

**(上接A40版)**  
金,高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

**第十一部分 投资组合报告**

**一、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	62,240,473.13	64.36
2	固定收益投资	63,240,473.13	64.36
3	银行存款	600,120.00	0.63
4	买入返售金融资产	600,120.00	0.63
5	其他资产	-	-
6	负债	-	-
7	净资产	91,081,066.26	93.38

注:本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为4,197,100.00元,占资产净值比例为6.65%;通过深港通交易机制投资的港股公允价值为8,512,265.00元,占资产净值比例为11.52%。

**二、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物	87,210,656	94.70
B	金融	36,297,488.65	39.75
C	其他	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑	-	-
F	农林牧渔	-	-
G	交通运输	-	-
H	国防军工	-	-
I	计算机、软件和信息技术服务	33,927.60	0.04
J	金融	1,461,628.94	1.60
K	其他	-	-
L	其他	3,489,264.00	3.82
M	其他	1,213,260.00	1.33
N	其他	-	-
O	其他	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
T	其他	-	-
合计		49,320,303.13	53.05

**三、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

行业名称	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
医药、生物	3,457,800.00	3.84
金融	2,036,800.00	2.24
金融	741,100.00	0.81
非货币资金类资产	3,792,000.00	4.15
其他	1,826,000.00	2.01
其他	326,000.00	0.36
合计	13,280,200.00	14.41

注:1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。  
2、以上行业分类的统计中已包含沪港通深港通投资的股票。

**四、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	601088	中国神华	48,000.00	3,389,280.00	3.69
2	600619	贵州茅台	4,000.00	3,288,000.00	3.60
3	600436	片仔癀	32,000.00	3,088,400.00	3.39
4	000062	凤凰传媒	30,000.00	2,588,500.00	2.84
5	000021	深高新能	9,500.00	2,311,000.00	2.54
6	000001	平安银行	82,000.00	2,036,800.00	2.24
7	000033	荣信股份	50,000.00	2,448,000.00	2.67
8	603288	海天味业	25,200.00	2,443,820.00	2.67
9	000032	白云山	39,000.00	819,400.00	0.89
10	000714	比亚迪	20,000.00	1,569,500.00	1.71
11	000039	工商银行为	38,000.00	2,348,000.00	2.57

**五、报告期末按品种分类的债券投资组合**

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	600,120.00	0.65
2	央行票据	-	-
3	中期票据	-	-
4	其他	-	-
5	可转债	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	-	-
11	其他	-	-
12	其他	-	-
13	其他	-	-
14	其他	-	-
15	其他	-	-
16	其他	-	-
17	其他	-	-
18	其他	-	-
19	其他	-	-
20	其他	-	-
21	其他	-	-
22	其他	-	-
23	其他	-	-
24	其他	-	-
25	其他	-	-
26	其他	-	-
27	其他	-	-
28	其他	-	-
29	其他	-	-
30	其他	-	-
31	其他	-	-
32	其他	-	-
33	其他	-	-
34	其他	-	-
35	其他	-	-
36	其他	-	-
37	其他	-	-
38	其他	-	-
39	其他	-	-
40	其他	-	-
41	其他	-	-
42	其他	-	-
43	其他	-	-
44	其他	-	-
45	其他	-	-
46	其他	-	-
47	其他	-	-
48	其他	-	-
49	其他	-	-
50	其他	-	-
51	其他	-	-
52	其他	-	-
53	其他	-	-
54	其他	-	-
55	其他	-	-
56	其他	-	-
57	其他	-	-
58	其他	-	-
59	其他	-	-
60	其他	-	-
61	其他	-	-
62	其他	-	-
63	其他	-	-
64	其他	-	-
65	其他	-	-
66	其他	-	-
67	其他	-	-
68	其他	-	-
69	其他	-	-
70	其他	-	-
71	其他	-	-
72	其他	-	-
73	其他	-	-
74	其他	-	-
75	其他	-	-
76	其他	-	-
77	其他	-	-
78	其他	-	-
79	其他	-	-
80	其他	-	-
81	其他	-	-
82	其他	-	-
83	其他	-	-
84	其他	-	-
85	其他	-	-
86	其他	-	-
87	其他	-	-
88	其他	-	-
89	其他	-	-
90	其他	-	-
91	其他	-	-
92	其他	-	-
93	其他	-	-
94	其他	-	-
95	其他	-	-
96	其他	-	-
97	其他	-	-
98	其他	-	-
99	其他	-	-
100	其他	-	-

**六、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明细**

序号	债券名称	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019544	19国债01	6,000.00	600,120.00	0.65

**七、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明细**

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**八、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**

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**九、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明细**

注:本基金本报告期末未持有权证。

**十、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

(一)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动损益(元)	持仓损益(元)
-	-
-	-

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

**(二) 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

**十一、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**(一) 本期国债期货投资政策**

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

**(二) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

公允价值变动损益(元)	持仓损益(元)
-	-
-	-

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

**(三) 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**十二、投资组合报告附注**

**(一) 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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。

**(二) 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票范围。**

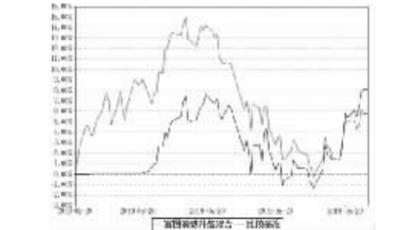
本基金本报告期末基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**(三) 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	30,603.97
2	应收利息	-
3	应收股利	129,318.84
4	应收款项	16,263.59
5	预付款项	12,612.24
6	其他	-
7	其他	-
8	其他	-
9	其他	-
10	其他	-
11	其他	-
12	其他	-
13	其他	-
14	其他	-
15	其他	-
16	其他	-
17	其他	-
18	其他	-
19	其他	-
20	其他	-
21	其他	-
22	其他	-
23	其他	-
24	其他	-
25	其他	-
26	其他	-
27	其他	-
28	其他	-
29	其他	-
30	其他	-
31	其他	-
32	其他	-
33	其他	-
34	其他	-
35	其他	-
36	其他	-
37	其他	-
38	其他	-
39	其他	-
40	其他	-
41	其他	-
42	其他	-
43	其他	-
44	其他	-
45	其他	-
46	其他	-
47	其他	-
48	其他	-
49	其他	-
50	其他	-
51	其他	-
52	其他	-
53	其他	-
54	其他	-
55	其他	-
56	其他	-
57	其他	-
58	其他	-
59	其他	-
60	其他	-
61	其他	-
62	其他	-
63	其他	-
64	其他	-
65	其他	-
66	其他	-
67	其他	-
68	其他	-
69	其他	-
70	其他	-
71	其他	-
72	其他	-
73	其他	-
74	其他	-
75	其他	-
76	其他	-
77	其他	-
78	其他	-
79	其他	-
80	其他	-
81	其他	-
82	其他	-
83	其他	-
84	其他	-
85	其他	-
86	其他	-
87	其他	-
88	其他	-
89	其他	-
90	其他	-
91	其他	-
92	其他	-
93	其他	-
94	其他	-
95	其他	-
96	其他	-
97	其他	-
98	其他	-
99	其他	-
100	其他	-

**二、 自基金合同生效以来基金累计资产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.截止日期为2019年6月30日。  
2.本基金于2019年2月20日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月,从2019年2月20日起至2019年8月19日,本期末建仓尚未结束。

**第十三部分 费用概览**

**一、基金费用的种类**

- 基金管理人的管理费;
- 基金托管人的托管费;
- 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
- 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼费等相关费用;
- 基金份额持有人大会费用;
- 基金的证券、期货等交易费用;
- 基金的银行汇划费用;
- 基金相关账户的开户和维护费用;
- 因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用;
- 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用