

(上接B433版)

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	653,808.50	763,743.32
其中:支付销售机构的客户维护费	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 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	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 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 996,184.88	当期利息收入 6,396.76
中国建设银行		期末余额 611,802.00
		当期利息收入 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

单位:人民币元										
6.4.9.1.1 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	单位估值	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
	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,本基金本报告期末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

序号	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
B	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、软件和信息技术服务业	12,087,171.36	14.12
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	温氏股份	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	恒顺股份	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	3,675,736.00	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	顾家家居	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	长光科技	2,991,101.30	3.71
27	300498	温氏股份	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	2,215,877.44	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	深信软件	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	4,306,016.00	6.12	
5	603985	恒顺股份	4,918,566.06	6.10	
6	000002	万科A	4,598,726.00	5.71	
7	600837	海通证券	4,564,624.00	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	3,468,733.81	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	3,102,230.00	3.85	
20	002714	牧原股份	3,075,428.00	3.82	
21	603816	顾家家居	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	温氏股份	2,340,332.00	2.90	
38	300241	瑞丰光电	2,257,409.40	2.80	
39	300207	欣旺达	2,240,262.00	2.78	
40	600845	深信软件	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	长光科技	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	6005				