泰信发展主题混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月20日

§1 重要提示

本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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2018年7月18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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信发展主题混合
交易代码	290008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月15日
报告期末基金份额总额	52,502,747.50份
投资目标	充分把握中国经济可持续发展过程中的主题投资机会,通过主题配置和精选个股,分享中国经济社会在科学发展、和谐发展和可持续发展过程中的投资机遇,在严格控制投资风险的条件下,力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金的股票资产采用以"核心主题投资为主,卫星主题投资和非主题类投资为辅"的投资策略,并考虑组合品种的信息风险和大类资产的系统风险,通过适时积仓位的动态调整降低资产的波动风险。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中证全债指数
风险收益特征	本基金作为混合型基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。本基金适合于能够承担一定股市风险、追求资本长期增值的个人和机构投资者。
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2018年4月1日 — 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,358,256.33
2.本期利润	-5,526,264.97
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1023
4.期末基金资产净值	57,908,604.67
5.期末基金份额净值	1.103

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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收益。

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

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	-8.69%	1.34%	-6.98%	0.85%	-1.71%	0.49%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证全债指数 。

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、泰信发展主题股票基金基金合同于2010年12月15日正式生效。本基金自2015年8月7日起变更为混合型基金。

2、本基金的建仓期为六个月,建仓期满,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金将基金资产的60%-95%投资于股票,基金资产的5%-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券。其中,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,资产支持证券不高于基金资产净值的20%。其中投资于发展主题相关上市公司的比例不低于股票投资资产的80%。

§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		
钱鑫先生	本基金经理兼泰信互联网+基金经理	2016年1月27日	-	9年	硕士,具有基金从业资格,曾任华为福思半导体任产品市场经理、上海东源投资发展有限公司TMT行业研究员。2012年3月加入泰信基金管理有限公司,在研究部担任高级研究员岗位,自2015年7月起任泰信策略基金经理助理,自2014年5月20日起至2016年6月30日担任泰信先行策略基金经理;自2016年6月8日起担任泰信互联网+主题基金经理。

注:1,以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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

本报告期内,本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信发展主题混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,本基金管理人在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《公平交易制度》,适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现可疑交易立即报告,并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易室集中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入2季度,受中美贸易谈判摩擦升级,国内金融去杠杆背景下债券市场接连曝出信用违约事件,以及上市公司股权质押等风险事件的影响,市场风险偏好显著下降,6月中人民币对美元快速贬值,鹏欣PSL资金政策变动等进一步加剧了市场担忧,市场主要指数出现了一波10%以上的下跌,以上市场因素的边际变化造成了金融地产、中上游周期、消费等行业指数一定程度的下跌,阶段性表现强势的计算机、医药板块也在一波反弹后出现了补跌。

本基金在2季度根据市场变化降低了股票仓位,基于中报业绩预测情况对持仓进行了调整,减持了金融、周期等行业配置,增加了行业景气度高,业绩增长确定的医药消费、科技创新类个股,取得了一定的投资效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.103元;本报告期基金份额净值增长率为-8.69%,业绩比较基准收益率为-6.98%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	45,437,500.23	71.41
	其中:股票	45,437,500.23	71.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	18,080,919.17	28.42
8	其他资产	107,457.20	0.17
9	合计	63,625,876.60	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,780,760.00	44.52
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	4,190,800.64	7.24
G	交通运输,仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,478,400.00	2.55
I	信息传输,软件和信息技术服务业	7,189,303.59	12.41
J	金融业	2,560,400.00	4.42
K	房地产业	1,098,000.00	1.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,730,036.00	2.99
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	1,410,000.00	2.43
S	综合	-	-
	合计	45,437,500.23	78.46

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

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

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	002271	北方华创	50,000	2,483,500.00	4.29
2	600845	宝信软件	94,000	2,476,900.00	4.28
3	300012	华测检测	301,400	1,730,036.00	2.99
4	300398	飞凯材料	86,300	1,688,028.00	2.91
5	300567	精测电子	21,000	1,671,600.00	2.89
6	000977	浪潮信息	70,000	1,669,500.00	2.88
7	603883	老百姓	18,304	1,522,160.64	2.63
8	603345	安井食品	43,000	1,505,000.00	2.60
9	600754	锦江股份	40,000	1,478,400.00	2.55
10	300122	智飞生物	32,000	1,463,680.00	2.53

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

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

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.11.2

报告期内本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	89,164.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,311.94
5	应收申购款	14,980.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,457.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	56,763,188.00
报告期期间基金总申购份额	203,228.64
减:报告期期间基金总赎回份额	4,463,669.14
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	52,502,747.50

§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

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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	20180401-20180630		36,653,603.97	0.00	4,000,000.00	32,653,603.97	62.19%
个人	-	-		-	-	-	-	-
产品特有风险								
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回,防控产品流动性风险并公平对待投资者,本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。								

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、中国证监会批准原泰信发展主题股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信发展主题混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信发展主题混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信发展主题混合型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

9.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件。

9.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站 (www.fttfund.com) 查阅上述相关文件, 或按打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2018年7月20日

泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月20日

§1 重要提示

本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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2018年7月18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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信基本面400指数分级
场内简称	泰信400
交易代码	162907
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年9月7日
报告期末基金份额总额	45,423,797.07份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采用完全复制法,按照在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
下属分级基金场内简称	泰信400A	泰信400B	泰信400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金的份额总额	762,891.00份	762,891.00份	43,898,015.07份
下属分级基金的风险收益特征	低风险,收益相对稳定。	高风险,高预期收益。	较高风险,较高预期收益。

§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(2018年4月1日 — 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	145,731.24
2.本期利润	-6,723,998.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0922
4.期末基金资产净值	45,265,385.33
5.期末基金份额净值	0.997

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收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人申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。

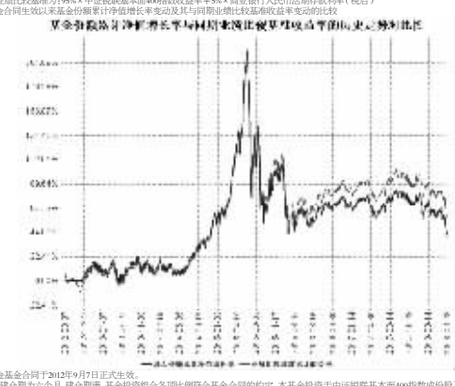
3.2 基金净值表现

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

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	-12.66%	1.28%	-12.98%	1.30%	0.29%	-0.02%

注:本基金业绩比较基准为:95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)

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2012年9月7日正式生效。

2.本基金的建仓期为六个月,建仓期满,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%;现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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		
张莎莎先生	本基金经理兼泰信中证200指数基金、泰信智选成长混合基金经理	2015年1月6日	-	12年	研究生硕士,具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011年6月加入泰信基金管理有限公司,担任高级研究员,自2011年10月至2014年5月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012年4月至2015年1月任泰信优势增长混合基金经理助理。自2015年1月6日起担任泰信中证200指数基金经理;自2017年11月16日起担任泰信智选成长混合基金经理。

注:1,以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益,无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

本报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公司公平交易管理制度,加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

二季度经济数据整体平稳,但是由于受到去杠杆、中美贸易摩擦等诸多利空因素影响,市场表现不佳。国内负债率高企,为了防范金融风险,国家决定去杠杆,出台资管新规、收缩棚改政策等措施,影响较大,不仅导致大量质押爆仓和信用违约,也引发市场对金融风险及未来经济下滑的担忧。外部中美贸易摩擦反复、预期不明确,美国的遏制态度使市场认识到中国现有的差距及中长期发展的艰巨性,美国加息、缩表也约束了国内的政策空间,内忧外患相结合,市场风险偏好大幅下降,引发市场整体快速的调整。

报告期内,本基金主要采用复制指数配置与行业内量化选股的策略,密切跟踪指数,控制相对基准的偏离,严格控制仓位;另外从基本面出发,根据估值、业绩及市场风格等针对个股做适当的结构变化以获得超额收益。但是由于跟踪的中证新兴指数调整及多个被调出成份股的停牌股票复牌后大跌,导致基金净值同步下跌,给基金持有人带来较多损失,在此深表歉意。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.079元,累计净值1.079元;本报告期份额净值增长率-12.84%,同期业绩比较基准收益率为-12.41%。

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,未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§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	85,516,079.45	94.43
	其中:股票	85,516,079.45	94.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,791,366.66	5.28
8	其他资产	260,020.67	0.29
9	合计	90,567,466.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数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	97,505.98	0.22
B	采掘业	62,749.02	0.14
C	制造业	98,829.40	0.22
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	72,100.51	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输,仓储和邮政业	42,810.32	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	40,642.24	0.09
S	综合	-	-
	合计	414,637.47	0.92

注:积极投资股票为停牌等原因造成的被动持有非当前成分股。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

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 报告期末指数投资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	601118	海南橡胶	14,729	97,505.98	0.22
2	000939	凯迪生态	14,449	72,100.51	0.16
3	000603	盛达矿业	5,794	62,749.02	0.14
4	600485	信威集团	4,100	59,819.00	0.13
5	000022	深赤湾A	1,876	42,810.32	0.09

注:积极投资股票为停牌等原因造成的被动持有非当前成分股。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末本基金未投资贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

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

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.11.2

报告期内本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	205.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	792.24
5	应收申购款	1,992.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,990.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

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

报告期末本基金期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	989,274.95	1.10	重大资产重组
2	000008	神州高铁	468,224.00	0.52	重大事项停牌
3	000156	华数传媒	22,227	214,268.28	0.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	1,457,498.95	1.62
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	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	214,268.28	0.24
S	综合	-	-
	合计	1,671,767.23	1.86

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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 报告期末指数投资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	600309	万华化学	37,391	1,707,383.22	1.90
2	300122	智飞生物	30,228	1,382,628.72	1.54
3	000963	华东医药	27,668	1,334,981.00	1.48
4	600276	恒瑞医药	17,256	1,307,314.56	1.45
5	600535	天士力	46,994	1,213,385.08	1.35
6	600196	复星医药	27,627	1,143,481.53	1.27
7	000538	云南白药	10,566	1,130,139.36	1.26
8	300059	东方财富	83,120	1,095,521.60	1.22
9	600104	上汽集团	31,296	1,095,047.04	1.22
10	600332	白云山	28,039	1,066,883.95	1.19

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	600485	信威集团	67,805	989,274.95	1.10
2	000008	神州高铁	94,400	468,224.00	0.52
3	000156	华数传媒	22,227	214,268.28	0.24

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	97,505.98	0.22
B	采掘业	62,749.02	0.14
C	制造业	98,829.40	0.22
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	72,100.51	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输,仓储和邮政业	42,810.32	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	40,642.24	0.09
S	综合	-	-
	合计	414,637.47	0.92

注:积极投资股票为停牌等原因造成的被动持有非当前成分股。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

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 报告期末指数投资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	600535	天士力	10,612	274,001.84	0.61
2	601555	东吴证券	39,543	270,078.69	0.60
3	000488	晨鸣纸业	20,900	270,028.00	0.60
4	000425	徐工机械	59,500	252,280.00	0.56
5	601168	西部矿业	39,168	245,975.04	0.54
6	600997	贵阳银行	19,831	241,650.36	0.53
7	000059	华锦股份	34,500	237,705.00	0.53
8	000878	云南铜业	24,900	237,546.00	0.52
9	600522	中天科技	26,626	234,575.06	0.52
10	600875	东方电气	31,600	234,136.00	0.52

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	601118	海南橡胶	14,729	97,505.98	0.22
2	000939	凯迪生态	14,449	72,100.51	0.16
3	000603	盛达矿业	5,794	62,749.02	0.14
4	600485	信威集团	4,100	59,819.00	0.13
5	000022	深赤湾A	1,876	42,810.32	0.09

注:积极投资股票为停牌等原因造成的被动持有非当前成分股。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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