

信息披露

Disclosure

(上接B061版)

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
 办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
 法定代表人：冯鹤年
 联系人：韩秀萍
 电话：010-85127609
 客服电话：95676
 公司网址：www.msqz.com
 (70) 联储证券有限责任公司
 注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
 办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
 法定代表人：吕春卫
 联系人：丁倩云
 电话：01086409427
 客服电话：4006206988
 公司网址：www.lczq.com
 (71) 中信证券股份有限公司
 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
 办公地址：北京市朝阳区亮马桥48号中信证券大厦
 法定代表人：张佑君
 联系人：马静璐
 电话：010-60833889
 客服电话：95648
 公司网址：www.cs.citic.com
 (72) 中信证券（山东）有限责任公司
 注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
 办公地址：青岛市南区江苏路28号龙翔广场东楼2层
 法定代表人：姜晓林
 联系人：孙秋月
 联系电话：0532-85022326
 传真：0532-85022605
 客服电话：95648
 公司网址：http://www.citics.com
 (73) 中信期货有限公司
 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
 办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
 法定代表人：张皓
 联系人：刘宏奎
 电话：010-60833754
 传真：0755-83217421
 客服电话：400-990-8826
 公司网址：http://www.citicsf.com/
 (74) 华福证券有限责任公司
 注册地址：福建省福州市市五四路157号新天地大厦7-8楼
 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18层
 法定代表人：黄金琳
 联系人：王虹
 客服电话：95647
 公司网址：http://www.hfzq.com.cn
 (75) 上海证券有限责任公司
 注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
 办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
 法定代表人：李俊杰
 联系人：邵珍珍
 电话：021-53686262
 客服电话：4006918918
 公司网址：www.shzq.com
 (76) 第一创业证券股份有限公司
 注册地址：广东省深圳市福田区福华一路投行大厦20楼
 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路投行大厦20楼
 法定代表人：刘学民
 联系人：毛诗莉
 电话：0755-23838076
 客服电话：95638
 公司网址：www.firstcapital.com.cn
 (77) 财通证券股份有限公司
 注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
 办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716
 法定代表人：陆建强
 联系人：徐轶青
 电话：0571-87822359
 传真：0571-87818329
 客服电话：953636
 公司网址：www.ctsec.com
 (78) 信达证券股份有限公司
 注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 法定代表人：张志刚
 联系人：张晓晨
 电话：010-83625184
 客服电话：95321
 公司网址：www.cindas.com
 (79) 东吴证券股份有限公司
 注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号
 办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号
 法定代表人：范力
 联系人：陆皓
 电话：0512-62938521
 传真：0512-62938833
 客服电话：953630
 公司网址：www.dwzq.com.cn
 (80) 申万宏源证券股份有限公司
 注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场46层
 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场46层
 法定代表人：李梅
 联系人：陈佩
 电话：021-33388211
 客服电话：400896523
 公司网址：www.swhysc.com
 (81) 申万宏源西部证券有限公司
 注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
 法定代表人：李琦
 联系人：唐岚
 电话：010-88085628
 传真：010-88013605
 客服电话：95623
 公司网址：www.hysec.com
 (82) 长城证券股份有限公司
 注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17
 办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17
 法定代表人：曹宏
 联系人：金夏
 电话：0755-83616289
 客服电话：400-6666-888
 公司网址：www.cgws.com
 (83) 国元证券股份有限公司
 注册地址：安徽省合肥市梅山路18号
 办公地址：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券法定代表人：蔡春
 联系人：倪俊
 电话：0551-62267039
 客服电话：95678、400888777
 公司网址：www.gyzq.com.cn
 (84) 中泰证券股份有限公司
 注册地址：山东省济南市经七路86号
 办公地址：山东省济南市经七路86号
 法定代表人：李玮
 联系人：秦雨晴
 电话：021-20315197
 客服电话：95658
 公司网址：www.zts.com.cn
 (85) 海通证券股份有限公司
 注册地址：上海市广东路689号
 办公地址：上海市广东路689号
 法定代表人：周杰
 联系人：李楠
 电话：021-32219061
 客服电话：95653/4008888001
 公司网址：www.htsec.com
 (86) 华西证券股份有限公司
 注册地址：成都市高新区天府二街198号
 办公地址：成都市高新区阜成门外大街22号外经贸大厦9层
 法定代表人：杨尚洋
 联系人：谢国海
 联系电话：010-58124967
 客服电话：95684
 公司网址：www.hx168.com.cn
 (87) 安信证券股份有限公司
 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单
 元
 办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
 法定代表人：王连志
 联系人：陈剑虹
 电话：0755-82825551
 传真：0755-82568355
 客服电话：95617
 公司网址：www.essence.com.cn

(88) 华安证券股份有限公司
 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
 办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
 法定代表人：章宏圣
 联系人：樊志伟
 联系电话：0551-65161675
 客服电话：95318
 公司网址：www.hazq.com
 (89) 弘业期货股份有限公司
 注册地址：南京市中华路60号
 办公地址：南京市中华路60号弘业大厦
 法定代表人：周剑秋
 联系人：张苏怡
 电话：025-52278981
 客服电话：400-8281288
 公司网址：www.ftol.com.cn
 (90) 华泰证券股份有限公司
 注册地址：江苏省南京市江东中路228号
 办公地址：江苏省南京市江东中路228号
 法定代表人：周易
 联系人：马艺卿
 电话：025-8389093
 客服电话：95697
 公司网址：http://www.htsec.com/
 (91) 广发证券股份有限公司
 注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
 办公地址：广州市天河区北路183号都会广场5、7、10、18、19、35、36、38、39-44楼
 法定代表人：孙树明
 联系人：马梦洁
 电话：020-8755888-6932
 客服电话：95675
 公司网址：www.gf.com.cn
 (92) 联讯证券股份有限公司
 注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
 办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
 法定代表人：徐刚
 联系人：彭道
 电话：0752-2119700
 传真：0752-2119660
 客服电话：95564
 公司网址：www.lxsec.com (93) 广州证券股份有限公司
 注册地址：广州市珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、20层
 办公地址：广州市珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、20层
 法定代表人：张永衡
 客服电话：95396
 公司网址：www.gzs.com.cn
 (94) 东莞证券股份有限公司
 注册地址：莞城区司南园路1号金源中心30楼
 办公地址：莞城区司南园路1号金源中心30楼
 法定代表人：陈照星
 客服电话：95328
 公司网址：http://www.dgzq.com.cn/
 (95) 长江证券股份有限公司
 注册地址：武汉市武昌区中北路9号长江世纪T2写字楼第27、28层
 办公地址：武汉市武昌区中北路9号长江世纪T2写字楼第27层
 法定代表人：董澍荣
 联系人：梅晨
 传真：86-27-85860102
 客服电话：027-85861133
 公司网址：http://www.cjzq.com.cn/main/index.html
 (96) 江海证券有限公司
 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
 办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号
 法定代表人：赵洪波
 联系人：姜志伟
 客服电话：400-666-2288
 公司网址：www.jhzq.com.cn
 (97) 恒泰证券股份有限公司
 注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公
 业综合楼
 办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行
 办公地址：14-18楼
 法定代表人：庞介民
 联系人：熊丽
 电话：0471-4972675
 客服电话：0471-2843431
 公司网址：http://www.cnhit.com.cn/
 (98) 国海证券股份有限公司
 注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路13号
 办公地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦
 法定代表人：何春梅
 联系人：张彦
 联系电话：021-50917510
 客服电话：95563
 公司网址：www.guosen.com.cn
 (100) 中国中投证券有限责任公司
 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋4
 层、18-21层
 办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋
 第4、18-21层
 法定代表人：高涛
 联系人：胡芷璇
 电话：0551-68617601
 客服电话：95636
 公司网址：www.guosen.com.cn
 (101) 招商证券股份有限公司
 注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号
 办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号招商证券大厦
 法定代表人：霍达
 联系人：黄婵君
 电话：86-755-82960167
 客服电话：95665
 公司网址：http://www.newone.com.cn/
 (102) 东兴证券股份有限公司
 注册地址：北京市西城区金融大街5号（新大厦）12、15层
 办公地址：北京市西城区金融大街5号（新大厦）12、15层
 法定代表人：魏庆华
 联系人：和志鹏
 联系电话：010-66565971
 客服电话：95309
 公司网址：www.dxzq.net
 (103) 中国民生证券股份有限公司
 注册地址：北京市朝阳区北三环中路27号5号楼
 办公地址：北京市朝阳区北三环中路27号盘古大观A座40F-43F
 法定代表人：姜志军
 联系人：程博涛
 电话：010-56437060
 传真：010-56437032
 客服电话：400889618/95671
 网站：www.cm618.com
 (104) 方正证券股份有限公司
 注册地址：长沙市天心区湘江中路二段36号华远金融中心37
 01-3717
 办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远国际中心37
 01-3717
 法定代表人：施华
 联系人：程博涛
 联系电话：010-56437060
 客服电话：95658
 公司网址：www.foundersc.com
 (105) 爱建证券股份有限公司
 注册地址：上海市世纪大道1600号32楼
 办公地址：上海市世纪大道1600号32楼
 法定代表人：魏健
 联系人：姚盛盛
 电话：021-32229888-33355
 客服电话：4001-962-502
 公司网址：www.aijzq.com
 (106) 中国国际金融股份有限公司
 注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27/28层
 办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27/28层
 法定代表人：丁学东
 电话：010-65051166
 传真：010-65051156
 公司网址：http://www.cicc.com
 (107) 国泰君安证券股份有限公司
 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
 办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
 法定代表人：杨瑞红
 联系人：钟伟祺
 联系电话：021-38032284
 客服电话：400-8888-666 / 95621
 公司网址：www.gtja.com
 (108) 五矿证券有限公司
 注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层01单元
 办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层
 法定代表人：黄海洲

联系人：濮耘瑶
 电话：0755-82545696
 传真：0755-23907062
 客服电话：4001840028
 公司网站：www.wkzq.com.cn
 (109) 西南证券股份有限公司
 注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
 办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
 法定代表人：廖庆轩
 联系人：周青
 电话：023-67616310
 客服电话：95365
 公司网站：www.swsc.com.cn
 (110) 民商基金销售有限公司
 注册地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
 办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
 法定代表人：贺惠琴
 联系人：杨一新
 电话：021-50206002
 传真：021-50206001
 客服电话：021-50206003
 公司网站：mstsec.com
 (111) 江苏汇保大基金销售有限公司
 注册地址：南京市高淳区经济开发区古槐大道47号
 办公地址：上海市龙华东路868号绿地海外滩办公A1605室
 法定代表人：吴言林
 联系人：孙平
 电话：025-86046166
 传真：025-56663409
 客服电话：025-66046166
 公司网站：www.huilinbf.com
 基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构
 代理销售本基金，并及时公告。
 (二) 注册登记机构
 名称：财通基金管理有限公司
 住所：上海市虹口区吴淞路619号505室
 办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心41楼
 法定代表人：夏理芬
 电话：021-2053 7888
 (三) 出具法律意见书的律师事务所
 名称：上海源泰律师事务所
 住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
 负责人：廖海
 电话：021-5115 0298
 传真：021-5115 0398
 联系人：刘佳
 经办律师：刘佳、范佳斐
 (四) 审计基金财产的会计师事务所
 名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
 执行事务合伙人：毛贻平
 住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼安永大楼（东
 三）办公地址：116层
 办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
 公司电话：(021) 2228 8888
 公司传真：(021) 2228 0000
 签章会计师：蒋燕华、骆文慧
 业务联系人：蒋燕华
 四、基金名称
 财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金
 五、基金的类型
 混合型基金
 六、基金的投资目标
 利用定投资策略模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增
 值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
 七、投资范围
 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发
 行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的发
 票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票、短期
 融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政
 府债、可转换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存
 款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、权证以及法律法规或中国
 证监会允许基金投资的其他证券品种。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在
 履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
 本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，
 权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股
 指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府
 债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保
 证金、应收申购款等。
 八、投资策略
 1. 股票投资策略
 本基金主要通过定量投资策略模型，选取并持有预期收益较好的股票构
 成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的
 投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比
 例可降至0%。本基金运用的量化投资策略模型主要包括：
 (1) 多因子Alpha模型——股票超额回报预测
 多因子Alpha模型以中国股票市场较长期的回测研究为基础，结合
 前瞻性市场判断，用精制的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以
 多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超额回报。概括来讲，本基
 金Alpha模型的因子可分为如下几类：价值（value）、质量（quality）、
 动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等。其中，本基金将侧
 重从基本面投资角度出发，参考市盈率、市净率、市销率、PEG、
 EV/EBITDA等估值指标，优选价值相对其长期能力被低估的上市公司
 构成股票池。公司的量化研究团队将持续研究市场的状态以及市场变
 化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。
 (2) 风险归因模型——有效控制预期风险
 本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合
 的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。
 (3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投资收益
 本基金的交易成本模型综合考虑固定成本、也考虑交易的市场冲击
 效应，以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上，进
 行投资收益的优化。
 (4) 投资组合的优化和调整
 本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。
 其选股逻辑将包括流动性及基本面信息较好的股票。投资组合构建完成
 后，本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况，对投资组合进行相应
 调整，并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。
 2. 固定收益类资产投资策略
 固定收益类资产在保障资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信
 用风险管理策略和策略相结合的策略性投资方法，力求在控制各类风险
 的基础上获取稳定的收益。
 (1) 利率预期与久期控制策略
 本基金密切跟踪最新发布的市场宏观经济数据和金融运行数据，分析宏
 观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取
 向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平
 变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率将上升时，降低
 组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲
 线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略，如子弹型组合、哑铃型
 组合或者阶梯型组合等。
 (2) 个券选择策略
 个券选择层面，对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析
 后，进行个券选择。财务分析方面，以企业财务报表为依据，对宏观规
 模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分；非财务分析方
 面（包括管理能力、市场地位和发展前景等指标）则主要采取实地调研和
 电话会议等形式实施。
 (3) 时机策略
 i. 价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性，建立债券的估值
 模型，对当日无交易的债券计算理论价值，买进价格低于价值的债券；
 相反，卖出价格高于价值的债券。
 ii. 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，
 可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对
 高位债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时
 债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下
 滑，进而获得资本利得收益。
 iii. 息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将
 所获得资金投资于债券以获取超额收益。
 iv. 利率预期策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析，对利差水
 平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当前预期利差水平
 缩小，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差
 的缩小获得投资收益；当前预期利差水平扩大时，买入收益率低的债券同
 时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。
 3. 权证投资策略
 本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资。权证投资将以价值
 分析为基础，在采用数据化模型分析其合理定价的基础上，结合权证的
 溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择权证的买入和卖出时机，追
 求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
 4. 股指期货的投资策略
 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的
 前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性
 风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活
 跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期
 货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值
 水平。
 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 10.1 本期国债期货投资策略
 本基金暂不投资国债期货。
 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 本基金本报告期末未持有国债期货合约。
 10.3 本期国债期货投资评价
 本基金本报告期末未持有国债期货合约。
 11 投资组合报告附注
 11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部
 门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
 根据公开信息，本基金投资的前十名证券5根淮（证券代码：
 000658）于2018年8月24日晚间，公司4月间违反《证券法》、《证券
 公司监督管理条例》等法律法规，被中国证监会立案调查，目前正接受
 纪律审查和监察调查。
 11.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同
 规定的备选股票库之外的股票。
 11.3 其他资产构成

的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取300只交易活跃、代
 表性强、A股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率最高、代
 表性最强、公信力较好的股票指数。本基金为灵活配置混合型基金，股
 票资产的投资比例最高可达基金资产的95%，在扣除股指期货合约需
 缴纳的保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不
 低于基金资产的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应
 收申购款等。
 上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上
 证指数的所有权归属上海证券交易所。
 随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用
 本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，
 或者推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数，基金管理人
 可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一
 致后，对业绩比较基准进行相应调整，并报中国证监会备案并及时公
 告，无需召开基金份额持有人大会。
 十、风险收益特征
 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型
 基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中
 高收益的基金产品。
 十一、基金投资组合报告
 基金管理人的董事会及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
 别及连带责任。
 基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于
 2019年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报
 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。
 本报告中财务资料未经审计。投资组合报告所载数据截至2019年
 6月30日。
 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	196,241,197.16	93.60
2	其中:股票	196,241,197.16	93.60
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	13,212,200.02	6.38
11	其他资产	113,313.17	0.06
12	合计	209,463,690.05	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,329,967.09	0.24
B	采矿业	8,266,561.75	3.26
C	制造业	69,989,027.10	33.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,763,024.00	1.80
E	建筑业	7,261,803.48	3.47
F	批发和零售业	10,102,394.43	4.84
G	交通运输、仓储和邮政业	6,236,972.42	3.12
H	住宿和餐饮业	462,000.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,749,313.01	4.67
J	金融业	64,328,320.05	30.79
K	房地产业	10,362,889.06	4.97
L	租赁和商务服务业	195,337.57	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	66,332.00	0.03
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,226,126.80	1.07
S	其他	713,203.00	0.34
合计		196,241,197.16	93.60

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通过港股通机制投资的港股。
 3 报告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组合明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	190,000	8,831,888.00	4.28
2	601009	南京银行	725,900	5,995,934.00	2.87
3	600800	青岛海尔	331,500	5,731,636.00	2.74
4	600519	贵州茅台	5,700	5,608,800.00	2.68
5	600050	中国联通	794,000	4,534,364.00	2.31
6	600036	招商银行	694,838	4,477,434.00	2.24
7	600537	海通证券	322,960	4,162,660.00	2.19
8	600585	海螺水泥	32,700	3,156,960.00	1.55
9	600688	中国石化	47,200	3,016,176.00	1.43
10	600099	招商证券	222,012	3,794,180.00	1.82

4 报告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。
 5 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债
 券投资组合明细
 本基金本报告期末未持有债券。
 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资
 产支持证券投资组合明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。
 7 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
 金属投资组合明细
 本基金本报告期末未持有贵金属。
 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权
 证投资组合明细
 本基金本报告期末未持有权证。
 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 本基金本报告期末未持有股指期货合约。
 9.2 本基金投资股指期货的投资政策
 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控
 的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统
 性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交
 易活跃、交割期合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券
 市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合
 理的估值水平。
 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 10.1 本期国债期货投资策略
 本基金暂不投资国债期货。
 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 本基金本报告期末未持有国债期货合约。
 10.3 本期国债期货投资评价
 本基金本报告期末未持有国债期货合约。
 11 投资组合报告附注
 11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部
 门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
 根据公开信息，本基金投资的前十名证券5根淮（证券代码：
 000658）于2018年8月24日晚间，公司4月间违反《证券法》、《证券
 公司监督管理条例》等法律法规，被中国证监会立案调查，目前正接受
 纪律审查和监察调查。
 11.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同
 规定的备选股票库之外的股票。
 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	88,197.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,114.16
5	应收申购款	20,000.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	113,313.77

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
 由于四舍五入的原因，本报告中出现比例计算的分项之和与合计数
 之间可能存在尾差。
 十二、基金业绩
 本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运
 用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往
 业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应
 仔细阅读本基金的招募说明书。
 (一) 基金净值表现
 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	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(
----	----------	-------------	------------