

东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6 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.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	53
7.8 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贵金属投资明细.....	53
7.9 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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
11.1 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.....	63

§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金
基金简称	东方新能源汽车主题混合
基金主代码	400015
前端交易代码	400015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 21 日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,161,869.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在大类资产配置基础上精选个股，严格控制投资风险，追求基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×80%+银行活期存款利率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理有限责任公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	田东辉
	联系电话	010-66295888	010-68858113
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95580
传真		010-66578700	010-68858120
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		100033	100808

法定代表人	崔伟	张金良
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	349,345.53
本期利润	1,292,398.82
加权平均基金份额本期利润	0.0483
本期加权平均净值利润率	4.39%
本期基金份额净值增长率	4.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	1,619,309.06
期末可供分配基金份额利润	0.0596
期末基金资产净值	28,781,178.41
期末基金份额净值	1.0596
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-19.08%

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期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

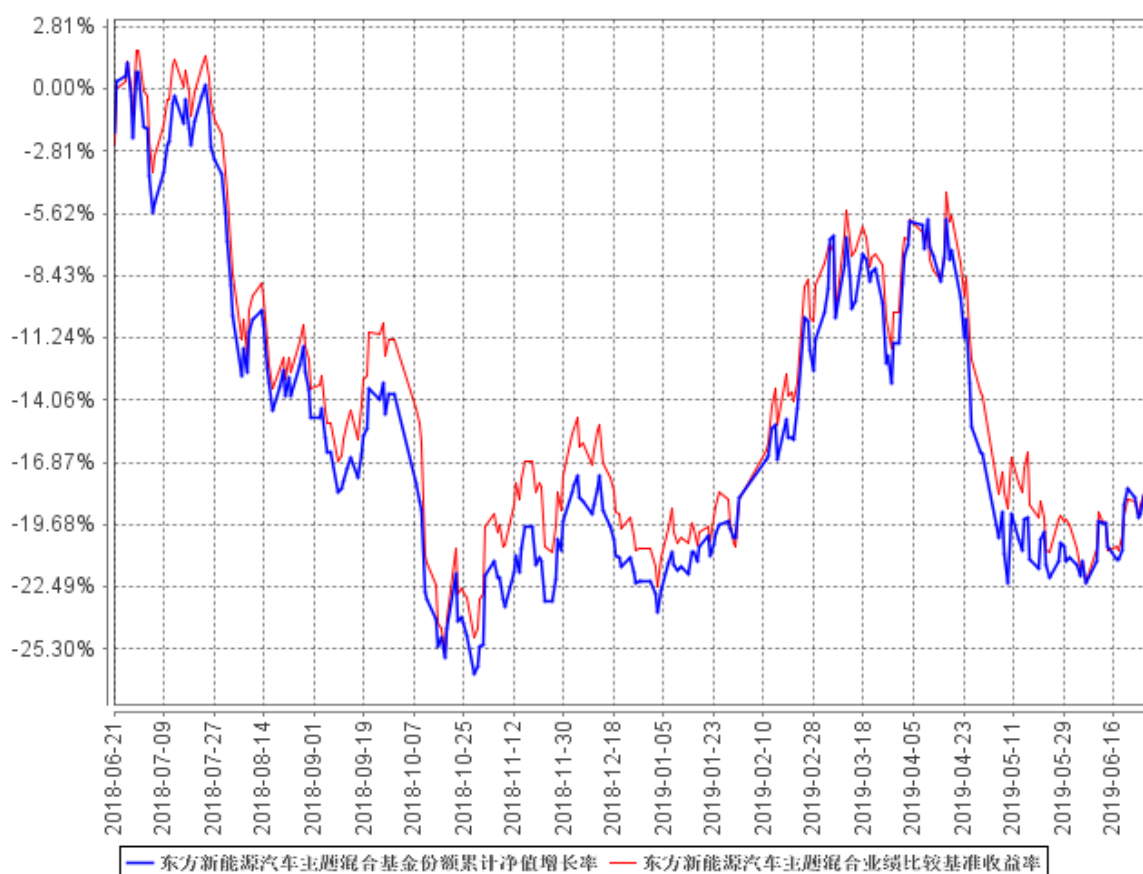
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.62%	1.10%	0.82%	1.04%	1.80%	0.06%
过去三个月	-8.55%	1.56%	-9.89%	1.46%	1.34%	0.10%
过去六个月	4.03%	1.52%	2.22%	1.48%	1.81%	0.04%
过去一年	-19.69%	1.46%	-20.35%	1.48%	0.66%	-0.02%
过去三年	-19.08%	1.47%	-19.00%	1.49%	-0.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-19.08%	1.47%	-19.00%	1.49%	-0.08%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

东方新能源汽车主题混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 日生效，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。截至2019年6月30日，本公司注册资本3亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币19200万元，占公司注册资本的64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币8100万元，占公司注册资本27%；渤海国际信托股份有限公司出资人民币2700万元，占公司注册资本的9%。截至2019年6月30日，本公司管理43只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
李瑞(先生)	本基金基金经理	2018年6月21日	-	8年	中国人民大学金融学硕士，8年证券从业经历。2011年7月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部研究员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（于2018年6月21日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处的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

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》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作基金资产，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。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易

执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，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中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 1 季度，市场普涨的原因是社融数据好转带来的流动性宽松、资本市场改革预期带来的风险偏好修复和增量资金入场形成了共振。1 季度这种风险偏好主导的行情下，市场主线体现为 2018 年估值下杀之后的估值修复。

但 1 季度的行情快速透支了对流动性、经济基本面和外围环境的乐观预期。2019 年 2 季度，市场普跌，沪深 300 跌幅最小，下跌 1.21%，中小板指跌幅最大，下跌 10.99%。

货币政策委员会“把好货币供给总闸门”的提法时隔多时再次出现，叠加 3 月底以来长端利率的回升，造成了市场对于货币政策收紧的担忧。另外，市场风险偏好快速下降，确定性变得更为重要。

上半年 CS 新能源车（399976）涨幅 2.32%，远远落后大盘，主要原因是行业补贴退坡的压力叠加了汽车市场的不景气，对行业造成较大冲击。上半年基金净值增长 4.03%，跑赢对标指数。行业补贴退坡的过程是加速优胜劣汰的过程，龙头企业竞争力日益凸显，技术迭代步伐加快，我们的投资方向始终坚持围绕消费升级、全球供应这一主线，投资于具备全球竞争力的产业链龙头，投资于优质资产，未来我们也将继续秉承这一理念。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日，本基金净值增长率为 4.03%，业绩比较基准收益率为 2.22%，高于业绩比较基准 1.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场弱势，但是一批优质公司股价却创历史新高。自上而下看，市场都在关注经济下行压力、国内对冲政策等，但这些因素不确定性都很大。而自下而上看，分化或分层是最大的特点，一批具有宽厚的护城河、竞争优势突出、治理完善、财报优异的公司，无论内外部环境如何，都在不断创造价值并在不断被越来越多的投资者认可。究其原因，市场的时代背景已经从总量波动为主变成了结构分化为主，大批优质公司走上了强者恒强的路。另外，投资者结构正在发生机构化和国际化的深刻变化，正在发生质变，而且这一趋势还在持续。

短期市场仍然面临着经济下行、国内对冲政策预期等的干扰，但是市场的核心逻辑已经不是过去过度关注宏观、总量，从而追求贝塔，而更重要的是对优质公司的价值判断。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东方新能源汽车主题混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方新能源汽车主题混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,198,674.45	8,358,449.35
结算备付金		616,081.26	287,968.92
存出保证金		132,673.61	115,345.33
交易性金融资产	6.4.7.2	27,454,242.27	20,999,015.86
其中：股票投资		25,954,418.27	18,536,562.36
基金投资		-	-
债券投资		1,499,824.00	2,462,453.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	21,893.64	68,511.50
应收股利		-	-
应收申购款		53,728.45	20,591.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		30,477,293.68	29,849,882.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		936,770.36	-
应付赎回款		87,806.89	28,592.87
应付管理人报酬		34,750.76	37,612.24
应付托管费		5,791.82	6,268.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	471,522.87	145,281.74
应交税费		-	5.98

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	159,472.57	219,763.05
负债合计		1,696,115.27	437,524.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	27,161,869.35	28,875,988.17
未分配利润	6.4.7.10	1,619,309.06	536,369.91
所有者权益合计		28,781,178.41	29,412,358.08
负债和所有者权益总计		30,477,293.68	29,849,882.67

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0596 元，基金份额总额 27,161,869.35 份。

6.2 利润表

会计主体：东方新能源汽车主题混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 21 日(基 金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,827,701.47	287,213.05
1.利息收入		39,767.33	3,715.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,479.40	525.59
债券利息收入		18,287.93	3,190.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,782,831.82	-414,140.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,458,085.29	-344,078.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	96,137.62	-81,806.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	228,608.91	11,744.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	943,053.29	695,396.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	62,049.03	2,240.58
减：二、费用		1,535,302.65	49,379.77

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	218,316.92	13,687.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,386.12	2,281.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,217,365.04	27,855.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.59	0.36
7. 其他费用	6.4.7.20	63,230.98	5,555.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,292,398.82	237,833.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,292,398.82	237,833.28

注：本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 日生效，上年度可比期间为 2018 年 6 月 21 日至 2018 年 6 月 30 日，下同。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方新能源汽车主题混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	28,875,988.17	536,369.91	29,412,358.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,292,398.82	1,292,398.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,714,118.82	-209,459.67	-1,923,578.49
其中：1.基金申购款	13,434,374.32	1,720,912.29	15,155,286.61
2.基金赎回款	-15,148,493.14	-1,930,371.96	-17,078,865.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	27,161,869.35	1,619,309.06	28,781,178.41

项目	上年度可比期间 2018 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	25,914,828.24	8,018,075.33	33,932,903.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	237,833.28	237,833.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-432,464.70	-116,224.32	-548,689.02
其中：1.基金申购款	297,421.52	92,392.34	389,813.86
2.基金赎回款	-729,886.22	-208,616.66	-938,502.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	25,482,363.54	8,139,684.29	33,622,047.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 刘鸿鹏 刘鸿鹏 王丹丹
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方新能源汽车主题混合型证券投资基金由东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金转型而来。

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2011 年 10 月 20 日中国证监会《关于核准东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1687 号）和《关于东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2011]860 号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》自 2011 年 11 月 21

日至 2011 年 12 月 23 日公开募集设立。本基金为混合型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 335,816,080.11 元人民币，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）“信会师报字（2011）第 82483 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 335,865,199.76 份基金单位，其中认购资金利息折合 49,119.65 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。本基金于 2018 年 6 月 21 日转型为“东方新能源汽车主题混合型证券投资基金”。基金托管人及基金登记机构保持不变，基金代码沿用原基金代码“400015”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，东方新能源汽车主题混合型证券投资基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、证券公司短期公司债券、超短期融资券、可交换债券、可转换债券、可分离交易可转债等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；投资于与新能源汽车主题相关的行业及上市公司的证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执

行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产

品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

5、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,198,674.45
定期存款	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,198,674.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,449,163.82	25,954,418.27	505,254.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,506,889.20	1,499,824.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,506,889.20	1,499,824.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	26,956,053.02	27,454,242.27	498,189.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
----	------------------------

应收活期存款利息	344.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	249.48
应收债券利息	21,246.26
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	53.73
合计	21,893.64

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	471,522.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	471,522.87

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	95.47
证管费返还	5,746.12
预提费用	153,630.98
合计	159,472.57

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,875,988.17	28,875,988.17
本期申购	13,434,374.32	13,434,374.32
本期赎回(以“-”号填列)	-15,148,493.14	-15,148,493.14
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	27,161,869.35	27,161,869.35

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,591,930.31	-16,055,560.40	536,369.91
本期利润	349,345.53	943,053.29	1,292,398.82
本期基金份额交易产生的变动数	-1,035,759.99	826,300.32	-209,459.67
其中：基金申购款	8,717,237.45	-6,996,325.16	1,720,912.29
基金赎回款	-9,752,997.44	7,822,625.48	-1,930,371.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,905,515.85	-14,286,206.79	1,619,309.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	16,350.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,137.05
其他	992.10
合计	21,479.40

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	401,446,610.54
减：卖出股票成本总额	399,988,525.25
买卖股票差价收入	1,458,085.29

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	96,137.62
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	96,137.62

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,880,898.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,698,124.43
减：应收利息总额	86,636.40
买卖债券差价收入	96,137.62

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	228,608.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	228,608.91

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	943,053.29
——股票投资	891,675.45
——债券投资	51,377.84
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	943,053.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	61,942.98
基金转换费收入	106.05
合计	62,049.03

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	1,217,365.04
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,217,365.04

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	24,795.19
账户服务费	18,600.00
合计	63,230.98

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方的佣金费用，期末无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	218,316.92	13,687.76
其中：支付销售机构的客户维护费	77,274.94	4,046.61

注：①本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效 日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,386.12	2,281.31

注：①本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于 5 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，支付日顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效 日)至2018年6月30日
基金合同生效日(2018年6月21日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	11,271,108.18	-
期间申购/买入总份额	-	11,271,108.18
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	4,300,000.00	-
期末持有的基金份额	6,971,108.18	11,271,108.18
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	25.6700%	44.2300%

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费，并履行了信息披露义务。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年 6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,198,674.45	16,350.25	14,860,587.38	525.59

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至本年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月28日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	7,439	25,738.94	25,738.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止,本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止,本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系,确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险,从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和监察稽核部组成的风险管理组织体系,该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别,事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券;本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外,本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,发生违约风险的可能性很低;本基金也可在银行间同业市场进行交易,在交易前均会对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	734, 107.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	734, 107.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、短期融资券、超短期融资券及同业存单等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，保持组合必要的流动性和可变现能力，未发生流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,198,674.45	0.00	0.00	0.00	2,198,674.45
结算备付金	616,081.26	0.00	0.00	0.00	616,081.26
存出保证金	132,673.61	0.00	0.00	0.00	132,673.61
交易性金融资产-股票投资	0.00	0.00	0.00	25,954,418.27	25,954,418.27
交易性金融资产-债券投资	1,499,824.00	0.00	0.00	0.00	1,499,824.00
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	21,893.64	21,893.64
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

应收申购款	0.00	0.00	0.00	53,728.45	53,728.45
资产总计	4,447,253.32	0.00	0.00	26,030,040.36	30,477,293.68
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	87,806.89	87,806.89
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	34,750.76	34,750.76
应付托管费	0.00	0.00	0.00	5,791.82	5,791.82
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	471,522.87	471,522.87
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	159,472.57	159,472.57
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	936,770.36	936,770.36
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,696,115.27	1,696,115.27
利率敏感度缺口	4,447,253.32	0.00	0.00	24,333,925.09	28,781,178.41
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,358,449.35	0.00	0.00	0.00	8,358,449.35
结算备付金	287,968.92	0.00	0.00	0.00	287,968.92
存出保证金	115,345.33	0.00	0.00	0.00	115,345.33
交易性金融资产-股票投资	0.00	0.00	0.00	18,536,562.36	18,536,562.36
交易性金融资产-债券投资	1,728,346.50	136,747.00	597,360.00	0.00	2,462,453.50
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	68,511.50	68,511.50
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	20,591.71	20,591.71
资产总计	10,490,110.10	136,747.00	597,360.00	18,625,665.57	29,849,882.67
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	28,592.87	28,592.87
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	37,612.24	37,612.24
应付托管费	0.00	0.00	0.00	6,268.71	6,268.71
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	145,281.74	145,281.74
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00	0.00	5.98	5.98

应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	219,763.05	219,763.05
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	437,524.59	437,524.59
利率敏感度缺口	10,490,110.10	136,747.00	597,360.00	18,188,140.98	29,412,358.08

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	2,105.34	66.93
	市场利率上调 0.25%	-2,105.34	-1,535.15

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	25,954,418.27	90.18	18,536,562.36	63.02
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	1,499,824.00	5.21	2,462,453.50	8.37
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	27,454,242.27	95.39	20,999,015.86	71.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,425,714.19	-991,019.89
	沪深 300 指数上涨 5%	1,425,714.19	991,019.89

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 670,609.48 元，占基金资产净值比例为 2.33%；上年度末本基金风险价值为 694,425.85 元，占基金资产净值比例为 2.36%。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,954,418.27	85.16
	其中：股票	25,954,418.27	85.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,499,824.00	4.92
	其中：债券	1,499,824.00	4.92
	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	2,814,755.71	9.24
8	其他各项资产	208,295.70	0.68
9	合计	30,477,293.68	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,340,200.00	4.66
B	采矿业	17,750.00	0.06
C	制造业	20,534,729.33	71.35
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	716,200.00	2.49
J	金融业	2,882,738.94	10.02
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	462,800.00	1.61
S	综合	-	-
	合计	25,954,418.27	90.18

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300014	亿纬锂能	61,000	1,858,060.00	6.46
2	300750	宁德时代	24,000	1,653,120.00	5.74
3	002594	比亚迪	30,000	1,521,600.00	5.29
4	600030	中信证券	50,000	1,190,500.00	4.14
5	601688	华泰证券	50,000	1,116,000.00	3.88
6	300037	新宙邦	50,000	1,042,000.00	3.62
7	600104	上汽集团	40,000	1,020,000.00	3.54
8	300450	先导智能	28,000	940,800.00	3.27
9	002812	恩捷股份	20,000	935,000.00	3.25
10	300568	星源材质	40,000	922,000.00	3.20
11	002458	益生股份	40,000	780,400.00	2.71
12	603659	璞泰来	16,000	752,320.00	2.61
13	002709	天赐材料	30,000	726,000.00	2.52
14	002179	中航光电	20,000	669,200.00	2.33
15	002916	深南电路	6,000	611,520.00	2.12
16	002465	海格通信	60,000	572,400.00	1.99
17	002234	民和股份	20,000	559,800.00	1.95
18	601211	国泰君安	30,000	550,500.00	1.91
19	300001	特锐德	30,000	540,600.00	1.88
20	000625	长安汽车	80,000	530,400.00	1.84
21	300203	聚光科技	20,000	478,000.00	1.66
22	300144	宋城演艺	20,000	462,800.00	1.61
23	600273	嘉化能源	40,000	462,400.00	1.61
24	601238	广汽集团	40,000	437,200.00	1.52
25	002384	东山精密	30,000	437,100.00	1.52
26	600741	华域汽车	20,000	432,000.00	1.50
27	600884	杉杉股份	40,000	426,000.00	1.48
28	300253	卫宁健康	30,000	425,400.00	1.48
29	300747	锐科激光	3,000	420,030.00	1.46

30	300457	赢合科技	16,000	398,880.00	1.39
31	300274	阳光电源	40,000	374,000.00	1.30
32	600885	宏发股份	15,000	364,500.00	1.27
33	002049	紫光国微	8,000	352,880.00	1.23
34	300207	欣旺达	30,000	345,600.00	1.20
35	000970	中科三环	30,000	340,500.00	1.18
36	300476	胜宏科技	30,000	339,000.00	1.18
37	600867	通化东宝	20,000	308,000.00	1.07
38	300496	中科创达	10,000	290,800.00	1.01
39	300232	洲明科技	30,000	290,400.00	1.01
40	601236	红塔证券	7,439	25,738.94	0.09
41	300782	卓胜微	173	18,843.16	0.07
42	600968	海油发展	5,000	17,750.00	0.06
43	603867	新化股份	557	14,376.17	0.05

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600104	上汽集团	8,432,874.90	28.67
2	600741	华域汽车	7,613,795.19	25.89
3	002594	比亚迪	7,381,070.58	25.10
4	601633	长城汽车	6,589,784.00	22.40
5	002709	天赐材料	6,293,556.00	21.40
6	600030	中信证券	6,242,189.00	21.22
7	600066	宇通客车	6,065,071.87	20.62
8	000625	长安汽车	5,683,199.00	19.32
9	300568	星源材质	5,290,253.00	17.99
10	601688	华泰证券	5,083,794.00	17.28
11	603659	璞泰来	4,860,613.00	16.53
12	300073	当升科技	4,171,097.20	14.18
13	002812	恩捷股份	4,144,894.00	14.09
14	601318	中国平安	4,062,532.88	13.81
15	600048	保利地产	4,036,541.00	13.72
16	300037	新宙邦	4,019,299.00	13.67

17	300014	亿纬锂能	3,825,599.00	13.01
18	300750	宁德时代	3,792,844.00	12.90
19	300059	东方财富	3,702,488.80	12.59
20	002202	金风科技	3,543,055.98	12.05
21	601699	潞安环能	3,437,670.20	11.69
22	600884	杉杉股份	3,425,851.32	11.65
23	601899	紫金矿业	3,405,241.00	11.58
24	300450	先导智能	3,288,932.79	11.18
25	000961	中南建设	3,174,057.00	10.79
26	603019	中科曙光	3,123,539.20	10.62
27	601012	隆基股份	3,103,401.65	10.55
28	000063	中兴通讯	3,074,847.00	10.45
29	600259	广晟有色	2,972,318.46	10.11
30	300253	卫宁健康	2,742,004.00	9.32
31	000550	江铃汽车	2,724,412.00	9.26
32	000338	潍柴动力	2,660,799.00	9.05
33	000970	中科三环	2,657,150.97	9.03
34	601398	工商银行	2,648,200.00	9.00
35	000831	五矿稀土	2,621,750.00	8.91
36	300207	欣旺达	2,612,874.00	8.88
37	002405	四维图新	2,603,419.00	8.85
38	600837	海通证券	2,597,054.86	8.83
39	600438	通威股份	2,563,899.00	8.72
40	601238	广汽集团	2,561,025.13	8.71
41	000001	平安银行	2,437,719.00	8.29
42	300124	汇川技术	2,383,153.00	8.10
43	000786	北新建材	2,354,950.98	8.01
44	600547	山东黄金	2,302,793.00	7.83
45	601166	兴业银行	2,284,733.00	7.77
46	000977	浪潮信息	2,276,712.00	7.74
47	300498	温氏股份	2,261,411.00	7.69
48	600588	用友网络	2,250,834.60	7.65
49	002439	启明星辰	2,250,243.00	7.65
50	002466	天齐锂业	2,219,219.00	7.55
51	000002	万科A	2,216,459.00	7.54
52	300033	同花顺	2,208,505.00	7.51

53	600737	中粮糖业	2,206,277.10	7.50
54	002407	多氟多	2,152,174.00	7.32
55	002074	国轩高科	2,129,247.00	7.24
56	601818	光大银行	2,122,800.00	7.22
57	002460	赣锋锂业	2,118,454.00	7.20
58	000932	华菱钢铁	2,053,825.00	6.98
59	000975	银泰资源	1,990,399.80	6.77
60	600885	宏发股份	1,984,001.00	6.75
61	600366	宁波韵升	1,971,248.40	6.70
62	002531	天顺风能	1,945,007.00	6.61
63	601211	国泰君安	1,874,478.00	6.37
64	002050	三花智控	1,853,892.00	6.30
65	600155	华创阳安	1,848,011.00	6.28
66	600273	嘉化能源	1,830,515.00	6.22
67	601336	新华保险	1,816,043.00	6.17
68	600132	重庆啤酒	1,813,424.00	6.17
69	300274	阳光电源	1,813,230.00	6.16
70	601939	建设银行	1,811,900.00	6.16
71	601877	正泰电器	1,785,540.00	6.07
72	600418	江淮汽车	1,756,575.31	5.97
73	002371	北方华创	1,724,304.00	5.86
74	002341	新纶科技	1,717,324.89	5.84
75	600115	东方航空	1,694,090.00	5.76
76	300144	宋城演艺	1,692,603.00	5.75
77	002422	科伦药业	1,684,378.61	5.73
78	002415	海康威视	1,630,256.63	5.54
79	300438	鹏辉能源	1,621,263.81	5.51
80	002372	伟星新材	1,618,910.17	5.50
81	600036	招商银行	1,602,163.00	5.45
82	002179	中航光电	1,569,268.94	5.34
83	002299	圣农发展	1,568,998.00	5.33
84	600570	恒生电子	1,557,179.00	5.29
85	600519	贵州茅台	1,528,675.00	5.20
86	603799	华友钴业	1,523,381.00	5.18
87	603986	兆易创新	1,515,935.00	5.15
88	300618	寒锐钴业	1,495,089.00	5.08

89	600546	山煤国际	1,470,877.00	5.00
90	600362	江西铜业	1,419,402.00	4.83
91	002850	科达利	1,418,074.00	4.82
92	002234	民和股份	1,410,950.00	4.80
93	000951	中国重汽	1,405,265.00	4.78
94	600549	厦门钨业	1,395,884.00	4.75
95	002080	中材科技	1,390,503.20	4.73
96	000401	冀东水泥	1,387,322.00	4.72
97	600131	岷江水电	1,384,318.70	4.71
98	000651	格力电器	1,307,069.74	4.44
99	000878	云南铜业	1,301,303.00	4.42
100	600050	中国联通	1,275,870.00	4.34
101	000983	西山煤电	1,252,300.00	4.26
102	600705	中航资本	1,251,290.00	4.25
103	002507	涪陵榨菜	1,233,961.14	4.20
104	300408	三环集团	1,226,755.00	4.17
105	601128	常熟银行	1,226,393.00	4.17
106	600027	华电国际	1,219,774.00	4.15
107	002092	中泰化学	1,214,383.00	4.13
108	600018	上港集团	1,202,717.00	4.09
109	000603	盛达矿业	1,202,509.00	4.09
110	300747	锐科激光	1,201,631.00	4.09
111	600340	华夏幸福	1,195,742.00	4.07
112	600990	四创电子	1,137,893.00	3.87
113	601088	中国神华	1,131,869.00	3.85
114	600489	中金黄金	1,114,660.00	3.79
115	600887	伊利股份	1,113,927.00	3.79
116	603197	保隆科技	1,113,901.00	3.79
117	600563	法拉电子	1,108,181.00	3.77
118	002174	游族网络	1,108,055.00	3.77
119	300496	中科创达	1,106,921.00	3.76
120	600498	烽火通信	1,088,567.00	3.70
121	002384	东山精密	1,057,051.00	3.59
122	300340	科恒股份	1,044,280.68	3.55
123	600038	中直股份	1,040,300.58	3.54
124	002920	德赛西威	1,031,304.00	3.51

125	000723	美锦能源	1,027,805.00	3.49
126	600859	王府井	1,018,345.00	3.46
127	002027	分众传媒	1,010,199.00	3.43
128	002916	深南电路	1,010,073.00	3.43
129	002714	牧原股份	1,008,200.02	3.43
130	002182	云海金属	975,915.00	3.32
131	300383	光环新网	935,703.00	3.18
132	601288	农业银行	930,263.00	3.16
133	601678	滨化股份	928,500.00	3.16
134	600297	广汇汽车	927,093.00	3.15
135	603043	广州酒家	919,911.00	3.13
136	601966	玲珑轮胎	905,348.00	3.08
137	600409	三友化工	892,661.00	3.03
138	300724	捷佳伟创	892,394.00	3.03
139	600919	江苏银行	891,071.00	3.03
140	300316	晶盛机电	888,209.00	3.02
141	002002	鸿达兴业	882,091.94	3.00
142	600406	国电南瑞	879,977.00	2.99
143	000538	云南白药	869,484.00	2.96
144	601838	成都银行	866,100.00	2.94
145	600459	贵研铂业	860,084.20	2.92
146	002410	广联达	843,182.00	2.87
147	601668	中国建筑	834,876.00	2.84
148	002546	新联电子	825,884.00	2.81
149	600967	内蒙一机	821,252.00	2.79
150	603018	中设集团	820,941.32	2.79
151	300773	拉卡拉	817,975.98	2.78
152	601788	光大证券	817,192.00	2.78
153	002430	杭氧股份	813,147.00	2.76
154	600312	平高电气	796,232.56	2.71
155	600392	盛和资源	795,419.00	2.70
156	002191	劲嘉股份	793,900.00	2.70
157	002458	益生股份	793,582.00	2.70
158	601881	中国银河	791,544.00	2.69
159	000400	许继电气	790,209.00	2.69
160	600643	爱建集团	789,200.00	2.68

161	600166	福田汽车	787,341.00	2.68
162	600111	北方稀土	785,044.00	2.67
163	603160	汇顶科技	781,498.00	2.66
164	600511	国药股份	781,258.11	2.66
165	600612	老凤祥	772,186.16	2.63
166	600585	海螺水泥	766,766.00	2.61
167	600028	中国石化	759,300.00	2.58
168	002008	大族激光	753,361.00	2.56
169	300203	聚光科技	746,157.91	2.54
170	002049	紫光国微	728,480.00	2.48
171	300567	精测电子	724,725.00	2.46
172	600660	福耀玻璃	723,732.08	2.46
173	002493	荣盛石化	718,550.51	2.44
174	002155	湖南黄金	705,841.00	2.40
175	600176	中国巨石	704,132.00	2.39
176	600383	金地集团	703,482.00	2.39
177	600729	重庆百货	693,300.00	2.36
178	600674	川投能源	690,977.00	2.35
179	000543	皖能电力	689,392.00	2.34
180	002368	太极股份	667,453.00	2.27
181	600011	华能国际	666,200.00	2.27
182	600258	首旅酒店	665,078.26	2.26
183	002001	新 和 成	663,415.00	2.26
184	002013	中航机电	661,092.00	2.25
185	600584	长电科技	656,964.00	2.23
186	300529	健帆生物	655,315.00	2.23
187	002563	森马服饰	654,201.60	2.22
188	300183	东软载波	651,791.00	2.22
189	600004	白云机场	647,274.00	2.20
190	601233	桐昆股份	646,563.00	2.20
191	000498	山东路桥	646,301.00	2.20
192	300036	超图软件	629,781.00	2.14
193	000703	恒逸石化	615,324.89	2.09
194	002518	科士达	611,081.15	2.08
195	601328	交通银行	609,200.00	2.07
196	601965	中国汽研	599,283.00	2.04

197	601933	永辉超市	593,400.00	2.02
198	600977	中国电影	592,319.51	2.01
199	601179	中国西电	591,856.00	2.01
200	300474	景嘉微	591,141.70	2.01

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600104	上汽集团	8,649,322.00	29.41
2	600066	宇通客车	7,418,317.13	25.22
3	601633	长城汽车	7,013,228.30	23.84
4	002594	比亚迪	6,928,612.41	23.56
5	600741	华域汽车	6,922,047.23	23.53
6	002709	天赐材料	6,048,271.87	20.56
7	300568	星源材质	5,244,749.66	17.83
8	600030	中信证券	5,235,087.00	17.80
9	300073	当升科技	5,214,724.90	17.73
10	000625	长安汽车	5,028,984.21	17.10
11	603659	璞泰来	4,532,624.00	15.41
12	601318	中国平安	4,196,145.03	14.27
13	601688	华泰证券	4,048,899.00	13.77
14	600048	保利地产	4,026,552.00	13.69
15	300059	东方财富	3,747,847.20	12.74
16	300037	新宙邦	3,735,466.20	12.70
17	300124	汇川技术	3,712,697.12	12.62
18	002202	金风科技	3,627,374.20	12.33
19	002812	恩捷股份	3,621,522.00	12.31
20	300014	亿纬锂能	3,484,842.00	11.85
21	601899	紫金矿业	3,337,000.00	11.35
22	601699	潞安环能	3,320,845.10	11.29
23	600259	广晟有色	3,202,706.00	10.89
24	603019	中科曙光	3,169,362.00	10.78
25	000961	中南建设	3,158,205.00	10.74

26	300450	先导智能	3,100,979.95	10.54
27	000063	中兴通讯	3,067,815.98	10.43
28	600884	杉杉股份	3,016,919.00	10.26
29	600885	宏发股份	3,001,000.39	10.20
30	601012	隆基股份	2,878,735.23	9.79
31	000831	五矿稀土	2,809,755.00	9.55
32	000550	江铃汽车	2,800,408.00	9.52
33	600547	山东黄金	2,697,914.94	9.17
34	000338	潍柴动力	2,692,041.80	9.15
35	601398	工商银行	2,671,000.00	9.08
36	600837	海通证券	2,650,962.00	9.01
37	300207	欣旺达	2,604,180.00	8.85
38	000001	平安银行	2,507,315.00	8.52
39	002405	四维图新	2,499,841.50	8.50
40	000970	中科三环	2,442,760.51	8.31
41	600438	通威股份	2,410,869.72	8.20
42	000786	北新建材	2,379,687.00	8.09
43	601166	兴业银行	2,360,276.00	8.02
44	000977	浪潮信息	2,289,922.00	7.79
45	002341	新纶科技	2,256,361.00	7.67
46	300033	同花顺	2,254,713.00	7.67
47	002466	天齐锂业	2,247,599.35	7.64
48	300253	卫宁健康	2,219,737.00	7.55
49	600588	用友网络	2,206,435.00	7.50
50	600737	中粮糖业	2,194,864.00	7.46
51	600366	宁波韵升	2,174,575.90	7.39
52	002460	赣锋锂业	2,167,622.00	7.37
53	600563	法拉电子	2,151,326.00	7.31
54	300498	温氏股份	2,122,731.00	7.22
55	002439	启明星辰	2,116,189.14	7.19
56	601818	光大银行	2,111,100.00	7.18
57	002531	天顺风能	2,085,337.00	7.09
58	300750	宁德时代	2,078,635.44	7.07
59	000975	银泰资源	2,074,037.28	7.05
60	002074	国轩高科	2,038,957.33	6.93
61	000932	华菱钢铁	2,021,329.00	6.87
62	600155	华创阳安	2,005,124.26	6.82
63	002407	多氟多	2,001,797.00	6.81

64	601238	广汽集团	1,998,360.00	6.79
65	601336	新华保险	1,941,567.00	6.60
66	600418	江淮汽车	1,905,153.47	6.48
67	002050	三花智控	1,892,160.43	6.43
68	601939	建设银行	1,859,500.00	6.32
69	600132	重庆啤酒	1,790,515.00	6.09
70	601877	正泰电器	1,773,299.72	6.03
71	600036	招商银行	1,765,248.00	6.00
72	300618	寒锐钴业	1,730,835.00	5.88
73	603799	华友钴业	1,717,405.00	5.84
74	002422	科伦药业	1,702,660.84	5.79
75	002371	北方华创	1,663,368.00	5.66
76	002372	伟星新材	1,640,120.20	5.58
77	600115	东方航空	1,613,037.57	5.48
78	300438	鹏辉能源	1,598,716.00	5.44
79	600519	贵州茅台	1,580,103.00	5.37
80	600570	恒生电子	1,572,085.00	5.34
81	600546	山煤国际	1,563,687.98	5.32
82	000951	中国重汽	1,561,429.65	5.31
83	002299	圣农发展	1,550,084.00	5.27
84	002415	海康威视	1,545,205.03	5.25
85	600362	江西铜业	1,466,635.00	4.99
86	002850	科达利	1,431,480.00	4.87
87	600549	厦门钨业	1,430,111.60	4.86
88	603986	兆易创新	1,413,547.00	4.81
89	601211	国泰君安	1,399,763.00	4.76
90	002080	中材科技	1,391,342.60	4.73
91	000401	冀东水泥	1,390,302.00	4.73
92	600273	嘉化能源	1,357,637.76	4.62
93	300274	阳光电源	1,325,014.00	4.50
94	000878	云南铜业	1,316,115.00	4.47
95	601668	中国建筑	1,303,000.00	4.43
96	600050	中国联通	1,292,000.00	4.39
97	300144	宋城演艺	1,270,140.00	4.32
98	600131	岷江水电	1,266,162.00	4.30
99	002507	涪陵榨菜	1,261,680.00	4.29
100	600705	中航资本	1,255,503.34	4.27
101	300408	三环集团	1,250,015.00	4.25

102	000651	格力电器	1,244,855.00	4.23
103	600027	华电国际	1,211,640.00	4.12
104	600018	上港集团	1,211,363.00	4.12
105	601128	常熟银行	1,204,093.00	4.09
106	603197	保隆科技	1,199,401.00	4.08
107	002092	中泰化学	1,194,811.00	4.06
108	000983	西山煤电	1,172,252.00	3.99
109	000603	盛达矿业	1,160,947.00	3.95
110	601088	中国神华	1,149,163.00	3.91
111	600489	中金黄金	1,129,100.00	3.84
112	600887	伊利股份	1,126,211.00	3.83
113	600990	四创电子	1,108,252.00	3.77
114	600498	烽火通信	1,095,736.00	3.73
115	601678	滨化股份	1,095,535.00	3.72
116	002008	大族激光	1,071,610.00	3.64
117	600038	中直股份	1,054,936.00	3.59
118	002174	游族网络	1,051,037.00	3.57
119	002027	分众传媒	1,048,474.00	3.56
120	300316	晶盛机电	1,027,970.00	3.50
121	600383	金地集团	1,021,393.00	3.47
122	600859	王府井	1,015,245.46	3.45
123	002182	云海金属	1,007,113.00	3.42
124	300383	光环新网	1,003,576.00	3.41
125	002920	德赛西威	996,599.18	3.39
126	601788	光大证券	989,060.00	3.36
127	600409	三友化工	980,904.00	3.34
128	300340	科恒股份	979,955.00	3.33
129	000723	美锦能源	942,047.00	3.20
130	002714	牧原股份	928,921.84	3.16
131	002179	中航光电	924,241.00	3.14
132	601288	农业银行	912,500.00	3.10
133	603043	广州酒家	912,496.00	3.10
134	600166	福田汽车	899,100.00	3.06
135	600297	广汇汽车	890,507.00	3.03
136	601966	玲珑轮胎	885,605.00	3.01
137	600459	贵研铂业	884,103.00	3.01
138	600111	北方稀土	877,368.00	2.98
139	600312	平高电气	867,987.18	2.95

140	002546	新联电子	867,343.00	2.95
141	603018	中设集团	857,724.00	2.92
142	601838	成都银行	850,777.00	2.89
143	002191	劲嘉股份	849,787.76	2.89
144	600919	江苏银行	848,157.00	2.88
145	600406	国电南瑞	843,380.47	2.87
146	000538	云南白药	836,593.00	2.84
147	000400	许继电气	836,249.57	2.84
148	000002	万 科 A	834,362.00	2.84
149	002234	民和股份	826,644.00	2.81
150	002410	广联达	826,397.00	2.81
151	603160	汇顶科技	813,911.00	2.77
152	300724	捷佳伟创	809,373.00	2.75
153	601881	中国银河	802,738.00	2.73
154	300036	超图软件	801,727.00	2.73
155	600511	国药股份	796,134.00	2.71
156	600967	内蒙一机	786,673.00	2.67
157	300747	锐科激光	784,694.00	2.67
158	600028	中国石化	784,400.00	2.67
159	600392	盛和资源	782,866.00	2.66
160	300496	中科创达	780,670.00	2.65
161	002002	鸿达兴业	778,760.00	2.65
162	300773	拉卡拉	777,053.00	2.64
163	002430	杭氧股份	775,297.00	2.64
164	603305	旭升股份	761,591.00	2.59
165	600612	老凤祥	755,995.00	2.57
166	600585	海螺水泥	752,124.00	2.56
167	600176	中国巨石	742,815.00	2.53
168	600643	爱建集团	742,490.31	2.52
169	300567	精测电子	730,209.00	2.48
170	600674	川投能源	725,288.00	2.47
171	002493	荣盛石化	720,000.00	2.45
172	600660	福耀玻璃	717,618.00	2.44
173	600886	国投电力	706,058.00	2.40
174	600258	首旅酒店	702,991.38	2.39
175	600584	长电科技	699,634.00	2.38
176	002384	东山精密	694,522.00	2.36
177	002155	湖南黄金	688,235.00	2.34

178	601233	桐昆股份	684,420.00	2.33
179	600217	中再资环	677,936.00	2.30
180	002366	台海核电	677,531.68	2.30
181	600729	重庆百货	674,899.88	2.29
182	002157	正邦科技	667,705.00	2.27
183	002001	新和成	658,006.00	2.24
184	300529	健帆生物	655,973.00	2.23
185	600004	白云机场	655,727.00	2.23
186	600011	华能国际	655,600.00	2.23
187	000498	山东路桥	654,856.60	2.23
188	002013	中航机电	654,815.00	2.23
189	002368	太极股份	642,600.00	2.18
190	300183	东软载波	635,271.24	2.16
191	002563	森马服饰	632,792.40	2.15
192	000543	皖能电力	632,400.00	2.15
193	600760	中航沈飞	613,842.00	2.09
194	601328	交通银行	612,200.00	2.08
195	601179	中国西电	597,980.00	2.03
196	600977	中国电影	592,122.61	2.01
197	002518	科士达	591,725.00	2.01

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	406,301,231.05
卖出股票收入（成交）总额	401,446,610.54

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,499,824.00	5.21
	其中：政策性金融债	1,499,824.00	5.21
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	1,499,824.00	5.21

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108602	国开 1704	9,400	949,494.00	3.30
2	108603	国开 1804	5,500	550,330.00	1.91
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 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持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本基金所持有的星源材质（300568）于 2018 年 11 月 9 日收到深交所创业板公司管理部出具的《关于对深圳市星源材质科技股份有限公司、原独立董事吴锋的监管函》（创业板监管函[2018]

第 130 号)。该监管函主要内容为:

1、公司自查发现,时任独立董事吴锋自 2017 年 12 月起担任客户天津力神电池股份有限公司的独立董事。自 2017 年 12 月起,公司及子公司与天津力神及其子公司之间发生的交易构成关联交易。2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日,公司及子公司向天津力神及其子公司销售锂离子电池隔膜产品的交易金额(不含增值税)为 2917.40 万元,但公司迟至 2018 年 10 月 12 日才召开第四届董事会第十一次会议审议了《关于确认和预计公司与天津力神日常关联交易情况的议案》并进行了信息披露。吴锋在担任天津力神独立董事后未及时告知公司的行为,违反了《创业板股票上市规则(2014 年修订)》以及《创业板上市公司规范运作指引(2015 年修订)》的相关规定。

公司整改情况:公司在收到监管函后,立即将监管函转达至公司原独立董事吴锋,并组织公司现任董事、监事、高级管理人员及证券部相关人员就监管函涉及事项进行反省和总结。公司将吸取教训,加强对相关法律、法规和规则的学习,进一步加强信息披露工作管理,规范公司治理,杜绝此类问题再次发生,并于 2018 年 11 月 23 日向深圳证券交易所报送了《天风证券股份有限公司关于深圳市星源材质科技股份有限公司关联交易情况的专项现场检查报告》。

2、公司于 2018 年 3 月 23 日发布《关于控股股东、实际控制人进行股票质押式回购交易的公告》,称公司于 3 月 23 日接到控股股东、实际控制人陈秀峰的通知,其于 2018 年 3 月 6 日办理了 1770 万股公司股票质押,质押数量占公司总股本的 9.22%。该事项未及时通知并配合上市公司对上述质押业务予以披露,违反了《深圳证券交易所创业板股票上市规则》的相关规定。

公司整改情况:公司在收到监管函后,立即将监管函转达至控股股东、实际控制人陈秀峰,并组织公司现任董事、监事、高级管理人员及证券部相关人员就监管函涉及事项进行反省和总结。公司将吸取教训,加强对相关法律、法规和规则的学习,进一步加强信息披露工作管理,规范公司治理,杜绝此类问题再次发生。自收到监管函并进行充分学习、整改后,公司密切关注公司控股股东、实际控制人的股权质押、解除质押相关事宜,并对后续股权质押、解除质押相关事宜进行及时、充分的披露。

本基金所持有的亿纬锂能(300014)于 2019 年 6 月收到中国证券监督管理委员会广东监管局采取监管关注措施的处罚。主要违法违规事实:一、公司治理及内部控制存在的问题: (一) 董事会及专门委员会会议记录不规范,公司部分董事会及下设委员会现场会议记录未由出席会议的董事签名确认,且相关会议记录也未记录每一决议事项的具体表决方式,不符合公司《董事会议事规则》的相关要求,且违反了《公司法》以及《上市公司章程指引(2006 年修订)》等相关规定。(二) 公司章程个别条款存在瑕疵,公司《公司章程》第一百一十一条规定独立董事连续三次未亲自出席董事会会议的由董事会提请股东大会予以撤换,而按照有关规定,董事连续两次未能亲自出席

或委托其他董事出席董事会会议的, 即应建议予以撤换。公司上述规定违反了《上市公司章程指引(2006 年修订)》的相关规定。二、信息披露存在的问题: 公司 2012 年年度报告未披露审计报告正文; 超募资金投资项目锂离子电池生产线(扩产)项目 2013 年度已经投产并产生盈利, 公司 2013 年年报募集资金项目情况“截止报告期末累积实现的效益”栏目为空白, 未准确披露项目效益情况; 2013 年年报中披露审计意见时错误披露公司名称和会计期间。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》和《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 30 号-创业板上市公司年度报告的内容与格式》等相关规定。三、财务核算存在的问题: (一) 未及时计提缴纳城市维护建设税和教育费附加。公司 2010 年 6 月至 2011 年 12 月期间未计提缴纳当期城市维护建设税和教育费附加合计 221.21 万元。公司于 2012 年 5 月进行补提, 计入当月营业税金及附加科目并在当月缴纳, 上述行为违反了《会计准则—基本准则》的相关规定。(二) 会计基础工作不规范。包括: 公司 2011 年 12 月收到政府补助拨款 1,600 万元, 但记账凭证未附相关银行进账单据; 公司 2012 年与佰特瑞及 BSBPowerCompanyLimited(以下简称“BSB”)的交易中, 在未发生产品入库和出库的情况下编制入库单和出库单, 并以此确认销售收入。上述行为不符合《会计基础工作规范》的相关规定。四、内幕信息管理存在的问题: 公司 2012 年年度报告内幕信息知情人档案未记录个别审计报告签字注册会计师和部分审计小组成员, 违反了《关于上市公司建议内幕信息知情人登记管理制度的规定》的有关规定。以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的中信证券(601336)于 2018 年 12 月 18 日收到中国人民银行南京分行关于违反反洗钱规定的处罚, 对单位罚款人民币 20 万元。

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序:

(1) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究, 形成有关的各类报告, 为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议, 讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中, 没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议, 参考上述报告, 并结合自身的分析判断, 形成基金投资计划, 主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令, 制定交易策略, 统一进行具体品种的交易; 基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施, 监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资星源材质主要基于以下原因：公司是国内早期进入隔膜领域的企业之一，也是第一家向国外出口干法隔膜的企业。公司在干法领域有着长达十几年之久的研发生产经验，技术积累深厚。渠道方面，公司干法产品在国际市场受到三星、LG 化学、日产等一线锂电厂商的青睐，产品订单数量可观。公司干法产品从生产环节到销售环节均占据着绝对优势，干法龙头地位稳固。

本基金投资亿纬锂能主要基于以下原因：公司现已成为中国锂电池行业的领先企业，已拥有 59 项国家专利且在相关行业拥有技术和生产规模优势，是具有国际先进技术水平的绿色高能锂电池全国主要供应商之一。在全球新能源产业不断升级的背景下，公司引进了先进的自动化生产设备和尖端的分析测试仪器，研发生产更高质量的产品。公司拥有一支以资深专家顾问组成的高素质研发团队，并采用中外高校研究机构合作的方式，确保公司始终保持走在行业前沿。

本基金投资中信证券主要基于以下原因：公司属于上市券商龙头，机构客户市占率排名行业第一，拥有丰富的客户资源。同时，在投行，资管等业务线条名列行业前三，综合实力排名行业第一，在证券行业中具有较强的核心竞争力。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

7.12.2 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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	132,673.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,893.64
5	应收申购款	53,728.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	208,295.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 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的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,127	4,433.14	6,971,108.18	25.67%	20,190,761.17	74.33%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,159.78	0.0116%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年6月21日）基金份额总额	25,914,828.24
本报告期期初基金份额总额	28,875,988.17
本报告期期间基金总申购份额	13,434,374.32
减：本报告期期间基金总赎回份额	15,148,493.14
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	27,161,869.35

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券股份有限公司	2	796,314,456.64	100.00%	733,510.06	100.00%	-

司						
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有 限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内，本基金交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
太平洋证券股份有限公司	14,774,243.42	100.00%	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有	-	-	-	-	-	-

限公司					
-----	--	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方基金管理有限责任公司年度最后一日基金净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 1 月 2 日
2	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上海证券报	2019 年 1 月 18 日
3	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年度）	上海证券报	2019 年 2 月 1 日
4	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018 年度）	上海证券报	2019 年 2 月 1 日
5	关于增加民生证券为旗下部分基金销售机构同时开通定投、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 2 月 12 日
6	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2018 年度报告摘要	上海证券报	2019 年 3 月 28 日
7	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2018 年度报告	上海证券报	2019 年 3 月 28 日
8	关于继续参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019 年 3 月 29 日
9	关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019 年 4 月 2 日
10	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报	2019 年 4 月 19 日
11	关于增加阳光人寿保险为旗下基金销售机构并开通定投及转换业务且参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 5 月 21 日
12	关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 5 月 28 日
13	关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 6 月 11 日
14	关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下基金销售机构同	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2019 年 6 月 18 日

	时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	券日报	
15	关于旗下部分基金继续参与中国银行全渠道基金定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20190101 - 20190630	11,271,108.18	-	4,300,000.00	6,971,108.18	25.67%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.orient-fund.com）查阅。

东方基金管理有限责任公司

2019年8月27日