红土创新中证500指数增强型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:红土创新基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26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及其更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新中证500指数增强型发起式证券投资基金	
基金主代码	006783	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年2月25日	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,852,576.34份	
下属分级基金的基金简称:	中证500增强A	中证500增强C
下属分级基金的交易代码:	006783	006784
报告期末下属分级基金的份额总额	6,040,610.37份	5,811,965.97份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金,采取定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金,采取定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。未来,随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,在履行适当程序后相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,具有与标的指数类似的风险收益特征。

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		红土创新基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘	张燕
	联系电话	0755-33011878	0755-83199084
	电子邮箱	zhangxc@htcxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		0755-33011866	95555
传真		0755-33011855	0755-83195201

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.htcxfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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

基金级别	中证500增强A	中证500增强C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年2月25日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年2月25日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	190,565.70	153,437.81
本期利润	79,545.87	6,297.45
加权平均基金份额本期利润	0.0131	0.0010
本期基金份额净值增长率	1.34%	1.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0134	0.0121
期末基金资产净值	6,121,765.52	5,882,080.56
期末基金份额净值	1.0134	1.0121

注:1.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。
2.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中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.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。

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
中证500增强A

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	2.10%	1.25%	0.76%	1.32%	1.34%	-0.07%
过去三个月	-7.27%	1.60%	-10.19%	1.72%	2.92%	-0.12%
自基金合同生效起至今	1.34%	1.62%	3.55%	1.85%	-2.21%	-0.23%

中证500增强C

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	2.08%	1.25%	0.76%	1.32%	1.32%	-0.07%
过去三个月	-7.37%	1.60%	-10.19%	1.72%	2.82%	-0.12%
自基金合同生效起至今	1.21%	1.62%	3.55%	1.85%	-2.34%	-0.23%

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.基金合同生效日至本报告期末不满一年。
2.本基金建仓期为六个月,截止本报告期期末尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
红土创新基金管理有限公司(以下简称"红土创新基金")经中国证监会证监许可【2014】562号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳,注册资本金为15亿元人民币,是国内首家创投系公募基金管理公司。
红土创新基金在深圳市创新投资集团有限公司,持有股权100%。
红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上,借力股东对创业投资行业的深入理解,外加国内独创的博士后工作站研究支持,充分利用一级市场优势向二级市场延伸,将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至2019年6月30日,红土创新基金共管理9只公募基金,资产管理规模85.72亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
庞世恩	基金经理	2019年4月19日	-	8	中国人民大学理学硕士。曾任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究总监、执行投资经理;创金合信基金管理有限公司量化投资部基金经理,管理过创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金、创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金。现任红土创新基金管理有限公司量化投资部负责人,担任红土创新沪深300指数增强型发起式证券投资基金、中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
储荞	基金经理	2019年2月25日	-	6	中国人民大学经济学硕士,历任鹏华基金管理有限公司量化研究员、创金合信基金管理有限公司量化研究员、投资经理。现任红土创新沪深300指数增强型发起式证券投资基金、红土创新中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施细则、本基金合同和其他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本基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。本基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。
4.3 管理人对报告期内诚实守信情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度执行情况
本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(试行)》,通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合,切实防范利益输送。本报告期,公平交易制度总体执行情况良好。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共30次,该基金为量化选股策略基金,发生反向交易行为的原因为:基金在确仓时点,多个选股模型在少数股票上产生分歧,产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易,全天均速慢成交,未对当天的股票价格产生冲击。
本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
回顾2019年上半年,我们严格依据量化选股模型进行投资,并严格进行风险管理。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末中证500增强A基金份额净值为1.0134元,本报告期基金份额净值增长率为1.34%;截至本报告期末中证500增强C基金份额净值为1.0121元,本报告期基金份额净值增长率为1.21%;同期业绩比较基准收益率为3.55%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
2019年上半年,在动荡国际大环境下,市场波动明显,主流的指数的波动情况显著提高,同时这也是下半年需要切实注的风险点,宏观经济们处于复杂阶段,经济增速风险不大;随着一季度过去,赚钱效应一度引发资金信心,孕育出一波市场机会;估值的角度来看,以中证500为代表的中小盘风格指数的估值处于历史底部区域,股票市场整体具备一定的估值吸引力,再加上科创板有望提振市场信心,我们对股市开本观。在投资管理上,我们坚持严格采用量化模型进行投资运作。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会和证券业协会制定的基金估值业务指引进行估值;
(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。
(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。
(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。
6.4.6 金融资产和金融负债的抵销
本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。
6.4.7 实收基金
实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。
6.4.8 损益平准金
损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金,已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按其计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按其计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末金额转入未分配利润/(累计亏损)。
6.4.9 收入/(损失)的确认和计量
股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。
应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
6.4.10 费用的确认和计量
本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。
其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
6.4.11 基金的收益分配政策
每一基金份额享有同等分配权,本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,因已实现部分相抵未实现部分后的余额。
经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。
6.4.12 分部报告
本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。
本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。
6.4.13 其他重要的会计政策和会计估计
根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:
对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌幅限价对的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号、中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见),根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。
6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
6.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期未发生会计政策变更。
6.4.5.2 会计估计变更的说明
本基金本报告期未发生会计估计变更。
6.4.5.3 差错更正的说明
本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。
6.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。
(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股票的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税;持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。
(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。
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
无。
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
红土创新基金管理有限公司("红土创新")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金销售机构
深圳市创新投资集团有限公司("深创投")	基金管理人的控股股东

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
无。
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
无。
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2月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	35,122.83
其中:支付销售机构的客户维护费	2,926.01

注:支付基金管理人红土创新的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.80%/ 当年天数。
6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年2月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,585.51

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值 × 0.15%/ 当年天数。
6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年2月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中证500增强A	中证500增强C	合计
红土创新	5,536.63	5,536.63	5,536.63
合计	-	5,536.63	5,536.63

注:支付基金管理人红土创新的C类销售服务费按前一日C类基金资产净值0.300%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日C类销售服务费=前一日C类基金资产净值 × 0.30%/ 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
无。
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2月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	中证500增强A	中证500增强C
基金合同生效日(2019年2月25日)持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.00
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	42.1900%	42.1900%

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
无。
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2月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	116,529.79	953.71

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。
6.4.8.7 其他关联交易事项的说明
无。
6.4.9 利润分配情况
无。
6.4.10 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
无。
6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
无。
6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购
无。
6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购
无。
6.4.11 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
(a) 金融工具公允价值计量的方法
公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:
第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。
(b) 持续的以公允价值计量的金融工具
(i) 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11,257,877.05元,属于第二层次的余额为615,369.00元,无属于第三层次的余额。
(ii) 公允价值所属层次间的重大变动
本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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将相关股票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,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。
(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额
无。
(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具
于2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。
(d) 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应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。
(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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,257,877.05	93.01
	其中:股票	11,257,877.05	93.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	615,369.00	5.08
	其中:债券	615,369.00	5.08
	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	196,120.47	1.62
8	其他各项资产	34,736.85	0.29
9	合计	12,104,103.37	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 期末指数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	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	80,665.00	0.67
B	采矿业	253,808.00	2.11
C	制造业	4,885,864.75	40.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	267,597.20	2.23
E	建筑业	232,929.80	1.94
F	批发和零售业	362,403.00	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	374,579.00	3.12
H	住宿和餐饮业	52,142.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	723,132.10	6.02
J	金融业	251,256.00	2.09
K	房地产业	524,866.40	4.37
L	租赁和商务服务业	150,677.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	38,082.00	0.32
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	291,231.00	2.43
S	综合	102,110.00	0.85
	合计	8,591,343.25	71.57

7.2.2 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	47,684.00	0.40
C	制造业	1,446,174.30	12.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,378.00	1.09
E	建筑业	46,483.00	0.39
F	批发和零售业	180,071.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	45,759.00	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,317.00	2.09
J	金融业	156,332.00	1.30
K	房地产业	188,335.50	1.57
L	租赁和商务服务业	38,144.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	22,725.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	25,608.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	61,680.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	25,873.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	2,666,533.80	22.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
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所有股票投资明细

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	600779	水 井 坊	1,600	81,312.00	0.68
2	000860	顺鑫农业	1,710	79,771.50	0.66
3	600426	华鲁恒升	5,300	79,758.00	0.66
4	000401	冀东水泥	4,300	75,723.00	0.63
5	300383	光环新网	4,400	73,788.00	0.61
6	002195	二三四五	18,690	72,704.10	0.61
7	002223	鱼跃医疗	2,900	71,398.00	0.59
8	000623	吉林敖东	4,300	70,477.00	0.59
9	002439	启明星辰	2,600	69,940.00	0.58
10	603369	今 世 缘	2,500	69,725.00	0.58
11	601168	西部矿业	9,700	61,895.00	0.52
12	000686	东北证券	7,000	61,670.00	0.51
13	000778	新兴铸管	13,800	61,272.00	0.51
14	600820	隧道股份	9,700	61,207.00	0.51
15	002299	圣农发展	2,400	60,768.00	0.51
16	002092	中泰化学	7,600	60,496.00	0.50
17	000060	中金岭南	12,600	59,094.00	0.49
18	000039	中集集团	5,520	58,953.60	0.49
19	600673	东 阳 光	7,500	58,875.00	0.49
20	600885	宏发股份	2,400	58,320.00	0.49
21	000960	锡业股份	5,200	58,084.00	0.48
22	600166	福田汽车	24,500	58,065.00	0.48
23	600376	首开股份	6,500	58,045.00	0.48
24	600718	东软集团	4,500	57,690.00	0.48
25	002078	太阳纸业	8,400	57,204.00	0.48
26	601872	招商轮船	13,100	57,116.00	0.48
27	600260	凯乐科技	2,800	56,840.00	0.47
28	600761	威孚高科	2,300	56,680.00	0.47
29	601005	重庆钢铁	27,500	56,375.00	0.46
30	600572	康 恩 贝	8,600	55,040.00	0.46
31	600079	人福医药	5,200	54,600.00	0.45
32	000547	航天发展	7,500	54,492.00	0.45
33	002221	东华能源	6,300	54,243.00	0.45
34	600466	蓝光发展	8,600	53,492.00	0.45
35	601098	中南传媒	4,200	53,088.00	0.44
36	300315	掌趣科技	15,300	52,785.00	0.44
37	600643	爱建集团	5,500	52,690.00	0.44
38	600967	内蒙一机	4,700	52,640.00	0.44
39	600258	首旅酒店	2,900	52,142.00	0.43
40	300068	长信科技	10,300	52,118.00	0.43
41	000878	云南铜业	4,900	52,087.00	0.43
42	600143	金发科技	10,600	51,940.00	0.43
43	002019	亿帆医药	4,200	51,450.00	0.43
44	600872	中炬高新	1,200	51,396.00	0.43
45	002385	大 北 农	9,700	51,313.00	0.43
46	601718	际华集团	13,100	51,221.00	0.43
47	002074	国轩高科	2,900	51,129.00	0.43
48	600026	中远海能	7,800	50,622.00	0.42
49	300166	东方国信	4,100	50,389.00	0.42
50	600737	中粮糖业	5,800	50,344.00	0.42
51	600380	健 康 元	5,800	50,170.00	0.42
52	002152	广电运通	7,300	50,005.00	0.42
53	002440	闰土股份	4,000	49,840.00	0.42
54	601966	玲珑轮胎	2,900	49,300.00	0.41
55	000008	神州高铁	13,000	49,010.00	0.41
56	000932	华菱钢铁	10,200	48,940.20	0.41
57	002273	水晶光电	4,200	48,636.00	0.41
58	600500	中化国际	6,500	48,555.00	0.40
59	000698	兴蓉环境	10,000	48,230.00	0.40
60	300168	万达信息	3,700	47,989.00	0.40
61	600507	方大特钢	4,800	46,944.00	0.39
62	000031	大 悦 城	7,300	46,866.00	0.39
63	600325	华发股份	6,700	46,079.00	0.38
64	600611	国药一致	1,200	45,900.00	0.38
65	601179	中国西电	12,400	45,880.00	0.38
66	600056	中国医药	3,400	45,866.00	0.38
67	603885	吉祥航空	3,600	45,850.00	0.38
68	600409	三友化工	8,100	45,846.00	0.38
69	000685	中山公用	5,300	45,262.00	0.38
70	300058	蓝色光标	5,800	45,210.00	0.37
71	600348	阳泉煤业	7,700	44,737.00	0.37
72	600823	世茂股份	9,700	44,717.00	0.37
73	600970	中材国际	6,900	44,367.00	0.37
74	000887	中鼎股份	4,600	44,114.00	0.37
75	600597	光明乳业	4,100	44,075.00	0.37
76	600373	中文传媒	3,500	43,960.00	0.37
77	000528	柳 工	6,600	43,956.00	0.37
78	002004	华邦健康	9,900	43,740.00	0.36
79	002242	九阳股份	2,100	43,701.00	0.36
80	600162	香江控股	9,900	43,659.00	0.36
81	002408	齐翔腾达	5,600	43,400.00	0.36
82	600312	平高电气	5,600	43,064.00	0.36
83	601958	金钼股份	4,200	42,882.00	0.36
84	600062	华润双鹤	3,400	42,874.00	0.36
85	002244	滨江集团	10,300	42,745.00	0.36
86	600964	中材股份	10,300	42,642.00	0.36
87	600782	新钢股份	8,500	42,500.00	0.35
88	600717	天 津 港	6,600	42,372.00	0.35
89	603444	吉 比 特	300	41,992.00	0.35
90	000028	国药一致	1,000	41,830.00	0.35
91	600565	迪马股份	11,100