

[illegible]

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	002834	东山精密	9,745,460	170,281,374.24	10.15
2	600703	三安光电	7,426,760	181,289,240.00	6.23
3	000651	格力电器	1,899,004	160,120,000.00	3.84
4	000049	德赛电池	2,350,054	71,603,583.72	2.58
5	002077	大港股份	5,656,620	67,652,936.00	2.45
6	300476	恒丰科技	6,622,127	66,338,813.20	2.40
7	003460	赣锋锂业	749,533	64,343,230.90	2.37
8	601318	中国平安	1,179,377	63,872,380.32	2.31
9	002128	顺天药业	4,502,890	59,121,764.00	2.14
10	300365	恒华科技	4,499,720	56,194,504.80	2.04

注:本报告期末本基金投资于前十大重仓股(002834)比例占基金资产净值比例10%,属于波动因素。

6. 报告期末按券种分类前五名的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,659,000.00	3.97
其中:政策性金融债	109,659,000.00	3.97	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	773,120.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	110,432,120.00	4.00

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170207	17国债07	1,100,000	109,659,000.00	3.97
2	123003	15国债03	7,560	773,120.00	0.03

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明细

1. 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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

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明细

本基金本报告期末未投资权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金报告期内未持有股票资产,因此不存在报告期内有被证监会立案调查,或在报告期内前一个会计年度内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票。

(3) 其他各项资产无变动。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	960,040.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	955,904.04
5	应收申购款	3,241,521.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,157,466.84

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123003	15国债03	773,120.00	0.03

(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。

二、基金业绩

本基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,遵循诚实信用原则管理运用基金财产,但本基金业绩不一定能反映或超越基金净值收益并不代表其未来表现,没有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书等法律文件。

本基金本报告期末及2016年1月13日,基金自成立生效(截至2017年6月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的对比如下:

阶段	净值增长(1)	净值增长率(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
基金合同生效至2016年12月31日	8.97%	1.35%	-0.61%	2.22%	9.58%	-0.87%
2009年1月1日至2009年12月31日	70.14%	15.7%	85.8%	1.85%	-15.71%	-0.28%
2010年1月1日至2010年12月31日	1.69%	1.36%	-10.80%	1.22%	12.49%	0.14%
2011年1月1日至2011年12月31日	-22.22%	1.24%	-18.35%	1.00%	-4.88%	0.24%
2012年1月1日至2012年12月31日	4.78%	1.28%	5.51%	0.97%	-0.81%	0.31%
2013年1月1日至2013年12月31日	23.81%	1.30%	-9.18%	1.19%	32.99%	0.11%
2014年1月1日至2014年12月31日	18.43%	1.24%	42.94%	0.91%	-24.41%	0.33%
2015年1月1日至2015年12月31日	91.23%	2.93%	22.29%	2.11%	68.94%	0.82%
2016年1月1日至2016年12月31日	-14.82%	1.81%	-6.48%	1.14%	-8.34%	0.67%
2017年1月1日至2017年6月30日	115.26%	0.84%	91.4%	0.49%	23.8%	0.35%
基金合同生效至2017年6月30日	303.63%	1.64%	129.26%	1.35%	174.37%	0.29%

三、费用说明

(一)与基金运作相关的费用

1. 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) 基金业绩报酬;

(4) 会计师事务所审计费;

(5) 基金销售服务费;

(6) 基金的资金汇兑费用;

(7) 基金资产的银行汇划费;

(8) 按照国家有关规定从基金资产中列支,可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 基金费用计提方法、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:

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

H为每日应计提的管理费

E为前一日的基金资产净值

管理费自基金合同生效日起,逐日计提每月月末、按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理人划款指令,基金托管人根据指令于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,并计入基金费用,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的25‰年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的托管费

E为前一日的基金资产净值

托管费自基金合同生效日起,逐日计提每月月末、按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人根据指令于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(3) 基金业绩报酬

1) 业绩报酬计提方法:由(3)-(7)项费用,根据相关法律法规及相应协议规定,按费用支出金额占当期费用,由基金托管人向基金管理人支付。

2) 业绩报酬计提时间:基金管理人应于基金合同生效后次月15日前将业绩报酬支付或基金财产的损失。

(4) 基金费用的调整

(5) 基金费用的列支

(6) 基金费用的追索

基金管理人应当在每个季度结束之日起前在指定媒体和基金管理人网站上公告。

二、申购费

(1) 申购费率

本基金通过本公司直销中心申购的特定投资群体(指除此之外的其他投资者)实施差别费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划账户持有人所指定的投资相关管理机构等。申购费率如下表所示:

申购金额M(元)(含申购费)	申购费率
M < 1000	0.15%
1000 ≤ M < 5000	0.12%
5000 ≤ M < 10000	0.03%
M ≥ 10000	1000元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率为:

申购金额M(元)(含申购费)	申购费率
M < 1000	1.5%
1000 ≤ M < 5000	1.2%
5000 ≤ M < 10000	0.3%
M ≥ 10000	1000元/笔

2) 申购费收取方式说明

在申购费按费率收取的情况下,如果投资者首次申购,申购费适用单费率申购费对应的费率。

申购费由申购基金份额的基金投资人承担,申购费用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(3) 申购份额的计算方式

申购份额=申购金额/申购当日基金份额净值,其中:

申购金额=申购金额/(1+申购费率)或申购金额/申购费率

申购份额=申购金额/(1+申购费率)或申购金额/申购费率

申购份额=申购金额/申购当日基金份额净值

申购费用以人民币元为单位,四舍五入,保留至小数点后二位;申购的基金份额四舍五入,方保留至小数点后二位,由此产生的误差计入基金财产。

(4) 申购赎回费率

1) 赎回费率

持有时间(天)	赎回费率
0-364	0.5%
365-729	0.2%
730及以上	0%

注:对于投资者持有基金期间持有的基金份额赎回费,持有期限自赎回申请后下一日起的次日(含)起计算,对于申购时取得的基金份额,持有期限自申购后下一日起按自然日计算之日起计算。

2) 赎回费收入的用途

本基金赎回费收入,本基金份额持有人认购基金份额时收取,用于赎回费收入的25%归基金管理人,其余用于支付市场推广和销售其他必要的费用。

(5) 基金赎回金额的计算方式

本基金赎回金额=赎回总额-赎回费用,其中:

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额以人民币元为单位,四舍五入,保留小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产。

3. 转换费率

本基金管理人已开通了本基金与旗下部分开放式基金之间的转换业务,具体实施办法和费率请参见相关公告。基金转换业务基金持有人享有权利,基金转换费用由转出基金份额赎回费及基金申购费补差两部分组成,其中申购费补差基金基金净值,申购费补差