 太极股份 | 1,736,606.00 | 2.15           |
| 64 | 300241 | 瑞丰光电 | 1,736,470.00 | 2.15           |
| 65 | 601689 | 拓普集团 | 1,734,059.00 | 2.15           |
| 66 | 300601 | 康泰生物 | 1,729,823.00 | 2.15           |
| 67 | 300232 | 洲明科技 | 1,724,424.00 | 2.14           |
| 68 | 000786 | 北新建材 | 1,704,180.00 | 2.11           |
| 69 | 002449 | 国星光电 | 1,687,893.61 | 2.09           |
| 70 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,680,847.40 | 2.09           |
| 71 | 603043 | 广州酒家 | 1,676,731.00 | 2.08           |
| 72 | 300418 | 昆仑万维 | 1,674,738.00 | 2.08           |
| 73 | 300569 | 天能重工 | 1,615,724.60 | 2.00           |

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

7.4.2 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

| 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  | 002157 | 正邦科技 | 6,564,170.73 | 8.14 |              |
| 2  | 002531 | 天顺风能 | 5,745,300.25 | 7.13 |              |
| 3  | 300443 | 金雷股份 | 5,188,570.08 | 6.44 |              |
| 4  | 002236 | 大华股份 | 4,936,016.00 | 6.12 |              |
| 5  | 603985 | 恒润股份 | 4,918,566.06 | 6.10 |              |
| 6  | 000002 | 万科A  | 4,598,726.00 | 5.71 |              |
| 7  | 600837 | 海通证券 | 4,566,624.00 | 5.67 |              |
| 8  | 600048 | 保利地产 | 4,563,262.33 | 5.66 |              |
| 9  | 002548 | 金新农  | 4,436,217.05 | 5.50 |              |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 4,236,249.57 | 5.26 |              |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 4,233,915.90 | 5.25 |              |
| 12 | 300271 | 华宇软件 | 3,897,825.42 | 4.84 |              |
| 13 | 002124 | 天邦股份 | 3,764,301.92 | 4.67 |              |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 3,585,756.85 | 4.45 |              |
| 15 | 002304 | 洋河股份 | 3,468,733.10 | 4.30 |              |
| 16 | 000625 | 长安汽车 | 3,353,478.10 | 4.16 |              |
| 17 | 002508 | 老板电器 | 3,310,852.89 | 4.11 |              |
| 18 | 002035 | 华帝股份 | 3,297,836.00 | 4.09 |              |
| 19 | 002624 | 完美世界 | 3,202,230.00 | 3.85 |              |
| 20 | 002714 | 牧原股份 | 3,075,428.00 | 3.82 |              |
| 21 | 603816 | 欧家家居 | 2,980,029.00 | 3.70 |              |
| 22 | 603313 | 梦百合  | 2,976,155.00 | 3.69 |              |
| 23 | 300339 | 润和软件 | 2,962,409.00 | 3.68 |              |
| 24 | 000401 | 黄东水泥 | 2,947,381.20 | 3.66 |              |
| 25 | 000858 | 五粮液  | 2,865,451.14 | 3.56 |              |
| 26 | 002604 | 华峰氨纶 | 2,854,593.00 | 3.54 |              |
| 27 | 300166 | 东方国信 | 2,797,177.00 | 3.47 |              |
| 28 | 600340 | 华夏幸福 | 2,754,246.00 | 3.42 |              |
| 29 | 601336 | 新华保险 | 2,743,803.00 | 3.40 |              |
| 30 | 600027 | 华电国际 | 2,675,023.92 | 3.32 |              |
| 31 | 002746 | 仙坛股份 | 2,638,163.97 | 3.27 |              |
| 32 | 601899 | 紫金矿业 | 2,584,566.44 | 3.21 |              |
| 33 | 600373 | 中文传媒 | 2,580,323.00 | 3.20 |              |
| 34 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,422,875.64 | 3.01 |              |
| 35 | 600732 | ST新梅 | 2,415,518.00 | 3.00 |              |
| 36 | 601877 | 正泰电器 | 2,401,652.00 | 2.98 |              |
| 37 | 300498 | 蓝氏股份 | 2,340,332.00 | 2.90 |              |
| 38 | 300241 | 瑞丰光电 | 2,257,409.40 | 2.81 |              |
| 39 | 300207 | 欣旺达  | 2,240,262.00 | 2.78 |              |
| 40 | 600845 | 宝信软件 | 2,054,942.00 | 2.55 |              |
| 41 | 002202 | 金风科技 | 2,016,136.84 | 2.50 |              |
| 42 | 601222 | 林洋能源 | 2,000,643.95 | 2.48 |              |
| 43 | 600786 | 北新建材 | 1,982,281.00 | 2.46 |              |
| 44 | 300327 | 中顺电子 | 1,876,089.00 | 2.33 |              |
| 45 | 300418 | 昆仑万维 | 1,854,471.00 | 2.30 |              |
| 46 | 300188 | 美亚光电 | 1,844,619.80 | 2.29 |              |
| 47 | 002449 | 国星光电 | 1,844,156.10 | 2.29 |              |
| 48 | 300348 | 长亮科技 | 1,842,100.00 | 2.29 |              |
| 49 | 600919 | 江苏银行 | 1,840,034.00 | 2.28 |              |
| 50 | 002110 | 三钢闽光 | 1,828,491.00 | 2.27 |              |
| 51 | 600466 | 蓝光发展 | 1,819,806.00 | 2.26 |              |
| 52 | 600519 | 贵州茅台 | 1,807,911.20 | 2.24 |              |
| 53 | 300012 | 华测检测 | 1,805,639.00 | 2.24 |              |
| 54 | 002444 | 巨星科技 | 1,798,148.78 | 2.23 |              |
| 55 | 601668 | 中国建筑 | 1,789,973.00 | 2.22 |              |
| 56 | 000717 | 韶钢松山 | 1,776,361.00 | 2.20 |              |
| 5  |        |      |              |      |              |