海富通领先成长混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8月27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6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通领先成长混合
基金主代码	519025
交易代码	519025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月30日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	81,321,714.53份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	从具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票,在控制风险并保持资产良好流动性的前提下, 力争实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金运用已经得到市场检验和认可的国际先进投资理念,通过上市公司基本面的分析和研究,坚持寻找价值“洼地”和长线投资,来获得超额收益。在投资组合构建和管理的过程中,本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的方法,在具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票。
业绩比较基准	MSCI China A指数×80%+上证国债指数×20%
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和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高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		海富通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	田青
	联系电话	021-38650891	010-67595096
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tianqing1zh@ccb.com
客户服务电话		40088-40099	010-67595096
传真		021-33830166	010-66275853

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

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	8,935,456.65
本期利润	20,207,118.05
加权平均基金份额本期利润	0.2432
本期基金份额净值增长率	25.37%
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	0.1517
期末基金资产净值	95,245,772.07
期末基金份额净值	1.171

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、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、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与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)。

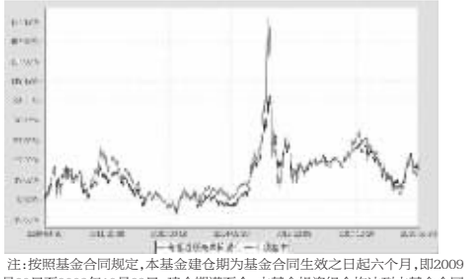
3.2 基金净值表现

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	4.83%	1.28%	3.76%	0.97%	1.07%	0.31%
过去三个月	-3.54%	1.70%	-1.67%	1.25%	-1.87%	0.45%
过去六个月	25.37%	1.62%	21.96%	1.26%	3.41%	0.36%
过去一年	1.83%	1.61%	7.12%	1.24%	-5.29%	0.37%
过去三年	-2.09%	1.26%	3.74%	0.90%	-5.83%	0.36%
自基金合同生效起至今	33.19%	1.59%	37.15%	1.22%	-3.96%	0.37%

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

海富通领先成长混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年4月30日至2019年6月30日)



注:按照基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2009年4月30日至2009年10月29日。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)、(七)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准,由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司(现更名为“法国巴黎资产管理BE控股公司”)于2003年4月1日共同发起设立。截至2019年6月30日,本基金管理人共管理61只公募基金:海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金(LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
李志	本基金的基金经理	2017-05-15	-	9年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任上海申银万国证券研究所有限公司助理分析师,汇丰晋信基金管理有限公司研究员,2015年12月加入海富通基金管理有限公司,历任股票相对收益组合部分析师、基金经理助理,2017年5月起任海富通领先成长混合基金经理。
陆怡雯	本基金基金经理助理;海富通精选混合基金经理助理;海富通精选贰号混合基金经理助理;海富通收益增长混合基金经理助理;海富通改革驱动混合基金经理助理;海富通内需热点混合基金经理助理。	2018-06-21	-	7年	伦敦政治经济学院理学硕士,持有基金从业人员资格证书。历任元大证券(香港)助理研究员、金元惠理基金管理有限公司研究员,申万宏源证券研究所高级研究员。2016年1月加入海富通基金管理有限公司,历任分析师、高级股票分析师。2018年6月起任海富通精选混合、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通改革驱动混合、海富通内需热点混合、海富通领先成长混合的基金经理助理。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日; 非首任基金经理, 其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为:自参加证券行业的相关工作开始计算。

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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度, 公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行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

2019年上半年A股市场出现了明显涨幅。截至2019年6月30日,上证综指收于2978.88点,上半年上涨19.45%,深证成指收于9178.31点,上涨幅度为26.78%。中小板指收于5678.75点,上涨20.75%,创业板上涨20.87%,报1511.51点。

具体来看,自从1月4日上证综指盘中触及近三年新低2440.91点之后,市场便开始温和反弹,一直延续到月底,1月份上证综指涨幅3.64%。板块上,家电、食品饮料、保险、银行等价值权重板块率先企稳反弹,涨幅居前。进入2月份,随着困扰2018年的几大利空因素均有所缓解:中美贸易摩擦的积极向好谈判、监管层对去杠杆告一段落等,2月份上证综指涨幅达到13.79%,创近几年新高。同时随着2月末两市单日总成交量放大到万亿、融资余额回到8000亿以上,市场风险偏好大幅上升。趋势延续到3月,当月上证综指上涨5.09%,表现依旧不错。进入二季度,一季度大幅上涨之后,4月份存在一定的调整压力。因此在月初上证综指触及短期新高3288.45点之后,便开始区间震荡。同时月底贸易谈判陷入僵局,指数也开始出现回调。4月份上证综指下跌0.4%。5月月初随着中美贸易谈判陷入僵局,以及对国内宏观经济下行压力的预期,市场出现了大幅回调,单5月份上证综指下跌5.84%,深证成指下跌7.77%。板块上看,仅有以黄金为代表的有色板块涨幅2.2%,其他板块悉数下跌,其中禽畜产业链、食品饮料等相对跌幅较少,而TMT板块、券商等高弹性板块跌幅居前。进入6月份之后,虽然4-5月份的宏观经济数据依旧没有改善预期,但随着对中美G20重启贸易谈判的预期,市场逐步开始筑底回升,风险偏好有所提升,单6月上证综指上涨2.77%。

行业方面,在申万28个一级行业分类中,上半年均录得涨幅,单板块间差异巨大。其中食品饮料(61.01%)、非银金融(43.83%)、农林牧渔(41.96%)、家电(37.82%)、计算机(32.77%)涨幅排名前五,且都涨幅超过30%。而建筑装饰(4.16%)、钢铁(5.04%)、传媒(7.79%)、纺织服装(9.27%)、汽车(10.03%)涨幅靠后。

在本基金上半年的操作中,电子、农林牧渔、非银金融、计算机带来较多的正收益。汽车、公用事业板块导致较多的负收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期, 本基金净值增长率为25.37%, 同期基金业绩比较基准收益率为21.96%,基金净值跑赢业绩比较基准3.41个百分点。

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年初,市场对经济的担忧有所缓解。外部中美贸易摩擦暂缓,并貌似朝着达成协议的方向演进。内部政策宽松,降准、地方债发行前置、信贷周期回暖,资产价格预期企稳。2019年4月中旬,国内外不确定性上升。4月中旬起国内政策边际收紧,5月初中美局势恶化,5月24日包商银行被接管,中小银行结构性去杠杆。市场风险偏好显著回落。2019年6月中旬,中美领导人通电话,确定G20见面,市场预期谈判重启;美联储6月议息会议释放鸽派信号;证监会就修改《上市公司重大资产重组管理办法》征求意见,市场风险偏好迅速提升。上半年的行情基本上来源于估值修复。

下半年,国内宏观经济增长压力仍在。一季度在信贷及社融扩张提振下,经济增长体现一定韧性,但随着外部中美贸易摩擦带来的负面效果更大范围地显现,内部房地产市场可能逐步降温、基建增速制约重重、中小银行去杠杆对实体经济的影响尚未完全体现等,中国经济增长在2019年下半年仍将面临压力。同时,从政策角度看,下半年宏观政策倾向将维持宽松,尤其是三季度将在边际上较二季度宽松。但在高杠杆环境以及结构性去杠杆政策背景制约下,政策效果有待验证。同时,包商银行事件后,流动性出现分层,中小银行及非银机构融资困难程度及成本上升,为避免出现局部风险,预计货币政策将采取进一步措施缓解结构性流动性压力。

从中期角度,我们依旧对下半年的资本市场保持相对乐观。我们认为估值的变化依然是核心变量,仍存在修复机会。估值端来自无风险利率下行带来的修复机会较为确定,风险偏好短期将出现抬升,但后续存在不确定性,整体上市场环境好于二季度,策略上更加积极,但需留意市场可能会阶段性对业绩下滑做出负面反应。从行业角度看,我们认为科技、消费、金融等板块有望持续跑出超额收益,包括计算机、半导体、5G、食品饮料、医药、券商、银行等。

对于2019年下半年,本基金将维持较中等仓位运行。在持仓结构中,持续深入挖掘公司业绩,增持行业基本面向上或稳定,公司业绩可能超越市场预期的品种。三季度更看好成长板块,主要源于较为宽松的流动性和科创板映射,而四季度更看好低估值核心资产。

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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后, 将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会,组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等,以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组,估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估,充分听取相关部门的建议,并和托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告,以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益可进行分配;本基金收益每年最多分配6次, 每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%。

本基金报告期内未进行过利润分配,但符合基金合同规定。

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

本报告期, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:海富通领先成长混合型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	8,269,930.43	5,494,695.31
结算备付金		30,284.95	368,281.14
存出保证金		30,299.37	55,440.36
交易性金融资产	6.4.7.2	85,609,474.16	59,844,384.48
其中:股票投资		85,609,474.16	59,844,384.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,756,315.59	14,028,850.95
应收利息	6.4.7.5	1,824.46	491.95
应收股利		-	-
应收申购款		2,677.13	1,784.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		95,700,806.09	79,793,928.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		197,538.78	12,932.54
应付管理人报酬		112,707.87	103,994.59
应付托管费		18,784.63	17,332.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	52,897.48	126,660.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	73,105.26	250,010.09
负债合计		455,034.02	510,930.21
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	81,321,714.53	84,898,705.87
未分配利润	6.4.7.10	13,924,057.54	-5,615,707.30
所有者权益合计		95,245,772.07	79,282,998.57
负债和所有者权益总计		95,700,806.09	79,793,928.78

注:1,报告截止日2019年06月30日,基金份额净值1.171元,基金份额总额81,321,714.53份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表
会计主体:海富通领先成长混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	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
一、收入		21,388,584.73	-18,694,007.70
1.利息收入		41,424.90	39,024.89
其中:存款利息收入	6.4.7.11	35,250.57	38,949.23
债券利息收入		19.54	75.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,154.79	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		10,073,228.92	-6,395,957.29
其中:股票投资收益	6.4.7.12	9,482,115.22	-6,993,828.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	20,706.61	12,933.82
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	570,407.09	584,937.37
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	11,271,661.40	-12,339,174.32
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	2,269.51	2,099.02
减:二、费用		1,181,466.68	1,884,299.27
1、管理人报酬		689,467.07	851,653.03
2、托管费		114,911.16	141,942.11
3、销售服务费		-	-
4、交易费用	6.4.7.19	293,112.94	700,936.61
5、利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	0.28
7、其他费用	6.4.7.20	83,975.51	189,767.24
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		20,207,118.05	-20,578,306.97
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		20,207,118.05	-20,578,306.97

注:1、上述利润金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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等。

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	689,467.07	851,653.03
其中:支付销售机构的客户维护费	183,104.63	225,191.66

注:支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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 X 1.5% / 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	114,911.16	141,942.11

注: 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 X 0.25% / 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

本基金本报告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

本报告期及上年度可比期间基金管理人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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,269,930.43	33,158.05	16,817,388.62	35,662.63

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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

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	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	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股未上市	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

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	85,609,474.16	89.46
	其中:股票	85,609,474.16	89.46
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	8,300,215.38	8.67
8	其他各项资产	1,791,116.55	1.87
9	合计	95,700,806.09	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

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	1,853,962.00	1.95
B	采矿业	54,233.35	0.06
C	制造业	47,976,902.71	50.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,507,134.00	1.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,014,855.00	1.07
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	8,625,196.81	9.06
J	金融业	16,123,177.19	16.93
K	房地产业	7,559,676.50	7.94
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	871,230.00	0.91
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	85,609,474.16	89.88

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	300014	亿纬锂能	167,366	5,097,968.36	5.35
2	601398	工商银行	688,513	4,055,341.57	4.26
3	002371	北方华创	55,858	3,868,166.50	4.06
4	000858	五粮液	27,200	3,208,240.00	3.37
5	600570	恒生电子	41,600	2,835,040.00	2.98
6	002304	洋河股份	22,300	2,710,788.00	2.85
7	601318	中国平安	29,672	2,629,235.92	2.76
8	600048	保利地产	192,353	2,454,424.28	2.58
9	600036	招商银行	66,562	2,394,900.76	2.51
10	000002	万科A	84,562	2,351,669.22	2.47

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金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

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	300014	亿纬锂能	4,317,843.22	5.45
2	600104	上汽集团	4,278,666.00	5.40
3	000671	阳光城	3,440,768.00	4.34
4	000858	五粮液	2,764,005.00	3.49
5	002304	洋河股份	2,717,523.00	3.43
6	601336	新华保险	2,686,828.00	3.39
7	600131	岷江水电	2,312,287.00	2.92
8	600570	恒生电子	2,200,755.00	2.78
9	603160	汇顶科技	2,121,774.00	2.68
10	600779	水井坊	2,047,088.00	2.58
11	601688	华泰证券	1,957,031.48	2.47
12	603690	至纯科技	1,926,146.00	2.43
13	002709	天赐材料	1,888,963.00	2.38
14	002812	恩捷股份	1,880,259.00	2.37
15	601318	中国平安	1,878,170.00	2.37
16	300498	温氏股份	1,870,089.28	2.36
17	000625	长安汽车	1,752,364.00	2.21
18	603986	兆易创新	1,529,330.00	1.93
19	300059	东方财富	1,522,856.37	1.92
20	002439	启明星辰	1,490,810.00	1.88

注:“买入金额”按买入成交金额(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

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	300037	新宙邦	3,628,010.31	4.58
2	002531	天顺风能	3,225,459.45	4.07
3	600438	通威股份	2,938,958.07	3.71
4	002458	益生股份	2,474,289.74	3.12
5	601788	光大证券	2,455,981.52	3.10
6	002709	天赐材料	2,306,109.01	2.91
7	001979	招商蛇口	2,276,922.29	2.87
8	002299	圣农发展	2,226,618.96	2.81
9	300316	晶盛机电	2,073,721.44	2.62
10	000671	阳光城	1,866,911.00	2.35
11	601377	兴业证券	1,803,087.00	2.27
12	002439	启明星辰	1,738,346.00	2.19
13	601186	中国铁建	1,710,628.00	2.16
14	600104	上汽集团	1,699,126.00	2.14
15	300261	雅本化学	1,605,433.00	2.02
16	300014	亿纬锂能	1,467,946.78	1.85
17	300604	长川科技	1,441,489.08	1.82
18	600136	当代明诚	1,428,914.25	1.80
19	600048	保利地产	1,427,203.42	1.80
20	603026	石大胜华	1,411,472.14	1.78

注:“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 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

买入股票的成本(成交)总额	104,053,241.21
卖出股票的收入(成交)总额	99,041,928.15

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(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

本基金本报告期末未持有债券