

## 2019年12月31日 星期一

[illegible][illegible]

6	其他非流动资产	—	—
7	无形资产	—	—
8	递延所得税资产	—	—
9	其他非流动资产	—	—
10	资产总计	144,869,792.27	100.00

2. 合并现金流量表(单位:万元)

项目	2017年1-6月	2016年1-6月
一、经营活动产生的现金流量	10,410,237.68	7,382,632.81
二、投资活动产生的现金流量	-835,782.30	6,320.87
三、筹资活动产生的现金流量	—	—
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	—	—
五、现金及现金等价物净增加额	9,574,455.38	7,388,953.68
六、期初现金及现金等价物余额	10,410,237.68	10,410,237.68
七、期末现金及现金等价物余额	19,984,693.06	17,799,191.36

3. 合并所有者权益变动表(单位:万元)

项目	2017年1-6月	2016年1-6月
一、所有者权益	144,869,792.27	144,869,792.27
二、所有者权益变动	—	—
三、所有者权益变动	—	—
四、所有者权益变动	—	—
五、所有者权益变动	—	—
六、所有者权益变动	—	—
七、所有者权益变动	—	—
八、所有者权益变动	—	—
九、所有者权益变动	—	—
十、所有者权益变动	—	—
十一、所有者权益变动	—	—
十二、所有者权益变动	—	—
十三、所有者权益变动	—	—
十四、所有者权益变动	—	—
十五、所有者权益变动	—	—
十六、所有者权益变动	—	—
十七、所有者权益变动	—	—
十八、所有者权益变动	—	—
十九、所有者权益变动	—	—
二十、所有者权益变动	—	—
二十一、所有者权益变动	—	—
二十二、所有者权益变动	—	—
二十三、所有者权益变动	—	—
二十四、所有者权益变动	—	—
二十五、所有者权益变动	—	—
二十六、所有者权益变动	—	—
二十七、所有者权益变动	—	—
二十八、所有者权益变动	—	—
二十九、所有者权益变动	—	—
三十、所有者权益变动	—	—
三十一、所有者权益变动	—	—
三十二、所有者权益变动	—	—
三十三、所有者权益变动	—	—
三十四、所有者权益变动	—	—
三十五、所有者权益变动	—	—
三十六、所有者权益变动	—	—
三十七、所有者权益变动	—	—
三十八、所有者权益变动	—	—
三十九、所有者权益变动	—	—
四十、所有者权益变动	—	—
四十一、所有者权益变动	—	—
四十二、所有者权益变动	—	—
四十三、所有者权益变动	—	—
四十四、所有者权益变动	—	—
四十五、所有者权益变动	—	—
四十六、所有者权益变动	—	—
四十七、所有者权益变动	—	—
四十八、所有者权益变动	—	—
四十九、所有者权益变动	—	—
五十、所有者权益变动	—	—
五十一、所有者权益变动	—	—
五十二、所有者权益变动	—	—
五十三、所有者权益变动	—	—
五十四、所有者权益变动	—	—
五十五、所有者权益变动	—	—
五十六、所有者权益变动	—	—
五十七、所有者权益变动	—	—
五十八、所有者权益变动	—	—
五十九、所有者权益变动	—	—
六十、所有者权益变动	—	—
六十一、所有者权益变动	—	—
六十二、所有者权益变动	—	—
六十三、所有者权益变动	—	—
六十四、所有者权益变动	—	—
六十五、所有者权益变动	—	—
六十六、所有者权益变动	—	—
六十七、所有者权益变动	—	—
六十八、所有者权益变动	—	—
六十九、所有者权益变动	—	—
七十、所有者权益变动	—	—
七十一、所有者权益变动	—	—
七十二、所有者权益变动	—	—
七十三、所有者权益变动	—	—
七十四、所有者权益变动	—	—
七十五、所有者权益变动	—	—
七十六、所有者权益变动	—	—
七十七、所有者权益变动	—	—
七十八、所有者权益变动	—	—
七十九、所有者权益变动	—	—
八十、所有者权益变动	—	—
八十一、所有者权益变动	—	—
八十二、所有者权益变动	—	—
八十三、所有者权益变动	—	—
八十四、所有者权益变动	—	—
八十五、所有者权益变动	—	—
八十六、所有者权益变动	—	—
八十七、所有者权益变动	—	—
八十八、所有者权益变动	—	—
八十九、所有者权益变动	—	—
九十、所有者权益变动	—	—
九十一、所有者权益变动	—	—
九十二、所有者权益变动	—	—
九十三、所有者权益变动	—	—
九十四、所有者权益变动	—	—
九十五、所有者权益变动	—	—
九十六、所有者权益变动	—	—
九十七、所有者权益变动	—	—
九十八、所有者权益变动	—	—
九十九、所有者权益变动	—	—
一百、所有者权益变动	—	—

1	300623	聚辰科技	345,000	13,972,500.00	0.74
2	600436	片仔癀	129,560	12,887,620.00	0.69
3	002891	中农股份	442,728	9,354,580.56	0.52
4	000023	国兴一农	102,146	7,966,019.54	0.46
5	603999	陇神盐业	149,190	7,638,529.00	0.43
6	002549	国星光电	667,600	7,219,085.00	0.40
7	603516	淳中科技	232,560	7,265,626.00	0.37
8	300630	普利制药	129,071	6,566,525.10	0.40
9	002912	中顺洁柔	66,600	6,320,340.00	0.41

[illegible][illegible]

1.13 基金投资组合前十名股票：本基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

1.13.3 投资组合报告

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	71,119,660
2	应收证券清算款	369,047,006
3	应收股利	-
4	应收利息	2,680,395
5	应收中购款	72,917,785
6	其他应收款	-

7	持续使用	--
8	其他	--
9	合计	615,796.38

1. 因前期未持有导致较前期9月9日提高的原因  
 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。  
 1.2 因前期未持有导致较前期9月9日提高的原因  
 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。  
 1.3 因前期未持有导致较前期9月9日提高的原因  
 1.4 因前期未持有导致较前期9月9日提高的原因

**第十二部分、基金的投资**

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,为基金份额持有人谋求利益。基金的投资组合并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出任何投资决策之前应仔细阅读基金招募说明书。基金业绩数据截至2019年9月30日。

1. 投资目标  
 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,以追求超越业绩比较基准收益为目标。

阶段	净现值增长率 ①	净现值增长率 ②	净现值增长率 ③	净现值增长率 ④	①-③	②-④
2011年12月22日 -2011年12月31日	-20.40%	1.03%	-27.09%	1.15%	7.29%	-0.12%
2012年	0.76%	1.17%	1.86%	1.19%	-1.11%	-0.02%
2013年	39.40%	1.30%	8.17%	1.13%	31.22%	0.17%
2014年	1.34%	1.16%	32.29%	0.96%	-31.46%	0.20%
2015年	60.37%	2.82%	28.69%	2.21%	31.68%	0.60%
2016年	-13.35%	1.77%	-13.43%	1.45%	0.08%	0.32%
2017年	18.91%	0.92%	2.60%	0.67%	16.31%	0.25%

2019年	21.07%	1.64%	-28.51%	1.17%	4.44%	0.77%
2019年1月1日 -2019年6月30日	13.40%	1.61%	17.26%	1.38%	-3.06%	0.23%
2019年5月1日 -2019年9月30日	22.89%	1.49%	17.96%	1.24%	4.03%	0.26%
2011年3月22日 -2019年12月31日	81.61%	1.58%	6.26%	1.31%	75.36%	0.27%

2、自成立至今,公司未发生任何重大资产重组及收购行为,亦不存在因合并报表范围变更而导致的关联交易。

注：本基金的高产资产配置为：基金资产的90%-95%投资于股票资产和权益类资产（其中，权益类资产比例不超过基金资产净值的5%），基金资产的5%-10%投资于债券和现金等固定收益类资产（其中，此类资产的日在一年内到期部分不低于基金资产净值的5%），基金资产净值中不低于5%投资于国债等资产。本基金的建仓期为自2014年3月22日基金合同生效日起6个月。建仓期间，本基金资产的投资比例符合上述约定。

十一、与基金运作有关的费用

(一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
4. 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金的审计费；
7. 基金的销售费用；
8. 按照国家有关规定在基金合同项下, 可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用, 按实际支出金额从基金财产总值中扣除。

(二) 基金费用的计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$
[illegible]

认购金额 (M)	认购费率
M < 100万	1.2%
100万 ≤ M < 500万	0.8%
M ≥ 500万	按笔收取, 1000元/笔

(注)计算公式:  
本基金的认购份额的计算如后:  
净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)  
认购费用 = 认购金额 - 净认购金额  
认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金单位净值  
认购人缴纳的认购资金在认购期间产生的利息将计入其认购份额中, 由此认购产生的损失由基金财产承担, 产生的收益归基金财产所有。  
(1) 申购费率  
a. 申购费率

投資資金按實際投入的費用,並扣除已收(未收)金額為基礎計算其費用,費率示如下:

申購金額 (M)	申購費率
M < 100萬	1.5%
100萬 ≤ M < 1000萬	1.0%
M ≥ 500萬	按實收收, 1000元/毫

(2) 計算公式

本基金的費用計算如下:

淨申購金額 = 申購金額 (1 - 申購費率)

申購的淨申購金額 = 申購金額 - 申購金額

申購手續費 = 申購金額 - 申購淨申購金額

基金淨申購金額 = 淨申購金額 - 申購手續費

基金淨申購金額計算結果保留的小數點以後兩位,小數點以後兩位以內的部分四舍五入,由此處產生的損失由基金財產承擔,產生的收益歸基金所有。

3. 認購費

本基金的投资组合中投资于本基金基金份额的款数,扣除用于申购赎回、注册登记和其他相关业务的余额后,本基金的其他资产中不得再持有该基金份额。

持有时间	赎回费率	归基金资产比例
7日以内	1.5%	100%
7日(含)-1年	0.5%	25%
1年以上(含)-2年	0.25%	25%
2年以上(含)	0	-

注:赎回费计入净值,1年按360天。

(2) 计算方式

本基金赎回金额的计算公式为:赎回金额按以T日的基金份额净值作为基准进行计算,本基金赎回金额的计算如下:

赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用  
赎回金额按上述计算结果的当日基金份额净值为基础并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

4、申购费与赎回费

(1) 本基金的各项费用均须由投资者承担。申购及赎回的费率，转入及转出申购补费，其中赎回费按照收取标准在本基金赎回说明书约定，申购补费的收取标准为：申购补费 = MAX{【转出净额在转入基金中对应的申购费用 - 转出净额在转出基金中对应的申购费用】，0}

(2) 计算赎回费

① 基金赎回费按照如下计算：  
由股票基金转出时：  
转出总额 = 转出额 × 转出基金当日基金份额净值  
由货币基金转出时：  
转出总额 = 转出金额 + 利息 = [转出本金 + 利息] × 转出基金当日基金份额净值

[illegible][illegible]