华宝中证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:华宝基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2019年8月29日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国民生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01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝中证500增强		
基金主代码	005607		
交易代码	005607		
基金运作方式	契约型开放式,发起式		
基金合同生效日	2018年4月19日		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	48,149,211.52份		
基金合同存续期	不定期		
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:	005607	005608	
报告期末下属分级基金的份额总额	31,764,145.48份	16,385,066.04份	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为中证500指数增强型基金,在实现对中证500指数有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理,力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金在复制标的指数的基础上优化投资组合,力求通过量化技术实现指数增强的效果。 1.资产配置策略 本基金主要投资于中证500指数成分股及备选股票,也会根据中证500股指期货的基差情况择机部分使用期货替代现货,降低成本。视市场情况本基金也会谨慎地参与一些绝对收益策略。同时,本基金将预留必要的现金,应对期货保证金的增加要求或投资者的赎回申请。 2.股票投资策略 本基金主要采用量化行业配置模型和量化Alpha选股模型构建指数增强股票组合。在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现,并根据市场变化趋势,定期对模型进行调整,以改进模型的有效性。 3.股指期货投资策略 在不同的市场环境下,本基金将综合考虑股指期货相对现货的基差、流动性、展期收益以及保证金要求等因素,选择部分使用股指期货多头合约替代指数现货,以求提高资金利用效率和组合收益水平。 4.债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,可投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,以保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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		华宝基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	罗菲菲
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgbfxjf2x@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95568
传真		021-38505777	010-58560798

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	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年度报告备置点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§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1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	2,639,801.18	1,073,779.37
本期利润	3,173,769.44	1,359,479.64
加权平均基金份额本期利润	0.1074	0.0927
本期加权平均净值利润率	12.33%	10.73%
本期基金份额净值增长率	14.05%	13.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	-4,217,220.02	-2,243,135.36
期末可供分配基金份额利润	-0.1328	-0.1369
期末基金资产净值	27,546,925.46	14,141,930.68
期末基金份额净值	0.8672	0.8631
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-13.28%	-13.69%

注:1、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。

2、净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)

3、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。

4、期末可供分配利润采用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。

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

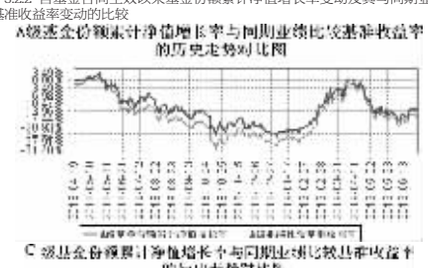
中证500增强A

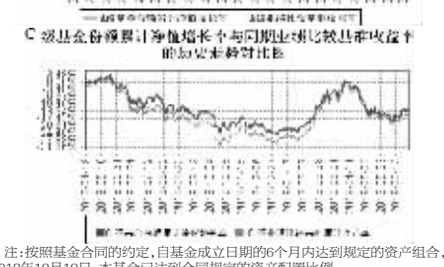
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.89%	1.19%	0.75%	1.32%	1.14%	-0.13%
过去三个月	-9.6%	1.62%	-10.21%	1.72%	0.56%	-0.10%
过去六个月	14.05%	1.62%	17.87%	1.70%	-3.82%	-0.08%
过去一年	-5.66%	1.54%	-4.70%	1.60%	-0.96%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	-13.28%	1.49%	-16.13%	1.57%	2.85%	-0.08%

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	1.8%	1.19%	0.75%	1.32%	1.10%	-0.13%
过去三个月	-9.74%	1.62%	-10.21%	1.72%	0.47%	-0.10%
过去六个月	13.82%	1.62%	17.87%	1.70%	-4.05%	-0.08%
过去一年	-6.03%	1.54%	-4.70%	1.60%	-1.33%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	-13.69%	1.49%	-16.13%	1.57%	2.44%	-0.08%

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:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2018年10月19日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2019年6月30日),正在管理运作的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证100 基金、上证180价值ETF、华宝上证180价值ETF联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证1000分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司ETF、华宝中证军工ETF、华宝新活力基金、华宝沪深300指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝精选基金、华宝券商ETF联接基金、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝科技先锋基金、华宝茗裕纯债基金、华宝大健康基金、华宝中短债基金、华宝稳健FOF基金、华宝宝盛纯债基金、华宝宝怡纯债基金、华宝消费升级基金、华宝质量价值基金等,正在管理运作的证券投资基金资产净值合计171,851,775,826.03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		
丰晨成	本基金基金经理、上证180价值ETF、华宝上证180价值ETF联接、华宝中证金指证券公司ETF、华宝券商ETF联接、华宝中证1000指数分级基金经理	2018年4月19日	-	9年	硕士,2009年加入华宝基金管理有限公司,先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015年11月起任上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2016年8月起任华宝中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年4月起任华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理,2018年6月起任华宝中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2018年8月起任华宝中证1000指数分级证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有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

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

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

中证500指数增强基金运用量化选股模型和行业配置模型进行股票筛选和权重配置,精选具有合理估值的高成长性股票,在跟踪中证500指数的基础上力争实现稳定的超越指数的表现。2019年上半年虽然市场对于宏观经济的预期不高,但市场创出了近几年少有的单季度涨幅,在上涨过程中以中证500为代表的中小市值指数表现较好,但由于在二月份急速上涨过程中基本面因子失效严重,因子收益与模型预期效果出现较大背离,导致一季度组合相对于基准指数没有取得正的超额收益。在二季度该情况有所好转,报告期相对基准指数取得了一定的超额收益。

本报告期为基金的正常运作期,在操作中,我们遵守基金合同,按照既定的量化投资策略,应对成分股调整和基金申购赎回,通过个股选择和行业配置等多种手段努力争取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额A净值增长率为14.05%;本报告期基金份额C净值增长率为13.82%;同期业绩比较基准收益率为17.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济增速虽然大概率处于逐渐降速的过程中,但宏观经济抵御内外风险的韧性仍在,货币政策不排除部分层面边际宽松的可能。我们秉持GARP选股逻辑,通过量化方法克服恐惧心理,同时也根据运行期的累计表现和经验不断研究改进现有模型的途径方法,力争保持模型的稳定性的同时也提高其获取超额收益的水平。未来,我们认为中证500指数作为中盘股的基准指数,在目前点位有较好的中期配置价值。

作为基金的管理人,我们将继续遵守基金合同,按照既定的量化投资策略,应对成分股调整和基金申购赎回,通过个股选择和行业配置等多种手段努力争取超额收益。

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、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时,由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1)日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责,基金会计以本基金为会计核算主体,基金会计核算独立于公司会计核算,独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行;基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对,每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

(2)特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[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》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布 〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度,对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况,量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如:指数收益法)进行估值,并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见,但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金为发起式基金,基金合同于2018年4月19日生效,基金管理人于2018年4月17日运用固有资金作为发起资金认购本基金,且承诺持有期限自本基金合同生效之日起不少于3年。

根据本基金基金合同的规定:基金合同生效日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的,基金存续期内,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形之一的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

截止2019年6月30日,本基金基金合同生效未满三年,基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。

§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

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,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

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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:华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	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	2,486,267.24	3,880,836.39
结算备付金	723,639.23	520,809.91
存出保证金	23,030.86	262,333.82
交易性金融资产	38,925,668.24	28,347,373.84
其中:股票投资	38,925,668.24	28,347,373.84
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	158,842.47	-
应收利息	700.15	981.41
应收股利	-	-
应收申购款	41,034.82	148,970.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	42,359,183.01	33,161,306.93
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	40,552.04	726,793.12
应付赎回款	414,508.09	12,609.60
应付管理人报酬	33,426.63	27,663.67
应付托管费	4,011.19	3,319.66
应付销售服务费	4,516.46	3,425.10
应付交易费用	128,982.26	97,394.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	44,330.20	120,001.01
负债合计	670,326.87	991,206.97
所有者权益:		
实收基金	48,149,211.52	42,343,581.88
未分配利润	-6,460,355.38	-10,173,482.92
所有者权益合计	41,688,856.14	32,170,098.96
负债和所有者权益总计	42,359,183.01	33,161,306.93

注:报告截止日2019年6月30日,中证500增强A基金份额净值0.8672元,基金份额总额31,764,145.48份;中证500增强C基金份额净值0.8631元,基金份额总额16,385,066.04份。华宝中证500增强份额总额合计为48,149,211.52份。

6.2 利润表

会计主体:华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金

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	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	5,267,923.21	-1,850,558.40
1.利息收入	14,703.75	78,503.47
其中:存款利息收入	14,703.75	20,365.87
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	58,137.60
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	4,396,897.50	-412,328.11
其中:股票投资收益	3,894,053.18	-486,595.88
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	132,233.01	-143,920.00
股利收益	370,611.31	218,187.77
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	819,668.53	-1,577,578.52
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	36,653.43	60,844.76
减:二、费用	734,674.13	232,670.25
1. 管理人报酬	189,776.15	81,594.36
2. 托管费	22,773.16	9,791.35
3. 销售服务费	25,106.93	14,863.17
4. 交易费用	442,415.81	84,412.03
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	436.27	-
7. 其他费用	54,165.71	42,009.34
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	4,533,249.08	-2,083,228.65
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	4,533,249.08	-2,083,228.65

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金

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	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	42,343,581.88	-10,173,482.92	32,170,098.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,533,249.08	4,533,249.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	5,805,629.64	-820,121.54	4,985,508.10
其中:1.基金申购款	28,380,065.56	-3,468,293.04	24,911,772.52
2.基金赎回款	-22,574,435.92	2,648,171.50	-19,926,264.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	48,149,211.52	-6,460,355.38	41,688,856.14

项目	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	55,157,340.21	-	55,157,340.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,083,228.65	-2,083,228.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-20,522,775.03	-721,360.66	-21,244,135.69
其中:1.基金申购款	5,875,113.82	-141,178.73	5,733,935.09
2.基金赎回款	-26,397,888.85	-580,181.93	-26,978,070.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	34,634,565.18	-2,804,589.31	31,829,975.87

注:报告期内本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按照本基金合同规定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2019年6月30日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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	38,925,668.24	91.89
	其中:股票	38,925,668.24	91.89
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	3,209,906.47	7.58
8	其他各项资产	223,608.30	0.53
9	合计	42,359,183.01	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	368,485.00	0.88
B	采矿业	992,963.80	2.38
C	制造业	18,626,121.28	44.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	949,883.00	2.28
E	建筑业	714,106.40	1.71
F	批发和零售业	930,662.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,173,208.00	2.81
H	住宿和餐饮业	161,820.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,992,279.24	7.18
J	金融业	1,343,122.80	3.22
K	房地产业	1,632,941.00	3.92
L	租赁和商务服务业	617,339.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	248,381.40	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	126,316.00	0.30
Q	卫生和社会工作	209,370.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,150,398.00	2.76
S	综合	387,307.00	0.93
	合计	32,624,703.92	78.26

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	471,767.75	1.13
C	制造业	3,493,991.83	8.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	85,063.00	0.20
E	建筑业	59,666.00	0.14
F	批发和零售业	168,526.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	119,980.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	676,666.80	1.62
J	金融业	407,710.94	0.98
K	房地产业	311,176.00	0.75
L	租赁和商务服务业	77,924.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	25,476.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	116,180.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	231,300.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	55,536.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	6,300,964.32	15.11

7.2.3 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投资股票。

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	600872	中炬高新	8,400	359,772.00	0.86
2	002268	卫士通	12,100	295,845.00	0.71
3	300253	卫宁健康	20,200	286,436.00	0.69
4	002340	格林美	57,700	271,767.00	0.65
5	002127	南极电商	23,700	266,388.00	0.64
6	300383	光环新网	15,300	256,581.00	0.62
7	002273	水晶光电	21,700	251,286.00	0.60
8	002916	深南电路	2,460	250,723.20	0.60
9	600022	山东钢铁	145,100	242,317.00	0.58
10	300450	先导智能	7,200	241,920.00	0.58

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www.fsfund.com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	300347	泰格医药	3,000	231,300.00	0.55
2	002410	广联达	6,400	210,496.00	0.50
3	603899	晨光文具	4,600	202,262.00	0.49
4	000333	美的集团	3,685	191,104.10	0.46
5	600256	广汇能源	47,800	170,168.00	0.41

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	600507	方大特钢	744,590.00	2.31
2	002273	水晶光电	660,849.00	2.05
3	002890	美亚光电	604,980.63	1.88
4	002340	格林美	579,447.00	1.80
5	600673	东阳光	578,742.00	1.80
6	600823	世茂股份	572,736.00	1.78
7	002463	沪电股份	566,092.00	1.76
8	000778	新兴铸管	546,454.10	1.70
9	000807	云铝股份	544,773.00	1.69
10	300010	立思辰	535,859.00	1.67
11	600885	宏发股份	531,901.00	1.65
12	600511	国药股份	522,278.00	1.62
13	000569	万向钱潮	522,244.00	1.62
14	002127	南极电商	514,709.50	1.60
15	600875	东方电气	502,548.00	1.56
16	601019	山东出版	502,493.94	1.56
17	002174	游族网络	499,048.00	1.55
18	000078	海王生物	496,280.00	1.54
19	000581	威孚高科	492,253.00	1.53
20	002128	露天煤业	491,538.00	1.53

注:买入金额不包括相关交易费用。

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	600507	方大特钢	774,861.00	2.41
2	002890	美亚光电	670,704.00	2.08
3	002174	游族网络	662,873.00	2.06
4	300274	阳光电源	657,459.26	2.04
5	600875	东方电气	623,490.00	1.94
6	000656	金科股份	613,777.00	1.91
7	000988	华工科技	570,598.00	1.77
8	002463	沪电股份	566,904.00	1.76
9	600325	华发股份	563,089.00	1.75
10	600755	厦门国贸	557,478.00	1.73
11	002414	高德红外	554,856.22	1.72
12	600748	上实发展	554,689.00	1.72
13	002465	海格通信	545,733.00	1.70
14	000997	新大陆	513,314.00	1.60
15	601106	中国一重	504,535.00	1.57
16	600511	国药股份	496,404.00	1.54
17	000975	银泰资源	494,603.00	1.54
18	600737	中粮糖业	490,789.00	1.53
19	300413	芒果超媒	489,042.00	1.52
20	600528	中铁工业	481,170.00	1.50

注:卖出金额不包括相关交易费用。

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

买入股票成本(成交)总额	150,693,819.28
卖出股票收入(成交)总额	144,776,036.59

注:买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货提高投资效率,以更好地实现本基金的投资目标,降低跟踪误差。此外,在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时,本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1