

2018年6月30日

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

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	-	-

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	3,917,836.00	5.27
C	制造业	49,588,633.28	66.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	计算机、软件和其他信息技术服务				
J	金融		1,098,433.58		1.48
K	制造业				-
L	消费品零售服务				-
M	医药和生物技术服务				-
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	信息和通信技术				-
R	文化、体育和娱乐业				-
S	综合				-
	总计		54,600,902.86		73.48

5.2.2 根据报告对行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末公允价值计量资产公允价值占资产净值比例大于或等于10%的前十名股票投资明细

	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	000338	潍柴动力	214,800	4,504,500.00	6.06
2	000884	杉杉股份	180,800	3,995,680.00	5.35
3	500073	当升科技	92,304	3,143,874.24	4.28

4	603799	华安宏信	31,216	3,042,623.52	4.09
5	503007	普济堂	100,000	2,703,111.00	3.66
6	300014	亿阳信託	1,010,000	2,622,000.00	3.51
7	603028	中国石化	374,500	2,473,101.00	3.27
8	603659	瑞泰昌	37,000	2,369,680.00	3.19
9	002812	国联股份	45,000	2,210,850.00	2.97
10	600741	华域汽车	84,500	2,013,828.00	2.71

5.4 报告期末按投资组合分类的持仓投资组合

序号	投资组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资组合	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
4	资产-高信用等级金融债	--	--
5	基金组合	--	--
6	货币市场基金	--	--
7	可转换债券(可交换债)	140,636.80	0.19
8	银行存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	140,636.80	0.19

基金资产净值及基金份额净值(单位:人民币元/基金份额)					公允价值(元)		公允价值与净值比例(%)				
序号	基金名称	基金代码	基金类型	单位净值	1,420	140,636.90	0.19				
5.6	报告期内期末公允价值高于基金资产净值且大小排序的前十名资产支持证券投资组合										
5.6.1	本基金本报告期末未持有资产支持证券。										
5.7	报告期内期末公允价值高于基金资产净值且大小排序的前五名金属类投资组合										
5.7.1	本基金本报告期末未持有贵金属。										
5.8	报告期内期末公允价值高于基金资产净值且大小排序的前五名权益类投资组合										
5.8.1	本基金本报告期末未持有权益证券。										
5.8.2	本基金本报告期末持有权益类证券情况										
5.9	本基金本报告期末未持有股指期货合约										
5.9.1	报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细										
5.9.2	本基金本报告期末未持有股指期货。										
5.9.3	本基金本报告期末未持有股指期货。										
5.10	报告期内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										
5.10.2	本基金本报告期末未持有国债期货。										
5.10.3	报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细										
5.10.4	本基金本报告期末未持有国债期货。										
5.11	本期国债期货投资评价										
5.11.1	本基金本报告期末未持有国债期货。										
5.11.2	投资国债期货的风险管理										
5.11.3	其他风险管理										
5.12	本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票名单。										
5.13	其他资产										
5.13.1	权益类资产										
5.13.1.1	权益类资产明细										
序号	名称	金额(元)									
1	存出保证金	70,438.56									
2	应收证券清算款	-									
3	应收股利	-									
4	应收利息	4,083.42									
5	应收申购款	3,422.88									
6	其他应收款	-									
7	待摊费用	-									
8	其他	-									
9	合计	77,944.86									
5.13.1.2	权益类资产明细(位于转股期的可转换债券明细)										
序号	债券名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)								
1	113015	140,636.90	0.19								
5.13.1.3	报告期内前十名股票中存在流通受限情况的说明										
5.13.1.3.1	报告期内前十名股票中不存在流通受限情况的说明										
5.13.1.3.2	本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明										

§ 4 开放式基金的份额变动

单位:元

报告期初基金份额总额	81,002,751.96
报告期内基金总申购份额	6,441,439.96
报告期内基金总赎回份额	13,491,386.27
报告期内基金净变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	73,952,805.65

[illegible]

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	公允价值净占比(%)
1	000977	浪潮信息	2,152,415	31,335,077.05	3.39
2	600771	航天信息	1,977,142	49,861,298.34	3.29
3	002236	天华新能	2,009,254	45,368,677.70	2.99
4	002008	大亚卫视	697,500	17,310,025.00	2.45
5	600845	宝胜股份	1,298,885	34,217,714.75	2.26
6	002475	京粮控股	1,864,138	33,657,676.52	2.23
7	002027	华信国际	3,517,126	33,660,752.40	2.22
8	000651	格力电器	663,000	31,260,450.00	2.06
9	000618	中国石化	4,809,594	31,214,265.06	2.06
10	800014	亿阳智服	1,724,421	30,349,809.60	2.00

注：1、以上数据为截至报告期末的持仓数据；
2、以上数据为截至报告期末持有的有价证券；
3、以上数据为截至报告期末公允价值计量金融资产净值按公允价值大小排序的前五名股权投资明细；
4、以上数据为截至报告期末持有的金融资产。

[illegible][illegible]