

金信深圳成长灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：金信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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 1 月 1 日起至 6 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.....	7
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
3.3 其他指标.....	错误！未定义书签。
§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.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
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.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 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.....	46
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48

10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	金信深圳成长混合
基金主代码	002863
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日
基金管理人	金信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	90,105,093.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，从主要业务或者主体位于深圳的上市公司中选择具有持续成长能力的公司进行投资，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五个方面：</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量宏观经济指标以及各项国家政策来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对进行分析评估，制定大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>基金以深圳区域为投资主题，投资范围为主要业务或者主体位于深圳的上市公司，深度挖掘深圳在城市提升、改革转型、科技创新以及与世界经济融合发展过程中产生的各类投资机遇，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在大类资产配置的基础上，本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取的积极投资策略，把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，以获取稳健的投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的的证券发行条款，同时密切关注流动性变化对标的的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p>

	<p>5、衍生品投资策略</p> <p>1) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。</p> <p>2) 权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具。</p>
业绩比较基准	深证成份指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

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		金信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段卓立	张燕
	联系电话	0755-82510502	0755-83199084
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-866-2866	95555
传真		0755-82510305	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518038	518040
法定代表人		殷克胜	李建红

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.jxfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金信基金管理有限公司	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室

§ 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	15,792,816.01
本期利润	17,190,589.96
加权平均基金份额本期利润	0.1520
本期加权平均净值利润率	13.70%
本期基金份额净值增长率	10.42%
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	-9,461,809.25
期末可供分配基金份额利润	-0.1050
期末基金资产净值	97,427,839.18
期末基金份额净值	1.081
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	8.10%

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, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

3. 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。

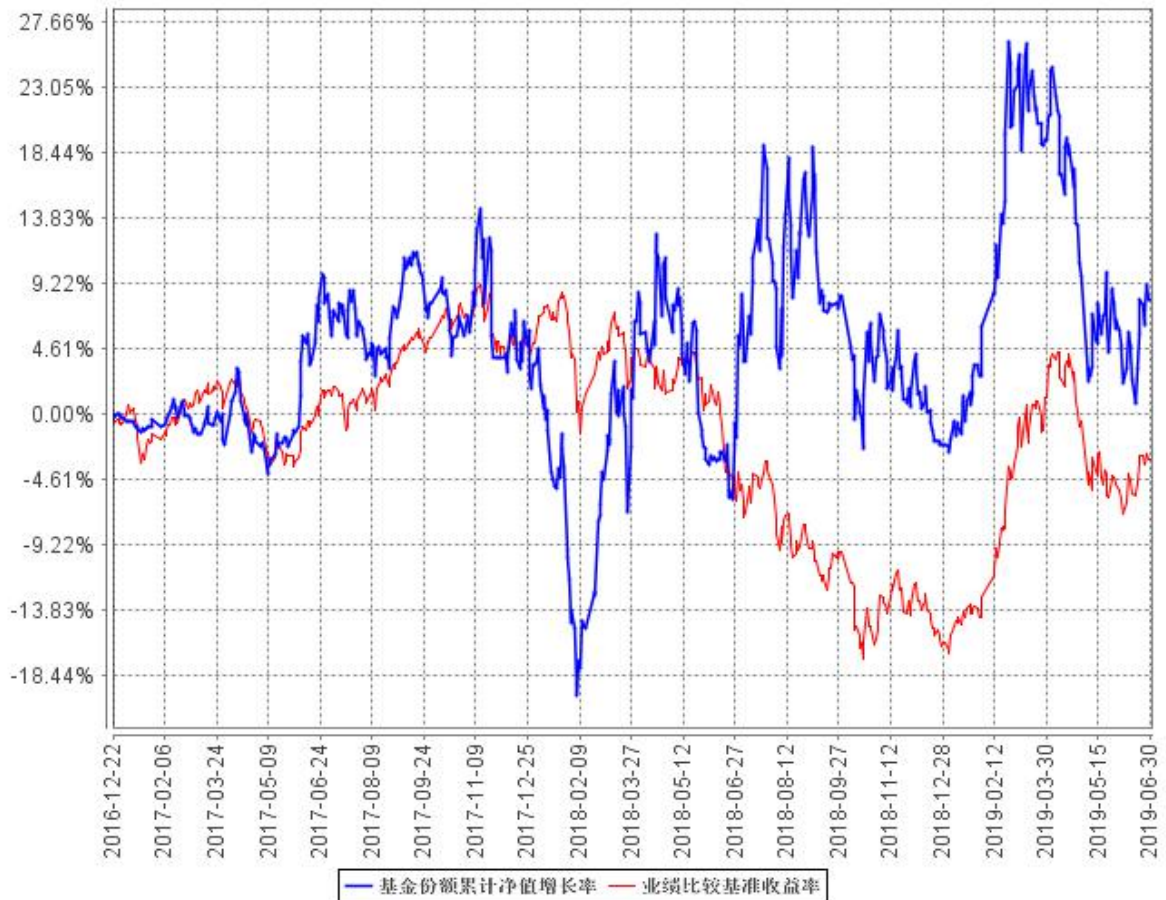
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	1.31%	1.56%	2.04%	0.89%	-0.73%	0.67%
过去三个月	-9.46%	1.89%	-4.56%	1.19%	-4.90%	0.70%
过去六个月	10.42%	1.87%	18.10%	1.16%	-7.68%	0.71%
过去一年	2.37%	1.90%	0.71%	1.11%	1.66%	0.79%
自基金合同生效起至今	8.10%	1.69%	-3.11%	0.88%	11.21%	0.81%

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

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



§ 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

金信基金管理有限公司成立于 2015 年 7 月，注册资本 1 亿元人民币，注册地位于深圳前海，是经中国证监会批准设立的公募基金管理公司，业务范围包括基金募集、基金销售、基金管理、特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

金信基金管理有限公司作为国内首家管理团队出任第一大股东的公募基金公司，管理团队持股 35%，是公司第一大股东。此外，公司股东还包括深圳卓越创业投资有限责任公司及安徽国元信托有限责任公司，两家机构出资比例分别为：34%、31%。

截至报告期末，金信基金管理有限公司管理资产规模超过 58.91 亿元，旗下管理 11 只开放式公募基金和 12 只资产管理计划。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐雷	本基金基金经理	2016 年 12 月 22 日	-	12	男，武汉大学物理学理学学士、北京大学光华管理学院工商管理硕士。先后任职于民生加银基金、安信证券资产管理部。现担任金信基金基金经理。

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，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“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合规守信情况的说明

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的规定以及《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，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，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范

围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工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基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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

本基金将在对宏观经济、国家政策、市场趋势和结构进行深度分析的基础上，加强基于行业比较的大类资产配置，同时结合公司的深度研究，采用灵活积极主动的投资策略，在尽力规避市场风险的前提下，力求给投资者带来长期稳定的投资回报。

今年一季度，与传统“春季躁动”行情类似，宽松政策刺激 A 股市场走出了一轮快速上涨行情。随后，在三月份超预期经济数据、政策边际收紧和外部环境不确定性加大等等诸多因素的影响下，A 股市场走出了“过山车”式的行情。从三月最后一个交易日开始，市场在超预期经济数据的刺激下脉冲式上涨，投资者对经济企稳回升的预期增强，周期板块成为市场的主导结构。然而四月的政治局会确认了宽松政策边际收紧，市场开始进入调整。五月初，中美贸易摩擦升级显著超过市场预期，美国再次针对中国出口商品加征关税，华为被美国加入“实体名单”，投资者风险偏好遭受沉重打击，市场快速下跌之后进入弱势震荡状态。五月份的震荡之后，由于面临极大的不确定性，机构投资者青睐业绩和估值相对确定的消费龙头，以消费龙头为代表的“核心资产”成为市场的投资主线。

4.4.2 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 1.081 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.42%，业绩比较基准收益率为 18.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，股票市场受到宏观经济下行、逆周期调节政策的力度和外部环境不确定性三个核心变量的影响。市场在政策和外部环境两个方面都出现了积极的变化，我们判断股票市场在三

季度已经进入阶段性上行趋势中。

作为外生变量的外部环境在二季度的意外恶化，严重打击市场风险偏好，直接导致市场台阶式下跌。六月底的 G20 会议前后中美重启贸易谈判，三季度外部环境有所缓解，不确定性下降，有利于风险偏好逐步提升。值得注意的是，经过了过去一年多的起伏，投资者已经认识到了中美关系摩擦具有长期性。中长期来看，除非中美之间出现全面对抗升级或者全面缓解两种极端情况，中美关系的变化对市场的影响可能会逐步钝化。

宏观经济仍然处在下行趋势中。在经历了三月超预期经济数据的扰动之后，宏观经济遭遇意外加征关税、金融市场的动荡以及海外市场经济下行等等冲击，整体经济下行压力进一步加大。所幸的是，投资者对宏观经济下行预期比较充分，政策的对冲也在很大程度上消除了对于宏观经济失速下行的担忧。

在外部环境不确定、金融市场出现扰动和经济下行压力增加的背景下，对冲政策出现了加码发力的向上拐点。我们判断 6 月 10 日出台的地方政府专项债的新规，以及政策重提加大逆周期调节力度，是一个对冲政策加码发力的拐点，后续我们可能还会看到更大力度的政策出台，以及 7 月份政治局会议对政策定调的明确。我们判断三季度逆周期调节政策与一季度的托底政策有明显的区别，首先政策力度会有所控制，不会强刺激，其次我们判断在短期稳增长的财政货币政策和中长期供给侧改革上会有兼顾和平衡。

更宏观的背景下，六月份以来全球宽松预期加强，全球风险资产都出现了明显上涨，A 股的上涨也是全球风险上涨的一部分。

在市场趋势之外，目前市场更重要的可能是风格结构。我们判断市场风格可能会出现从价值白马向科技成长风格的切换，这个判断有别于现在市场对于以消费龙头为主的“核心资产”的一致预期。

首先，我们担忧经济下行最终会逐步影响到消费行业龙头公司的盈利增长，从而带来一致预期的松动。

其次，对冲政策发力、外部环境不确定性降低以及七月份科创板公司上市交易将会带来市场风险偏好的修复，有利于科技成长板块的表现。

中期来看，供给侧改革和产业结构调整的效果将会逐步体现，部分新兴产业有望确认产业趋势，进入新一轮行业景气，从而有可能成为股票市场下一阶段的投资主线。

我们看好科技成长板块。一类是高景气高业绩增速的科技成长子行业，比如光伏、云计算、医疗信息化、通信、新能源汽车等等。另一类是自主可控板块，包括半导体、国产软件硬件等等。在贸易摩擦长期化的背景下，自主可控板块从单纯政策推动转变成政策和企业需求双重拉动的，

而板块也会从前期主题性逐步转变为中长期产业性的投资机会。

此外我们密切关注科创板企业大规模上市之后的资金分流效应带来的风险。在科创板推出前期，市场关注度较高，可能会抬升原有同类型上市公司的估值水平。但是，在宏观条件保持稳定的情况下，科创板企业大规模上市相当于股市急剧扩容，将会吸纳大量的交易资金，有可能导致股票市场的资金供需失衡，从而使 A 股整体承受比较大的估值下行压力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人由总经理、督察长、运作保障部、基金投资部、监察稽核部、交易部负责人及其他相关人员，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，报告期本基金无利润分配事项。

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

本基金为发起式基金，截至 2019 年 6 月 30 日，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金净值的限制性条款暂不适用本基金。

§ 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

托管人声明:招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	696,653.76	136,938,336.94
结算备付金		3,303,310.26	941,054.28
存出保证金		251,504.83	241,423.02
交易性金融资产	6.4.7.2	97,020,766.26	33,440,315.30
其中：股票投资		92,024,766.26	33,440,315.30
基金投资		-	-
债券投资		4,996,000.00	-
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		1,453,618.17	-
应收利息	6.4.7.5	52,857.91	31,906.79
应收股利		-	-
应收申购款		261,927.76	61,359.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		103,040,638.95	171,654,395.80
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		3,600,000.00	-
应付证券清算款		200,940.12	22,169,951.59
应付赎回款		1,284,637.02	1,538,592.94
应付管理人报酬		118,721.08	200,879.99
应付托管费		19,786.83	33,479.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	309,501.79	211,388.32
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,212.93	93,581.43
负债合计		5,612,799.77	24,247,874.26
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	90,105,093.78	150,525,786.31
未分配利润	6.4.7.10	7,322,745.40	-3,119,264.77
所有者权益合计		97,427,839.18	147,406,521.54
负债和所有者权益总计		103,040,638.95	171,654,395.80

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.081 元，基金份额总额 90,105,093.78 份。

6.2 利润表

会计主体：金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

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 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		19,387,613.34	-351,894.12
1.利息收入		155,919.90	62,997.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	61,405.94	30,469.70
债券利息收入		59,198.20	945.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,315.76	31,581.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,199,241.28	-4,671,429.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,413,123.07	-4,756,683.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-22,943.73	70.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-459,000.00	-
股利收益	6.4.7.16	268,061.94	85,183.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,397,773.95	3,696,509.37
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	634,678.21	560,028.78
减：二、费用		2,197,023.38	599,508.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	931,115.91	258,431.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	155,185.91	43,071.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	1,013,271.60	252,420.44
5. 利息支出		16,429.73	-
其中：卖出回购金融资产支出		16,429.73	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	81,020.23	45,584.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,190,589.96	-951,402.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,190,589.96	-951,402.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

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）	150,525,786.31	-3,119,264.77	147,406,521.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,190,589.96	17,190,589.96
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）	-60,420,692.53	-6,748,579.79	-67,169,272.32
其中：1.基金申购款	105,367,464.05	20,032,632.40	125,400,096.45
2.基金赎回款	-165,788,156.58	-26,781,212.19	-192,569,368.77
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）	90,105,093.78	7,322,745.40	97,427,839.18
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	11,638,057.59	410,831.06	12,048,888.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-951,402.33	-951,402.33
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)	40,341,853.28	3,442,417.43	43,784,270.71
其中：1.基金申购款	119,267,788.65	4,954,721.74	124,222,510.39
2.基金赎回款	-78,925,935.37	-1,512,304.31	-80,438,239.68
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)	51,979,910.87	2,901,846.16	54,881,757.03

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：

<u> 殷克胜 </u>	<u> 殷克胜 </u>	<u> 陈瑾 </u>
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

金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1135号《关于准予金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由金信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,066,237.50元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]02230518号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,066,244.28份基金份额,其中认购资金利息折合6.78份基金份额。本基金的基金管理人为金信基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本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(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券))、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于本基金合同界定的深圳成长主题的证券不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金净资产的比例不高于 3%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律规定。

本基金的业绩比较基准为：深证成份指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，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等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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) 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转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	696,653.76
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：	696,653.76

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	90,837,759.86	92,024,766.26	1,187,006.40
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,996,000.00	-15,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,996,000.00	-15,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	95,848,759.86	97,020,766.26	1,172,006.40

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衍生金融资产/负债。

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	196.68
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	335.70
应收债券利息	52,212.33
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	113.20
合计	52,857.91

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	309,501.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	309,501.79

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	1,593.35
预提费用	77,619.58
合计	79,212.93

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	150,525,786.31	150,525,786.31
本期申购	105,367,464.05	105,367,464.05
本期赎回(以“-”号填列)	-165,788,156.58	-165,788,156.58
- 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	90,105,093.78	90,105,093.78

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	-32,279,390.41	29,160,125.64	-3,119,264.77
本期利润	15,792,816.01	1,397,773.95	17,190,589.96
本期基金份额交易产生的变动数	7,024,765.15	-13,773,344.94	-6,748,579.79
其中：基金申购款	-17,921,765.34	37,954,397.74	20,032,632.40
基金赎回款	24,946,530.49	-51,727,742.68	-26,781,212.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,461,809.25	16,784,554.65	7,322,745.40

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	50,023.92
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	9,263.83
其他	2,118.19
合计	61,405.94

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	388,627,154.20
减：卖出股票成本总额	371,214,031.13

买卖股票差价收入	17,413,123.07
----------	---------------

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	-22,943.73
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	-22,943.73

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	6,290,676.67
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,092,400.00
减：应收利息总额	221,220.40
买卖债券差价收入	-22,943.73

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益--赎回差价收入

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益--申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-459,000.00

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	268,061.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	268,061.94

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	1,397,773.95
——股票投资	1,412,773.95
——债券投资	-15,000.00
——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	1,397,773.95
----	--------------

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	634,678.21
合计	634,678.21

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	1,013,271.60
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	1,013,271.60

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	57,783.79
银行费用	3,400.65
合计	81,020.23

6.4.7.21 分部报告

本基金无分部报告。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
金信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
深圳市卓越创业投资有限责任公司	基金管理人的股东
安徽国元信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳市巨财汇投资有限公司	基金管理人的股东
殷克胜	基金管理人的股东

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月	2018年1月1日至2018年6月30日

	30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	931,115.91	258,431.66
其中：支付销售机构的客户维护费	320,507.03	90,462.22

注：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 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金管理人按照与基金代销机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	155,185.91	43,071.97

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

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

本基金本报告期内与关联方无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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.0982%	19.2382%

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

本基金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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 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
招商银行	696,653.76	50,023.92	5,650,951.34	28,194.23

注：本基金的银行活期存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

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暂时停牌等流通受限股票。

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 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款 3,600,000.00，于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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与货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险以及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的管理人建设全面风险体系，建立了以公司董事会风险控制与审计委员会为核心的、由投资决策委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。在公司管理层下设立投资决策委员会和监察稽核部对公司的风险进行的预防和控制；投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产投资战略和投资策略，对

基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的；监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门和分支机构，对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。在业务部门层面，公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施。

本基金的管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,996,000.00	-
合计	4,996,000.00	-

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理的部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	696,653.76	-	-	-	-	-	696,653.76
结算备付金	3,303,310.26	-	-	-	-	-	3,303,310.26
存出保证金	251,504.83	-	-	-	-	-	251,504.83
交易性金融资产	-	-	4,996,000.00	-	-	92,024,766.26	97,020,766.26
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,453,618.17	1,453,618.17
应收利息	-	-	-	-	-	52,857.91	52,857.91
应收申购款	-	-	-	-	-	261,927.76	261,927.76
资产总计	4,251,468.85	-	4,996,000.00	-	-	93,793,170.10	103,040,638.95
负债							
卖出回购金融资产款	3,600,000.00	-	-	-	-	-	3,600,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	200,940.12	200,940.12
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,284,637.02	1,284,637.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	118,721.08	118,721.08
应付托管费	-	-	-	-	-	19,786.83	19,786.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	309,501.79	309,501.79
其他负债	-	-	-	-	-	79,212.93	79,212.93
负债总计	3,600,000.00	-	-	-	-	2,012,799.77	5,612,799.77
利率敏感度缺口	651,468.85	-	4,996,000.00	-	-	91,780,370.33	97,427,839.18
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	136,938,336.94	-	-	-	-	-	136,938,336.94
结算备付金	941,054.28	-	-	-	-	-	941,054.28
存出保证金	241,423.02	-	-	-	-	-	241,423.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	33,440,315.30	33,440,315.30
应收利息	-	-	-	-	-	31,906.79	31,906.79
应收申购款	-	-	-	-	-	61,359.47	61,359.47
资产总计	138,120,814.24	-	-	-	-	33,533,581.56	171,654,395.80
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,169,951.59	22,169,951.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,538,592.94	1,538,592.94

应付管理人报酬	-	-	-	-	200,879.99	200,879.99
应付托管费	-	-	-	-	33,479.99	33,479.99
应付交易费用	-	-	-	-	211,388.32	211,388.32
其他负债	-	-	-	-	93,581.43	93,581.43
负债总计	-	-	-	-	-24,247,874.26	24,247,874.26
利率敏感度缺口	138,120,814.24	-	-	-	-9,285,707.30	147,406,521.54

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	市场利率下降 25 个基点	6,876.00	-
	市场利率上升 25 个基点	-6,849.90	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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

其他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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票的投资比例为基金总资产的 0-95%，其中投资于本基金合同界定的深圳成长主题的证券不低于非现金基金资产的

80%，权证投资占基金净资产的比例不高于 3%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律规定。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

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	92,024,766.26	94.45	33,440,315.30	22.69
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	4,996,000.00	5.13	-	-
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	97,020,766.26	99.58	33,440,315.30	22.69

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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 指数上升 5%		5,186,656.28
沪深 300 指数下降 5%		-5,186,656.28	-1,721,732.30

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 91,990,896.32 元，属于第二层次的余额为 5,029,869.94 元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期

间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入

值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	92,024,766.26	89.31
	其中：股票	92,024,766.26	89.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,996,000.00	4.85
	其中：债券	4,996,000.00	4.85
	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	3,999,964.02	3.88
8	其他各项资产	2,019,908.67	1.96
9	合计	103,040,638.95	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	76,514,917.61	78.53
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	15,475,978.71	15.88
J	金融业	33,869.94	0.03

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,024,766.26	94.45

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002371	北方华创	89,014	6,164,219.50	6.33
2	601012	隆基股份	266,337	6,155,048.07	6.32
3	300316	晶盛机电	464,585	5,895,583.65	6.05
4	600438	通威股份	412,791	5,803,841.46	5.96
5	002129	中环股份	589,822	5,756,662.72	5.91
6	300253	卫宁健康	381,200	5,405,416.00	5.55
7	600584	长电科技	409,700	5,264,645.00	5.40
8	000066	中国长城	496,400	5,102,992.00	5.24
9	603501	韦尔股份	87,900	4,826,589.00	4.95
10	603986	兆易创新	54,900	4,759,830.00	4.89
11	600460	士兰微	271,971	4,514,718.60	4.63
12	600745	闻泰科技	135,465	4,500,147.30	4.62
13	300451	创业慧康	272,227	4,069,793.65	4.18
14	300274	阳光电源	369,100	3,451,085.00	3.54
15	002410	广联达	102,100	3,358,069.00	3.45
16	300568	星源材质	122,400	2,821,320.00	2.90
17	600588	用友网络	96,600	2,596,608.00	2.67
18	300001	特锐德	144,000	2,594,880.00	2.66
19	300014	亿纬锂能	80,178	2,442,221.88	2.51
20	603305	旭升股份	96,217	2,300,548.47	2.36
21	300567	精测电子	42,965	2,256,521.80	2.32
22	300724	捷佳伟创	68,600	1,826,132.00	1.87

23	601698	N 卫 通	10,103	39,603.76	0.04
24	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.03
25	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.03
26	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.03
27	603863	松炆资源	830	19,156.40	0.02
28	002405	四维图新	403	6,488.30	0.01

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	600030	中信证券	20,352,598.83	13.81
2	600837	海通证券	18,250,085.00	12.38
3	002129	中环股份	17,495,129.70	11.87
4	600999	招商证券	16,293,137.00	11.05
5	601688	华泰证券	16,278,232.88	11.04
6	300059	东方财富	14,597,586.20	9.90
7	601012	隆基股份	12,589,580.35	8.54
8	600438	通威股份	12,510,777.00	8.49
9	601788	光大证券	11,990,468.97	8.13
10	300274	阳光电源	11,843,246.00	8.03
11	002371	北方华创	9,789,008.46	6.64
12	300724	捷佳伟创	9,460,188.18	6.42
13	000066	中国长城	9,314,021.16	6.32
14	300316	晶盛机电	8,742,829.00	5.93
15	000063	中兴通讯	8,659,472.00	5.87
16	002410	广 联 达	8,467,575.60	5.74
17	300001	特 锐 德	8,123,300.00	5.51
18	600845	宝信软件	7,992,566.80	5.42
19	600588	用友网络	7,916,215.50	5.37
20	601318	中国平安	7,019,965.00	4.76
21	601336	新华保险	7,002,250.36	4.75
22	603019	中科曙光	6,794,419.20	4.61
23	002049	紫光国微	6,640,771.00	4.51
24	600745	闻泰科技	6,409,518.00	4.35
25	601628	中国人寿	6,304,172.00	4.28

26	600460	士 兰 微	6,041,372.00	4.10
27	600089	特变电工	5,895,061.82	4.00
28	600584	长电科技	5,778,886.00	3.92
29	603986	兆易创新	5,770,768.00	3.91
30	603026	石大胜华	5,406,315.00	3.67
31	300496	中科创达	5,278,229.00	3.58
32	300253	卫宁健康	5,213,612.00	3.54
33	300451	创业慧康	4,977,843.00	3.38
34	002405	四维图新	4,897,801.00	3.32
35	603501	韦尔股份	4,869,640.00	3.30
36	603160	汇顶科技	4,841,892.00	3.28
37	600536	中国软件	4,688,292.70	3.18
38	002594	比 亚 迪	4,408,278.00	2.99
39	600312	平高电气	4,406,442.00	2.99
40	600406	国电南瑞	4,368,191.48	2.96
41	601166	兴业银行	4,215,771.00	2.86
42	601818	光大银行	4,208,256.00	2.85
43	000001	平安银行	4,205,996.00	2.85
44	601939	建设银行	4,205,129.00	2.85
45	300497	富祥股份	4,134,800.00	2.81
46	000703	恒逸石化	4,064,884.00	2.76
47	002391	长青股份	4,011,757.96	2.72
48	002373	千方科技	3,940,479.00	2.67
49	300073	当升科技	3,680,356.00	2.50
50	300037	新 宙 邦	3,678,185.00	2.50
51	000400	许继电气	3,522,033.99	2.39
52	603806	福 斯 特	3,438,684.50	2.33
53	603639	海 利 尔	3,222,239.12	2.19
54	300450	先导智能	2,948,168.14	2.00

注：买入包括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，买入金额按成交金额（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	600837	海通证券	20,314,686.40	13.78
2	600030	中信证券	19,395,800.95	13.16
3	600999	招商证券	17,789,217.25	12.07
4	002129	中环股份	17,393,387.52	11.80
5	601688	华泰证券	16,942,998.33	11.49
6	300059	东方财富	16,836,915.83	11.42
7	601788	光大证券	13,354,442.36	9.06
8	601012	隆基股份	12,688,365.44	8.61
9	600438	通威股份	11,753,133.40	7.97
10	000063	中兴通讯	11,669,239.38	7.92
11	300274	阳光电源	8,675,309.62	5.89
12	300724	捷佳伟创	8,002,432.29	5.43
13	002049	紫光国微	7,985,438.38	5.42
14	002594	比亚迪	7,600,458.41	5.16
15	000400	许继电气	7,562,415.90	5.13
16	600845	宝信软件	7,442,194.99	5.05
17	600312	平高电气	7,316,250.58	4.96
18	601318	中国平安	7,144,925.00	4.85
19	601336	新华保险	7,057,493.44	4.79
20	300037	新宙邦	7,004,668.65	4.75
21	300450	先导智能	6,872,509.15	4.66
22	600406	国电南瑞	6,541,782.94	4.44
23	300001	特锐德	6,467,806.20	4.39
24	603019	中科曙光	6,396,979.00	4.34
25	300750	宁德时代	6,353,613.29	4.31
26	600089	特变电工	6,299,645.89	4.27
27	601628	中国人寿	6,237,018.38	4.23
28	300073	当升科技	6,090,992.79	4.13
29	600547	山东黄金	5,654,642.26	3.84
30	002410	广联达	5,620,075.00	3.81
31	600536	中国软件	5,211,132.50	3.54
32	603026	石大胜华	5,176,008.81	3.51
33	600588	用友网络	4,902,393.60	3.33
34	000066	中国长城	4,675,830.00	3.17
35	601166	兴业银行	4,267,267.09	2.89
36	601939	建设银行	4,253,244.00	2.89
37	601818	光大银行	4,198,140.00	2.85
38	000001	平安银行	4,180,643.18	2.84

39	603160	汇顶科技	4,110,696.44	2.79
40	300496	中科创达	3,965,603.10	2.69
41	002405	四维图新	3,880,532.04	2.63
42	300497	富祥股份	3,833,248.32	2.60
43	002391	长青股份	3,801,948.31	2.58
44	000703	恒逸石化	3,637,582.39	2.47
45	603806	福斯特	3,380,557.70	2.29
46	002371	北方华创	3,103,813.08	2.11

注：卖出包括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，卖出金额按成交金额（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	428,385,708.14
卖出股票收入（成交）总额	388,627,154.20

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	4,996,000.00	5.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	4,996,000.00	5.13

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	019611	19 国债 01	50,000	4,996,000.00	5.13

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-459,000.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

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没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	251,504.83
2	应收证券清算款	1,453,618.17
3	应收股利	-
4	应收利息	52,857.91
5	应收申购款	261,927.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,019,908.67

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中未有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
4,979	18,097.03	41,947,284.35	46.55%	48,157,809.43	53.45%

注：户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数总计

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金未申请场内上市交易。

8.3 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	71,818.56	0.0797%

8.4 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.5 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	10,000,000.00	11.10	10,000,000.00	11.10	自合同生效 之日起不少 于3年
基金管理人高级 管理人员	52,246.61	0.06	-	-	-
基金经理等人员	18,388.62	0.02	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,070,635.23	11.18	10,000,000.00	11.10	自合同生效 之日起不少 于3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 12 月 22 日 ）基金份额总额	10,066,244.28
本报告期期初基金份额总额	150,525,786.31
本报告期期间基金总申购份额	105,367,464.05
减：本报告期期间基金总赎回份额	165,788,156.58
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	90,105,093.78

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所无变化。

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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受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	
海通证券	1	318,688,114.81	39.09%	226,678.71	42.03%	-
中金公司	1	242,598,916.88	29.76%	172,560.41	31.99%	-
中信建投	2	134,971,190.49	16.56%	55,513.61	10.29%	-
国盛证券	1	118,963,198.09	14.59%	84,618.44	15.69%	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

安信证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司投资、研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果征求有关部门意见，经公司领导审核后选择交易单元：

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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
海通证券	17,037,800.00	99.60%	243,600,000.00	70.51%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	69,069.00	0.40%	101,900,000.00	29.49%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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	金信基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证券日报、证券时报、上海证券报、中国证券报、公司网站	2019年1月2日
2	金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年第4季度报告	上海证券报、公司网站	2019年1月21日
3	金信基金关于旗下部分基金增加中信建投证券为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2019年1月31日
4	金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2018年第2号）全文及摘要	上海证券报、公司网站	2019年2月1日
5	金信基金关于旗下基金柜台直销费率优惠的公告	证券日报、证券时报、上海证券报、中国证券报、公司网站	2019年3月7日
6	金信基金关于旗下基金增加中山证券为代销机构的公告	证券日报、证券时报、上海证券报、中国证券报、公司网站	2019年3月26日
7	金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年度报告及摘要	上海证券报、公司网站	2019年3月26日
8	金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年第1季度报告	上海证券报、公司网站	2019年4月20日
9	金信基金关于旗下基金增加长量基金为代销机构的公告	证券日报、证券时报、上海证券报、中国证券报、公司网站	2019年6月12日
10	金信基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证券日报、上海证券报、证券时报、公司网站	2019年6月29日
11	金信基金管理有限公司旗下基金半年度净值公告	证券日报、证券时报、上海证券报、中国证券报、公司网站	2019年6月29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	2019.03.27-2019.06.30	23,960,862.62	0.00	0.00	23,960,862.62	26.59%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、大额赎回风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

（1）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；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）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）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能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；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

金信基金管理有限公司

地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室。

12.3 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) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.jxfunds.com.cn。

金信基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日