红土创新增强收益债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:红土创新基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	红土创新增强收益债券	
交易代码	006061	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年7月25日	
报告期末基金份额总额	302,303,105.02份	
投资目标	本基金主要投资于债券资产,通过精选信用债券,并适度参与权益类品种投资以增强基金获利能力,提高基金收益水平。在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金所定义的收益增强是指在债券配置基础上,进行适当的权益类品种投资以增强基金获利能力,提高基金收益水平。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率*10%+中证全债指数收益率*90%。	
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的较低风险品种。其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	红土创新增强收益债券A	红土创新增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	006061	006064
报告期末下属分级基金的份额总额	287,017,401.56份	15,285,703.46份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	红土创新增强收益债券A	红土创新增强收益债券C
1. 本期已实现收益	806,221.80	63,931.29
2. 本期利润	2,718,307.42	114,051.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0142	0.0125
4. 期末基金资产净值	308,431,921.67	16,394,875.92
5. 期末基金份额净值	1.0746	1.0726

注:1.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损益。

2.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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

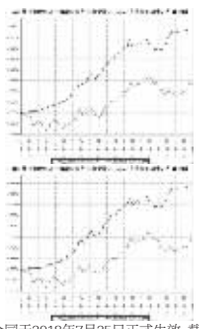
红土创新增强收益债券A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.29%	0.08%	-0.42%	0.14%	1.71%	-0.06%

红土创新增强收益债券C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.28%	0.09%	-0.42%	0.14%	1.70%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、本基金基金合同于2018年7月25日正式生效,截至报告期末未满一年;

2、按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁戈伟	基金经理	2018年7月25日	-	10	厦门大学金融学学士。十年公募基金从业经验,历任宝盈基金营销策划经理、高级交易员。现担任红土创新货币市场基金、红土创新优淳货币市场基金、红土创新增强收益债券型基金基金经理。
陈若劲	基金经理	2019年3月13日	-	15	15年证券行业投研经验,香港中文大学金融MBA。曾在宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员,固定收益部总监。宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金的基金经理。现任红土创新基金管理有限公司固定收益部总监,红土创新稳健混合型证券投资基金、红土创新增强收益债券型证券投资基金的基金经理。

注:1. 对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《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

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,国内经济下行风险加大,制造业投资、出口、消费等均面临持续回落的压力,但地产投资仍保持韧性。中美贸易冲突波折加剧,全球主要经济体增长前景均较为疲弱,外需不振给国内出口相关经济部门造成负面拖累。5月下旬包商银行被接管后,银行间市场的风险偏好迅速下降,部分银行负债端压力上升,在央行的呵护下,资金价格持续下行,银行间隔夜回购利率一度达到近几年以来的最低点。本基金始终坚持严格的信用风险控制,未受到包商银行事件的直接冲击。报告期内,本基金以持有3-5年高等级信用债为主,适时参与了利率债的波段操作。

展望2019年三季度,国内经济继续处于磨底阶段,逆周期政策的持续发力有望推动内需逐步趋于稳定,通胀压力可控,海外主要经济体陆续进入降息周期,有望打开国内政策空间,货币政策整体仍将维持宽松。本基金将继续维持适度的杠杆和合理的久期水平,坚持严格的信用风险控制,积极把握债券一二级市场投资机会,提升组合收益水平。同时,紧密关注转债市场和权益市场的变化,适时考虑大类资产的切换。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红土创新增强收益债券A基金份额净值为1.0746元,本报告期基金份额净值增长率为1.29%;截至本报告期末红土创新增强收益债券C基金份额净值为1.0726元,本报告期基金份额净值增长率为1.28%;同期业绩比较基准收益率为-0.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人、基金资产净值低于5000万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	419,936,079.70	98.35
	其中:债券	419,936,079.70	98.35
	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	3,099,501.18	0.73
8	其他资产	3,936,515.42	0.92
9	合计	426,972,096.30	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末无股票投资

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无股票投资

5.3 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明细

本基金本报告期末无股票投资

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	32,131,616.00	9.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	137,782,500.00	42.42
5	企业短期融资券	20,014,000.00	6.16
6	中期票据	207,438,500.00	63.86
7	可转债(可交换债)	22,569,463.70	6.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	419,936,079.70	129.28

5.5 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	101900586	19中油股MTN005	300,000	30,153,000.00	9.28
2	155478	19联通01	300,000	30,111,000.00	9.27
3	132004	15国盛EB	213,290	21,015,463.70	6.47
4	101900807	19中铁股MTN004C	200,000	20,118,000.00	6.19
5	155473	19华电03	200,000	20,062,000.00	6.18

5.6 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

5.7 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明细

本基金本报告期末无贵金属投资。

5.8 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

本基金本报告期末无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编辑日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	35,165.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,789,453.67
5	应收申购款	1,111,896.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,936,515.42

5.10.4 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	132004	15国盛EB	21,015,463.70	6.47

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.6 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,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	红土创新增强收益债券A	红土创新增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	196,416,363.93	7,383,375.62
报告期期间基金总申购份额	126,389,066.98	14,100,336.12
减:报告期期间基金总赎回份额	34,788,029.35	6,198,008.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	287,017,401.56	15,285,703.46

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190416-20190622	34,999,000.00	-	-	34,999,000.00	11.58%
个人	1	20190401-20190618	58,950,677.93	0.00	0.00	58,950,677.93	19.50%

产品特有风险

1.巨额赎回风险

(1)本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大,单一投资者的巨额赎回,可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响;

(2)单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回,在发生巨额赎回情形时,在符合基金合同约定情况下,如基金管理人认为有必要,可延期办理本基金的赎回申请,投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险;如果连续2个开放日以上(含)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

2.转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后,若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人,基金管理人应当向中国证监会提出解决方案,或按基金合同约定,转换运作方式或终止基金合同,其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险;

3.流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;

4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小,导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准红土创新增强收益债券型证券投资基金设立的文件

(2)红土创新增强收益债券型证券投资基金基金合同

(3)红土创新增强收益债券型证券投资基金托管协议

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)报告期内红土创新增强收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

(1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人红土创新基金管理有限公司,客户服务电话:4000603333(免长途话费)

红土创新中证500指数增强型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:红土创新基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	红土创新中证500增强	
交易代码	006783	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年2月25日	
报告期末基金份额总额	11,852,576.34份	
投资目标	本基金为指数增强型股票基金,采取定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。	
投资策略	本基金为指数增强型股票基金,采取定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。未来,随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,在履行适当程序后相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,具有与标的指数类似的风险收益特征。	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
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	006783	006784
报告期末下属分级基金的份额总额	6,040,610.37份	5,811,965.97份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	中证500增强A	中证500增强C
1. 本期已实现收益	-123,049.41	-155,011.54
2. 本期利润	-458,447.41	-538,011.55
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0751	-0.0874
4. 期末基金资产净值	6,121,765.52	5,882,080.55
5. 期末基金份额净值	1.0134	1.0121

注:1、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损益。

2.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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-7.27%	1.60%	-10.19%	1.72%	2.92%	-0.12%

中证500增强C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-7.37%	1.60%	-10.19%	1.72%	2.82%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、本基金基金合同于2019年2月25日正式生效,截至报告期末未满一年;

2.按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
庞世恩	基金经理	2019年4月19日	-	8	中国人民大学理学硕士。曾任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究总监、执行投资经理;创金合信基金管理有限公司量化投资部基金经理,管理过创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金、创金合信量化多因子股票型证券投资基金,创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金。现任红上创新基金管理有限公司量化投资部负责人,担任红上创新沪深300指数增强型发起式证券投资基金、中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
储荞	基金经理	2019年2月25日	-	6	中国人民大学经济学硕士,历任鹏华基金管理有限公司量化研究员、创金合信基金管理有限公司量化研究员、投资经理。现任红上创新沪深300指数增强型发起式证券投资基金、红上创新中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》,通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合,切实防范利益输送。本报告期,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,本基金与管理人管理的其他投资组合存在构成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%的交易,本基金为量化选股策略基金,发生反向交易行为的原因为:基金在调仓时点,多个选股模型在少数股票上产生分歧,产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易,全天匀速缓成交,未对当天的股票价格产生冲击。本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2019年二季度,我们严格依据量化模型进行投资,并严格进行风险管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中证500增强A基金份额净值为1.0134元,本报告期基金份额净值增长率为-7.27%;截至本报告期末中证500增强C基金份额净值为1.0121元,本报告期基金份额净值增长率为-7.37%;同期业绩比较基准收益率为-10.19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

§5 投资组合报告

5.1 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	11,257,877.05	93.01
	其中:股票	11,257,877.05	93.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	615,369.00	5.08
	其中:债券	615,369.00	5.08
	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	196,120.47	1.62
8	其他资产	12,104,103.37	100.00
9	合计	12,104,103.37	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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、渔业	80,665.00	0.67
B	采矿业	253,808.00	2.11
C	制造业	4,885,864.75	40.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	267,597.20	2.23
E	建筑业	232,929.80	1.94
F	批发和零售业	362,403.00	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	374,579.00	3.12
H	住宿和餐饮业	52,142.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	723,132.10	6.02
J	金融业	251,256.00	2.09
K	房地产业	524,866.40	4.37
L	租赁和商务服务业	150,677.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	38,082.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	291,231.00	2.43
S	综合	102,110.00	0.85
	合计	8,691,343.25	71.57

5.2.2 报告期末积极投资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、渔业	-	-
B	采矿业	47,654.00	0.40
C	制造业	1,446,174.30	12.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,378.00	1.09
E	建筑业	46,483.00	0.39
F	批发和零售业	180,071.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	45,759.00	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,317.00	2.09
J	金融业	156,332.00	1.30
K	房地产业	188,335.50	1.57
L	租赁和商务服务业	38,144.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	22,725.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	25,608.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	61,680.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	25,873.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	2,666,533.80	22.21

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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明细

5.3.1 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	600779	水井坊	1,600	81,312.00	0.68
2	000800	顺鑫农业	1,710	79,771.50	0.66
3	600426	华鲁恒升	5,300	78,758.00	0.66
4	000401	冀东水泥	4,300	75,723.00	0.63
5	300383	光环新网	4,400	73,788.00	0.61
6	002195	二三四五	18,690	72,704.10	0.61
7	002223	鱼跃医疗	2,900	71,398.00	0.59
8	000623	吉林敖东	4,300	70,477.00	0.59
9	002439	启明星辰	2,600	69,940.00	0.58
10	603369	今世缘	2,500	69,725.00	0.58

5.3.2 报告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

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	002410	广联达	2,900	95,381.00	0.79
2	000656	金科股份	12,600	75,978.00	0.63
3	300146	汤臣倍健	3,900	75,660.00	0.63
4	300347	泰格医药	800	61,680.00	0.51
5	002013	中航机电	7,900	54,352.00	0.45

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	615,369.00	5.13
	其中:政策性金融债	615,369.00	5.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	615,369.00	5.13

5.5 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	108603	国开1804	6,150	615,369.00	5.13

5.6 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

无。

5.7 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明细

无。

5.8 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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中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,参与股指期货的投资。此外,本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险,如预期大额申购赎回,大量分红等。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编辑日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,601.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,532.87
5	应收申购款	13,602.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,736.85

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中证500增强A	中证500增强C
报告期期初基金份额总额	6,467,163.13	6,361,794.02
报告期期间基金总申购份额	569,442.53	1,281,143.32
减:报告期期间基金总赎回份额	995,996.29	1,830,971.37
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	6,040,610.37	5,811,965.97

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,800.08
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	10,000,800.08
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	84.38

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	84.38	10,000,800.08	92.29	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.08	84.38	10,000,800.08	92.29	三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	10,000,800.08	0.00	0.00	10,000,800.08	84.38%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1.巨额赎回风险

(1)本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大,单一投资者的巨额赎回,可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响;

(2)单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回,在发生巨额赎回情形时,在符合基金合同约定情况下,如基金管理人认为有必要,可延期办理本基金的赎回申请,投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险;如果连续2个开放日以上(含)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;