

(上接B435版)

6.4.8.4.2 报告期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未持有本基金份额。本基金基金合同于2018年8月13日生效,无上年度可比期间数据。

6.4.8.5 与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		当期利息收入
	期末余额	期初余额	
中国建设银行	7,403,402.77	—	13,346.46

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。本基金基金合同于2018年8月13日生效,无上年度可比期间数据。

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:本基金于本期末在承销期内直接购入关联方承销证券。本基金基金合同于2018年8月13日生效,无上年度可比期间数据。

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

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
002036	双环传动	1,346,000	12,174.64	—

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

截至本报告期末2019年6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
7.4.14.1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。
7.4.14.2其他事项

(1)公允价值
本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、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06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74,200,135.53元,划分为第二层次的余额为人民币32,174.54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,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重大影响程度,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,本基金本报告期末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

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	74,222,210.07	86.52
2	债券投资	74,222,210.07	86.52
3	货币市场基金	—	—
4	其他资产	—	—
5	其他负债	—	—
6	资产支持证券	—	—
7	其他资产	—	—
8	其他负债	—	—
9	其他资产	—	—
10	其他负债	—	—
11	其他资产	—	—
12	其他负债	—	—
13	其他资产	—	—
14	其他负债	—	—
15	其他资产	—	—
16	其他负债	—	—
17	其他资产	—	—
18	其他负债	—	—
19	其他资产	—	—
20	其他负债	—	—
21	其他资产	—	—
22	其他负债	—	—
23	其他资产	—	—
24	其他负债	—	—
25	其他资产	—	—
26	其他负债	—	—
27	其他资产	—	—
28	其他负债	—	—
29	其他资产	—	—
30	其他负债	—	—
31	其他资产	—	—
32	其他负债	—	—
33	其他资产	—	—
34	其他负债	—	—
35	其他资产	—	—
36	其他负债	—	—
37	其他资产	—	—
38	其他负债	—	—
39	其他资产	—	—
40	其他负债	—	—
41	其他资产	—	—
42	其他负债	—	—
43	其他资产	—	—
44	其他负债	—	—
45	其他资产	—	—
46	其他负债	—	—
47	其他资产	—	—
48	其他负债	—	—
49	其他资产	—	—
50	其他负债	—	—
51	其他资产	—	—
52	其他负债	—	—
53	其他资产	—	—
54	其他负债	—	—
55	其他资产	—	—
56	其他负债	—	—
57	其他资产	—	—
58	其他负债	—	—
59	其他资产	—	—
60	其他负债	—	—
61	其他资产	—	—
62	其他负债	—	—
63	其他资产	—	—
64	其他负债	—	—
65	其他资产	—	—
66	其他负债	—	—
67	其他资产	—	—
68	其他负债	—	—
69	其他资产	—	—
70	其他负债	—	—
71	其他资产	—	—
72	其他负债	—	—
73	其他资产	—	—
74	其他负债	—	—
75	其他资产	—	—
76	其他负债	—	—
77	其他资产	—	—
78	其他负债	—	—
79	其他资产	—	—
80	其他负债	—	—
81	其他资产	—	—
82	其他负债	—	—
83	其他资产	—	—
84	其他负债	—	—
85	其他资产	—	—
86	其他负债	—	—
87	其他资产	—	—
88	其他负债	—	—
89	其他资产	—	—
90	其他负债	—	—
91	其他资产	—	—
92	其他负债	—	—
93	其他资产	—	—
94	其他负债	—	—
95	其他资产	—	—
96	其他负债	—	—
97	其他资产	—	—
98	其他负债	—	—
99	其他资产	—	—
100	其他负债	—	—
101	其他资产	—	—
102	其他负债	—	—
103	其他资产	—	—
104	其他负债	—	—
105	其他资产	—	—
106	其他负债	—	—
107	其他资产	—	—
108	其他负债	—	—
109	其他资产	—	—
110	其他负债	—	—
111	其他资产	—	—
112	其他负债	—	—
113	其他资产	—	—
114	其他负债	—	—
115	其他资产	—	—
116	其他负债	—	—
117	其他资产	—	—
118	其他负债	—	—
119	其他资产	—	—
120	其他负债	—	—
121	其他资产	—	—
122	其他负债	—	—
123	其他资产	—	—
124	其他负债	—	—
125	其他资产	—	—
126	其他负债	—	—
127	其他资产	—	—
128	其他负债	—	—
129	其他资产	—	—
130	其他负债	—	—
131	其他资产	—	—
132	其他负债	—	—
133	其他资产	—	—
134	其他负债	—	—
135	其他资产	—	—
136	其他负债	—	—
137	其他资产	—	—
138	其他负债	—	—
139	其他资产	—	—
140	其他负债	—	—
141	其他资产	—	—
142	其他负债	—	—
143	其他资产	—	—
144	其他负债	—	—
145	其他资产	—	—
146	其他负债	—	—
147	其他资产	—	—
148	其他负债	—	—
149	其他资产	—	—
150	其他负债	—	—
151	其他资产	—	—
152	其他负债	—	—
153	其他资产	—	—
154	其他负债	—	—
155	其他资产	—	—
156	其他负债	—	—
157	其他资产	—	—
158	其他负债	—	—
159	其他资产	—	—
160	其他负债	—	—
161	其他资产	—	—
162	其他负债	—	—
163	其他资产	—	—
164	其他负债	—	—
165	其他资产	—	—
166	其他负债	—	—
167	其他资产	—	—
168	其他负债	—	—
169	其他资产	—	—
170	其他负债	—	—
171	其他资产	—	—
172	其他负债	—	—
173	其他资产	—	—
174	其他负债	—	—
175	其他资产	—	—
176	其他负债	—	—
177	其他资产	—	—
178	其他负债	—	—
179	其他资产	—	—
180	其他负债	—	—
181	其他资产	—	—
182	其他负债	—	—
183	其他资产	—	—
184	其他负债	—	—
185	其他资产	—	—
186	其他负债	—	—
187	其他资产	—	—
188	其他负债	—	—
189	其他资产	—	—
190	其他负债	—	—
191	其他资产	—	—
192	其他负债	—	—
193	其他资产	—	—
194	其他负债	—	—
195	其他资产	—	—
196	其他负债	—	—
197	其他资产	—	—
198	其他负债	—	—
199	其他资产	—	—
200	其他负债	—	—

7.2 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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,393,180.00	1.63
B	制造业	1,389,410.00	1.63
C	建筑业	28,471,400.00	34.01
D	批发和零售业	2,329,770.00	2.82
E	交通运输、仓储和邮政业	1,147,330.00	1.40
F	信息传输、软件和信息技术服务业	2,640,420.00	3.23
G	金融业	2,436,480.00	2.98
H	房地产业	—	—
I	租赁和商务服务业	6,516,210.00	7.97
J	科学研究和技术服务业	4,000,000.00	4.92
K	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,390,110.00	4.13
L	采矿业	947,480.00	1.16
M	住宿和餐饮业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	688,260.00	0.84
O	卫生和社会工作	1,213,720.00	1.48
P	教育	1,289,130.00	1.58
Q	文化、体育和娱乐业	1,137,210.00	1.39
R	综合	61,479,010.00	75.06

7.2.1 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	116,020.00	0.14
B	制造业	1,389,410.00	1.63
C	建筑业	28,471,400.00	34.01
D	批发和零售业	2,329,770.00	2.82
E	交通运输、仓储和邮政业	1,147,330.00	1.40
F	信息传输、软件和信息技术服务业	2,640,420.00	3.23
G	金融业	2,436,480.00	2.98
H	房地产业	—	—
I	租赁和商务服务业	6,516,210.00	7.97
J	科学研究和技术服务业	4,000,000.00	4.92
K	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,390,110.00	4.13
L	采矿业	947,480.00	1.16
M	住宿和餐饮业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	688,260.00	0.84
O	卫生和社会工作	1,213,720.00	1.48
P	教育	1,289,130.00	1.58
Q	文化、体育和娱乐业	1,137,210.00	1.39
R	综合	61,479,010.00	75.06

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

7.3.1 期末指数投资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	002036	双环传动	387,360	3,457,020.00	4.20
2	002429	天虹股份	1,361,000	1,361,000.00	1.63
3	002603	盛通股份	96,200	1,299,280.00	1.59
4	000065	东方集团	1,361,000	1,286,670.00	1.58
5	000025	特力A	1,361,000	1,286,670.00	1.58
6	000069	侨兴能源	1,361,000	1,286,670.00	1.58
7	002037	中农联合	88,400	1,213,720.00	1.48
8	002036	双环传动	47,400	1,393,180.00	1.63
9	000069	侨兴能源	384,200	1,389,410.00	1.63
10	000069	侨兴能源	384,200	1,389,410.00	1.63

注:投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.ccfund.com.cn)的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000065	东方集团	47,400	4,286,020.00	5.20
2	000069	侨兴能源	2,300	209,750.00	0.26
3	000062	金瑞矿业	4,400	157,760.00	0.19
4	000065	东方集团	46,000	107,420.00	0.13
5	002032	爱迪生	8,000	148,480.00	0.18

注:投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.ccfund.com.cn)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

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	002036	双环传动	2,380,790.00	30.80
2	002038	恒顺燃气	1,687,779.08	21.35
3	370303	约克股份	1,549,302.00	19.71
4	000019	中航特钢	1,545,207.00	19.58
5	002263	森鹿股份	1,527,162.00	19.38
6	001030	恒川食品	1,444,530.00	17.77
7	400266	北京绿建	1,411,329.80	17.65
8	002529	海普生	1,401,374.00	17.51
9	000443	爱建集团	1,394,332.00	17.32
10	002419	天虹百货	1,372,072.00	16.91
11	002668	伟明环保	1,356,388.00	16.11
12	000068	东方金港	1,352,280.00	16.04
13	002229	圣龙传媒	1,348,228.00	16.07
14	002228	振远通信	1,326,068.00	15.29
15	000779	东阿药用	1,207,107.00	14.21
16	002701	美盛香	1,206,101.00	14.05
17	000877	天山股份	1,206,594.00	14.05
18	002444	宏达电	1,206,700.00	14.04
19	400060	圣龙纸业	1,201,275.00	14.01
20	002016	欣源纸业	1,206,565.00	14.01
21	601039	均胜电子	1,241,242.00	14.26
22	002007	中欣药业	1,227,400.31	14.16
23	000066	昆玉发展	1,221,664.00	14.22
24	000763	盛康医疗	1,215,652.48	14.13
25	000833	顺美医疗	1,103,354.48	12.81
26	000028	中国能建	1,178,275.00	12.94
27	601008	中信特钢	1,172,466.00	12.80
28	002232	仙鹿制药	1,165,499.00	12.92
29	002563	森鹿股份	1,154,250.00	12.77
30	000076	顺泰医疗	1,146,982.00	12.72
31	300283	卫宁健康	1,138,567.00	12.91
32	002289	今创股	1,138,070.00	12.90
33	000031	大悦城	1,121,620.00	12.51
34	000086	宝创软件	1,091,940.00	12.36
35	000079	汇通物流	1,088,264.00	12.31
36	000543	恒顺燃气	1,063,779.08	12.07
37	200002	安河药业	1,057,040.00	12.06
38	300496	康力医药	1,040,262.00	12.92
39	002223	顺泰医疗	1,040,880.00	12.93