

# 睿远成长价值混合型证券投资基金

## 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:睿远基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 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23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3月26日（基金合同生效日）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                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| 3.3 其他指标                                | 10 |
| §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遵规守信情况的说明              | 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                 | 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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)                      | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 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                               | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 46 |
| 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       | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 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      | 51 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 52 |
| 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   | 52 |
| 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      | 52 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 52 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 52 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 52 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 53 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 54 |

|   |    |
|---|----|
| 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情况.....   | 54 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 55 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 55 |
| 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.....   | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 55 |
| 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.....      | 56 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 56 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 56 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 58 |
| 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..... | 58 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 58 |
| §12 备查文件目录.....                         | 58 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 58 |
| 12.2 存放地点.....                          | 58 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 59 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                 |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称            | 睿远成长价值混合型证券投资基金   |                 |
| 基金简称            | 睿远成长价值混合          |                 |
| 基金主代码           | 007119            |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                 |
| 基金合同生效日         | 2019年03月26日       |                 |
| 基金管理人           | 睿远基金管理有限公司        |                 |
| 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      | 5,966,922,234.45份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 睿远成长价值混合A         | 睿远成长价值混合C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 007119            | 007120          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,029,101,489.24份 | 937,820,745.21份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过对上市公司基本面全面、深入的研究分析，严选具有成长空间的上市公司股票进行价值投资，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产长期、持续、稳定的超额收益。   |
| 投资策略   | 本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，通过对宏观经济趋势、市场环境、财政政策、货币政策、行业周期阶段等的评估分析，研判国内经济发展形势，在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中各类资产的配置比例，从而实现本基金长期、持续、稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+上证国债指数收益率*20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差                               |

|  |           |
|--|-----------|
|  | 异带来的特有风险。 |
|--|-----------|

### 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      | 睿远基金管理有限公司            | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名                    | 李雁飞                    |
|         | 联系电话                  | 021-38173200           |
|         | 电子邮箱                  | liyf@foresightfund.com |
| 客户服务电话  | 4009201000            | 95555                  |
| 传真      | 021-38173001          | 0755-83195201          |
| 注册地址    | 上海市虹口区临潼路170号608室     | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 办公地址    | 上海市浦东新区芳甸路1155号42-43层 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 邮政编码    | 201204                | 518040                 |
| 法定代表人   | 陈光明                   | 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 | www.foresightfund.com            |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市浦东新区芳甸路1155号42-43层 睿远基金管理有限公司 |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                        |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 睿远基金管理有限公司 | 上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼42-43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03月26日(基金合同生效日)-2019年06月30日) |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 睿远成长价值混合A                             | 睿远成长价值混合C      |
| 本期已实现收益       | 2,997,568.53                          | -391,123.92    |
| 本期利润          | -65,977,486.73                        | -13,561,634.96 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0133                               | -0.0145        |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.38%                                | -1.50%         |
| 本期基金份额净值增长率   | -1.35%                                | -1.46%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年06月30日)                     |                |
| 期末可供分配利润      | -68,045,881.30                        | -13,661,930.19 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0135                               | -0.0146        |
| 期末基金资产净值      | 4,961,055,607.94                      | 924,158,815.02 |
| 期末基金份额净值      | 0.9865                                | 0.9854         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019年06月30日)                     |                |
| 基金份额累计净值增长率   | -1.35%                                | -1.46%         |

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、上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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、本基金的基金合同生效日为2019年3月26日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2019年6月30日数据，特此说明。

## 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

睿远成长价值混合A

| 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      | 3.91%    | 1.25%       | 3.72%      | 0.86%         | 0.19%  | 0.39% |
| 过去三个月      | -1.40%   | 1.16%       | -1.99%     | 1.07%         | 0.59%  | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.35%   | 1.12%       | -0.04%     | 1.08%         | -1.31% | 0.04% |

睿远成长价值混合C

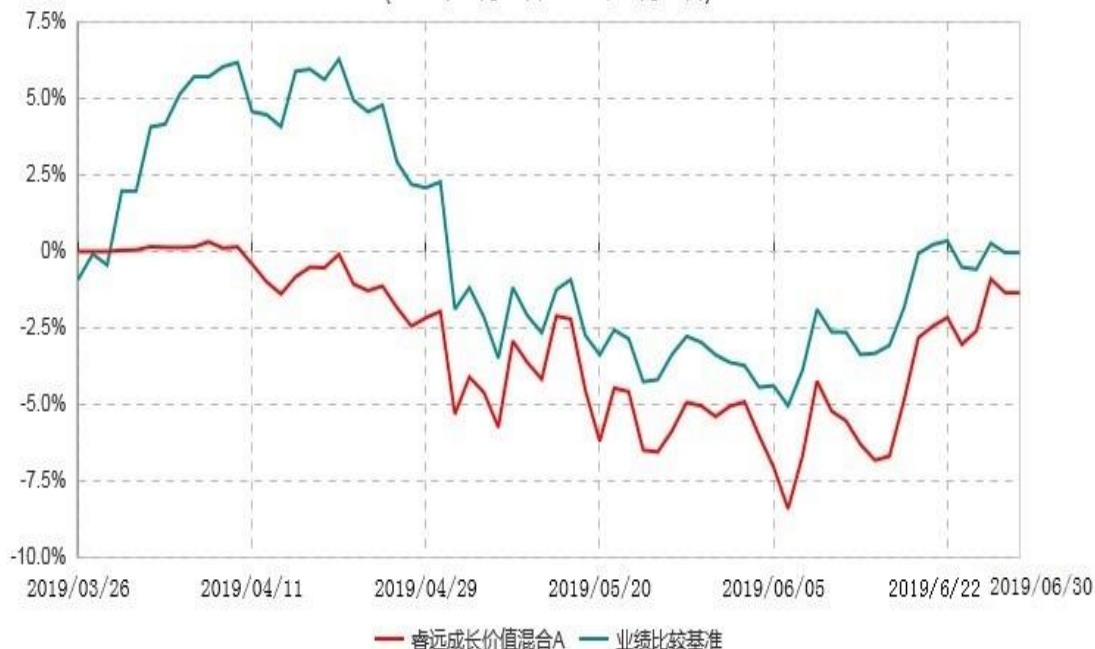
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 3.86%    | 1.25%       | 3.72%      | 0.86%         | 0.14%  | 0.39% |
| 过去三个月      | -1.50%   | 1.17%       | -1.99%     | 1.07%         | 0.49%  | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.46%   | 1.12%       | -0.04%     | 1.08%         | -1.42% | 0.04% |

## 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



睿远成长价值混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

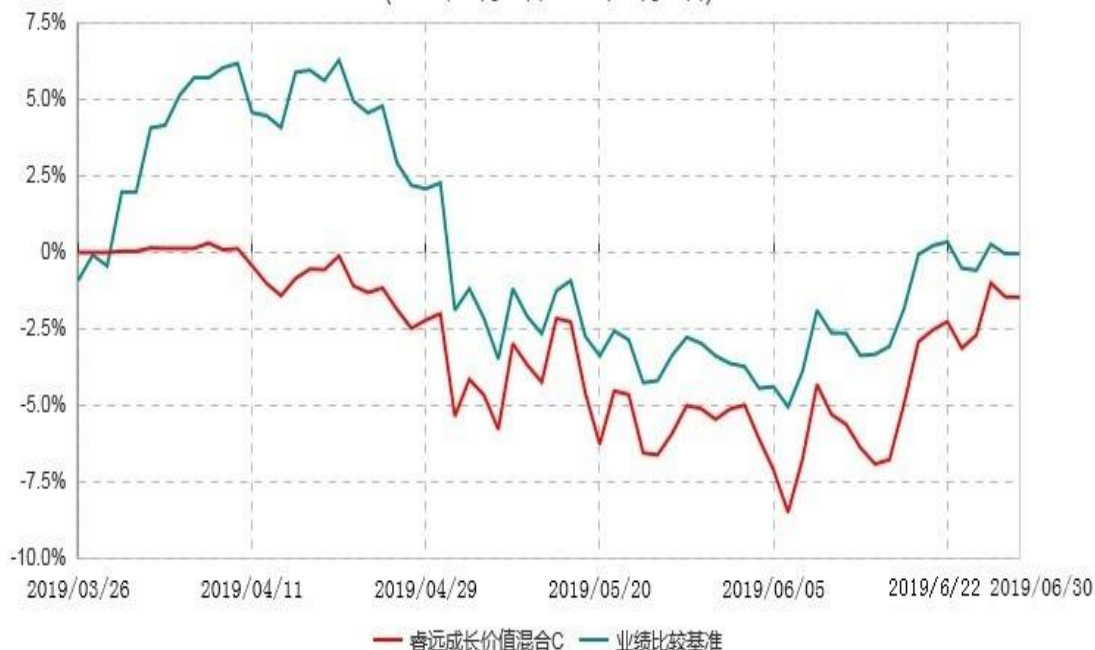
(2019年03月26日-2019年06月30日)



注：本基金合同生效之日为2019年3月26日，截至本报告期末，基金成立未满半年；本基金建仓期为本基金合同生效之日（2019年3月26日）起6个月。

睿远成长价值混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年03月26日-2019年06月30日)



注：本基金合同生效之日为2019年3月26日，截至本报告期末，基金成立未满半年；本基金建仓期为本基金合同生效之日（2019年3月26日）起6个月。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

睿远基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]1682号文批准，于2018年10月29日取得营业执照正式成立，并于2018年11月19日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司注册地上海，注册资本一亿元人民币。公司致力于成为领先的长期价值投资机构，追求持有人长期利益最大化。截至2019年6月30日，公司共管理一只公募基金，即睿远成长价值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 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|----------------|-----------------|------|--------|---|
|     |                | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 傅鹏博 | 公司副总经理、本基金基金经理 | 2019-03-26      | -    | 26年    | 傅鹏博先生，上海财经大学经济信息管理专业硕士。曾任万国证券公司投资银行部部门经理，申银万国证券股份有限公司企业融资部部门经理，东方证券股份有限公司资产管理部部门负责人，东方证券股份有限公司研究所首席策略师，汇添富基金管理有限公司首席策略师，兴全基金管理有限公司副总经理、总经理助理、研究部总监、基金经理等职。2018年10月至2019年1月， |

|    |         |            |   |     |   |
|----|---------|------------|---|-----|---|
|    |         |            |   |     | 任睿远基金管理有限公司董事长；2019年1月至今，任睿远基金管理有限公司副总经理。2019年3月至今任睿远成长价值混合型证券投资基金基金经理。   |
| 朱璘 | 本基金基金经理 | 2019-03-26 | - | 10年 | 朱璘先生，纽约州立大学金融专业硕士。曾任华谊集团化工设计研究院工程师，莫尼塔投资发展有限公司高级分析师，富安达基金管理有限公司高级分析师，兴全基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理，2018年10月加入睿远基金管理有限公司，2019年3月至今任睿远成长价值混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3、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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、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

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》，本基金管理人制定了《睿远基金管理有限公司公平交易管理办法（试行）》，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池、交易对手库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、事后分析评估、监察稽核和信息披露等手段确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和《睿远基金管理有限公司公平交易管理办法（试行）》，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

#### 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

本基金于2019年3月26日成立，2019年二季度A股市场走势先扬后抑。从风格指数来看，二季度小盘指数（申万）、中盘指数（申万）及大盘指数（申万）涨跌幅分别为-9.75%、-7.93%和0.18%，总体来看，大盘风格指数涨幅靠前，中小盘指数下跌较多。板块方面，按照申万一级行业分类，整体平均下跌5.75%，中位数下跌7.5%，板块表现出一定的分化，食品饮料、银行、建筑和家电板块等有绝对收益，其中食品饮料表现领涨于其它行业。

二季度，本基金逐渐提高仓位。从行业配置看，本基金在组合中配置了TMT，医药，化工，制造和光伏新能源等行业，板块配置相对均衡。从个股来看，主要配置了优质成长股，在产品运行过程中，本基金优先考虑企业成长空间和管理层执行力，在合理的估值水平内，调整和优化持仓结构。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末睿远成长价值混合A基金份额净值为0.9865元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.35%，同期业绩比较基准收益率为-0.04%；截至报告期末睿远成长价值混合C基金份额净值为0.9854元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.46%，同期业绩比较基准收益率为-0.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年国内外宏观环境，央行将保持稳健货币政策，适时适度进行逆周期调节，保持流动性合理充裕，市场利率水平合理稳定，并将稳定市场预期，保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。外围市场上，美联储降息后，全球多国也进入降息通道，而中美贸易摩擦预计还有反复。

目前整体估值水平方面，万得全A指数动态市盈率为17倍左右，整体和行业估值下滑。在结构分化的背景下，未来投资对自下而上、多角度的研究提出更高的要求。将中观和微观数据更好的结合，做好前瞻和深度的研究，这将成为获取超额收益的重要因素。在上市公司的半年度业绩披露期间，我们将对财务报表做详细解读，从中筛选出较快增长和财务扎实的公司。对于组合中个股，我们将对公司经营预判和中报数据的匹配度做检验，优化个股持仓。

下半年，本基金将紧密跟踪市场流动性、风险偏好等变量，密切关注边际上可能存在的积极变化，在风险可控的原则下，力争降低组合波动，为投资者带来合理的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017年9月5日《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### § 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，招商银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人复核审查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。

### § 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：睿远成长价值混合型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

| 资 产  | 附注号     | 本期末<br>2019年06月30日 |
|------|---------|--------------------|
| 资 产： |         |                    |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 169,265,311.50     |

|                 |            |                    |
|-----------------|------------|--------------------|
| 结算备付金           |            | -                  |
| 存出保证金           |            | -                  |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 5,071,322,711.63   |
| 其中：股票投资         |            | 4,754,166,394.83   |
| 基金投资            |            | -                  |
| 债券投资            |            | 317,156,316.80     |
| 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    | 673,000,000.00     |
| 应收证券清算款         |            | -                  |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 3,535,128.92       |
| 应收股利            |            | 3,617,748.54       |
| 应收申购款           |            | 24,746,837.46      |
| 递延所得税资产         |            | -                  |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                  |
| 资产总计            |            | 5,945,487,738.05   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | 本期末<br>2019年06月30日 |
| <b>负 债：</b>     |            |                    |
| 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         |            | 32,591,483.94      |
| 应付赎回款           |            | 19,703,604.16      |
| 应付管理人报酬         |            | 6,897,652.47       |
| 应付托管费           |            | 689,765.25         |
| 应付销售服务费         |            | 291,679.64         |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | -                  |
| 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  | 99,129.63        |
| 负债合计          |          | 60,273,315.09    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 5,966,922,234.45 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -81,707,811.49   |
| 所有者权益合计       |          | 5,885,214,422.96 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 5,945,487,738.05 |

注：(1) 报告截止日2019年6月30日，睿远成长价值混合A份额净值0.9865元，基金份额5,029,101,489.24份；睿远成长价值混合C份额净值0.9854元，基金份额937,820,745.21份。

(2) 本基金合同于2019年03月26日生效，上年度可比期间无比较数据，因此资产负债表只列示2019年6月30日数据，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：睿远成长价值混合型证券投资基金

本报告期：2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
|-------------------|----------|------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       |          | -46,343,365.83                     |
| 1. 利息收入           |          | 15,876,721.71                      |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11 | 7,511,351.18                       |
| 债券利息收入            |          | 1,946,813.55                       |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                  |
| 买入返售金融资产收入        |          | 6,418,556.98                       |
| 其他利息收入            |          | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 19,886,505.84                      |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12 | -17,059,094.08                     |



|                            |            |                |
|----------------------------|------------|----------------|
| 基金投资收益                     |            | -              |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13   | 1,904,180.73   |
| 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   | 35,041,419.19  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | -82,145,566.30 |
| 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   | 38,972.92      |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 33,195,755.86  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 22,471,856.42  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,247,185.66   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 951,373.74     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 7,464,011.35   |
| 5. 利息支出                    |            | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              |
| 6. 税金及附加                   |            | -              |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 61,328.69      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -79,539,121.69 |
| 减：所得税费用                    |            | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -79,539,121.69 |

注：本基金合同于2019年3月26日生效，上年度可比区间无比较数据，因此利润表只列示2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：睿远成长价值混合型证券投资基金

本报告期：2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                               |
|----|----------------------------------|
|    | 2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06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<br>(基金净值)                                    | 5,874,730,597.51 | -              | 5,874,730,597.51 |
| 二、本期经营活动产<br>生的基金净值变动<br>数(本期利润)                       | -                | -79,539,121.69 | -79,539,121.69   |
| 三、本期基金份额交<br>易产生的基金净值<br>变动数(净值减少以<br>“-”号填列)          | 92,191,636.94    | -2,168,689.80  | 90,022,947.14    |
| 其中: 1. 基金申购款   | 112,480,740.89   | -2,676,495.73  | 109,804,245.16   |
| 2. 基金赎回<br>款   | -20,289,103.95   | 507,805.93     | -19,781,298.02   |
| 四、本期向基金份额<br>持有人分配利润产<br>生的基金净值变动<br>(净值减少以“-”<br>号填列) | -                | -              | -                |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                    | 5,966,922,234.45 | -81,707,811.49 | 5,885,214,422.96 |

注:本基金合同于2019年3月26日生效,上年度可比区间无比较数据,因此所有者权益(基金净值)变动表只列示2019年3月26日(基金合同生效日)至2019年6月30日数据,特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

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:

陈光明

许志雄

廉洪舰

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

睿远成长价值混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由睿远基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《睿远成长价值混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,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[2019]343号文《关于准予睿远成长价值混合型证券投资基金注册的批复》核准。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集基金份额为5,874,730,597.51份,于2019年3月21日首发并募集结束。经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具上会师报字(2019)第1728号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年3月26日生效。本基金的基金管理人与注册登记机构均为睿远基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、权证、股指期货、国债期货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的相关规定。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。

本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%,投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的0-50%。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保证金以后,基金保留的现金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%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+上证国债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2019年6月30日的财务状况以及2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2019年3月26日（基金合同生效日）起至2019年6月30日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资和债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票及债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于交易日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于交易日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于交易日结转；

#### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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；

2、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；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。



在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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<br>2019年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 2,673,068.33       |
| 定期存款         | 100,000,000.00     |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  |
| 存款期限1-3个月    | 100,000,000.00     |
| 存款期限3个月以上    | -                  |
| 其他存款         | 66,592,243.17      |
| 合计           | 169,265,311.50     |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末2019年06月30日   |                  |                |
|---------------|-------|------------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 4,836,396,337.87 | 4,754,166,394.83 | -82,229,943.04 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 317,071,940.06   | 317,156,316.80   | 84,376.74      |
|               | 银行间市场 | -                | -                | -              |
|               | 合计    | 317,071,940.06   | 317,156,316.80   | 84,376.74      |
| 资产支持证券        |       | -                | -                | -              |
| 基金            |       | -                | -                | -              |
| 其他            |       | -                | -                | -              |
| 合计            |       | 5,153,468,277.93 | 5,071,322,711.63 | -82,145,566.30 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末2019年06月30日 |           |
|-------|----------------|-----------|
|       | 账面余额           | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 673,000,000.00 | -         |
| 银行间市场 | -              | -         |
| 合计    | 673,000,000.00 | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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<br>2019年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,210.73           |
| 应收定期存款利息   | 544,444.60         |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | -                  |
| 应收债券利息     | 2,977,723.09       |
| 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         | 11,750.50          |
| 合计         | 3,535,128.92       |

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用余额。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 38,720.94          |
| 预提费用-审计费    | 25,889.30          |
| 预提费用-信息披露费  | 34,519.39          |
| 合计          | 99,129.63          |

#### 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 睿远成长价值混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(睿远成长价值混合A) | 本期2019年03月26日(基金合同生效日)至2019年06月30日 |                  |
|-------------------|------------------------------------|------------------|
|                   | 基金份额(份)                            | 账面金额             |
| 基金合同生效日           | 4,941,294,456.79                   | 4,941,294,456.79 |
| 本期申购              | 103,699,908.40                     | 103,699,908.40   |
| 本期赎回(以“-”号填列)     | -15,892,875.95                     | -15,892,875.95   |
| 本期末               | 5,029,101,489.24                   | 5,029,101,489.24 |

## 6.4.7.9.2 睿远成长价值混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(睿远成长价值混合C) | 本期2019年03月26日(基金合同生效日)至2019年06月30日 |                |
|-------------------|------------------------------------|----------------|
|                   | 基金份额(份)                            | 账面金额           |
| 基金合同生效日           | 933,436,140.72                     | 933,436,140.72 |
| 本期申购              | 8,780,832.49                       | 8,780,832.49   |
| 本期赎回(以“-”号填列)     | -4,396,228.00                      | -4,396,228.00  |
| 本期末               | 937,820,745.21                     | 937,820,745.21 |

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2019年3月26日生效。设立时募集的扣除认购费后睿远成长价值混合A的实收基金(本金)为人民币4,941,294,456.79 元，折合4,941,294,456.79 份基金份额；设立时募集的扣除认购费后睿远成长价值混合C的实收基金(本金)为人民币933,436,140.72 元，折合933,436,140.72份基金份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 睿远成长价值混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(睿远成长价值混合A) | 已实现部分        | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|-------------------|--------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日           | -            | -              | -              |
| 本期利润              | 2,997,568.53 | -68,975,055.26 | -65,977,486.73 |

|                |              |                |                |
|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 13,581.84    | -2,081,976.41  | -2,068,394.57  |
| 其中：基金申购款       | 15,914.00    | -2,472,745.57  | -2,456,831.57  |
| 基金赎回款          | -2,332.16    | 390,769.16     | 388,437.00     |
| 本期已分配利润        | -            | -              | -              |
| 本期末            | 3,011,150.37 | -71,057,031.67 | -68,045,881.30 |

#### 6.4.7.10.2 睿远成长价值混合C

单位：人民币元

| 项目<br>(睿远成长价值混合C) | 已实现部分       | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|-------------------|-------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日           | -           | -              | -              |
| 本期利润              | -391,123.92 | -13,170,511.04 | -13,561,634.96 |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | -3,471.67   | -96,823.56     | -100,295.23    |
| 其中：基金申购款          | -6,981.04   | -212,683.12    | -219,664.16    |
| 基金赎回款             | 3,509.37    | 115,859.56     | 119,368.93     |
| 本期已分配利润           | -           | -              | -              |
| 本期末               | -394,595.59 | -13,267,334.60 | -13,661,930.19 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 651,551.92                         |
| 定期存款利息收入  | 6,206,250.16                       |
| 其他存款利息收入  | -                                  |
| 结算备付金利息收入 | -                                  |
| 其他        | 653,549.10                         |
| 合计        | 7,511,351.18                       |

注：其中“其他”为保证金利息收入。

## 6.4.7.12 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03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 999,398,077.11                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,016,457,171.19                 |
| 买卖股票差价收入   | -17,059,094.08                   |

## 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03月26日（基金合同生效日）至2019年06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 | 1,904,180.73                     |
| 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                            | 1,904,180.73                     |

## 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03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,043,051,795.75                 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,010,495,910.27                 |
| 减：应收利息总额                | 30,651,704.75                    |
| 买卖债券差价收入                | 1,904,180.73                     |



### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：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

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：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<br>2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
|-------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 35,041,419.19                          |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                      |
| 合计          | 35,041,419.19                          |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
|------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | -82,145,566.30                         |
| ——股票投资     | -82,229,943.04                         |
| ——债券投资     | 84,376.74                              |
| ——资产支持证券投资 | -                                      |
| ——基金投资     | -                                      |
| ——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                     | -82,145,566.30 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 38,972.92                              |
| 合计      | 38,972.92                              |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 7,464,011.35                           |
| 银行间市场交易费用 | -                                      |
| 合计        | 7,464,011.35                           |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
|-------|--|
| 审计费用  | 25,889.30                              |
| 信息披露费 | 34,519.39                              |
| 汇划手续费 | 920.00                                 |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 61,328.69 |
|----|-----------|

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露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

本基金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             |
|--------------------|---------------------|
| 睿远基金管理有限公司（“睿远基金”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |

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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：本基金本报告期未发生应付关联方佣金。

**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03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 22,471,856.42                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 8,154,057.25                     |

注：本基金的管理费按前一日资产净值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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               |
|----------------|----------------------------------|
|                | 2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,247,185.66                     |

注：本基金的托管费按前一日资产净值0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

**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**

注：本基金本报告期未发生与关联方的银行间同业市场债券（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**

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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<br>2019年03月26日（基金合同生效日）至2019年06月30日 |            |
|------------|--|------------|
|            | 期末余额                                   | 当期利息收入     |
| 招商银行股份有限公司 | 2,673,068.33                           | 651,551.92 |
| 招商银行-定期存款  | 100,000,000.00                         | 544,444.60 |

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金报告期末在承销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

注：本基金报告期末未发生其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

注：本基金报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019年06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 |
| 300788               | 中信出版 | 2019-06-27 | 2019-07-05 | 新股     | 14.85 | 14.85  | 3,833    | 56,920.05    | 56,920.05    | -  |
| 601236               | 红塔证券 | 2019-06-26 | 2019-07-05 | 新股     | 3.46  | 3.46   | 9,789    | 33,869.94    | 33,869.94    | -  |
| 300326               | 凯利   | 2019-0     | 2019-      | 大宗     | 10.60 | 8.67   | 461,200  | 4,888,720.00 | 3,998,604.00 | -  |

|        | 泰    | 4-01       | 10-08      | 交易   |       |       |           |                |                |   |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|-----------|----------------|----------------|---|
| 300326 | 凯利泰  | 2019-04-08 | 2019-10-08 | 大宗交易 | 10.60 | 8.67  | 6,000,000 | 63,600,000.00  | 52,020,000.00  | - |
| 300558 | 贝达药业 | 2019-04-18 | 2019-10-18 | 大宗交易 | 39.00 | 39.36 | 1,000,000 | 39,000,000.00  | 39,360,000.00  | - |
| 300285 | 国瓷材料 | 2019-04-23 | 2019-10-23 | 大宗交易 | 15.38 | 15.98 | 8,633,410 | 132,781,845.80 | 137,961,891.80 | - |
| 300558 | 贝达药业 | 2019-05-16 | 2019-11-18 | 大宗交易 | 37.70 | 38.96 | 500,000   | 18,850,000.00  | 19,480,000.00  | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌流通受限股票。

#### 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，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 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

本基金金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了“董事会及其下设风险控制委员会-经营层及其下设风险管理委员会-风险管理部-各业务部门及一线合规风控人员”的四级风险管理的职责架构。董事会负责督促、检查、评价公司风险管理工作，并对公司风险管理的有效性承担最终责任；公司经营管理层负责领导经营管理中风险管理工作的落实；部门层面设置了风险管理部作为独立的风险管理部门，全面推动风险管理工作，监测、评估、报告公司的整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门的风险管理工作；其他各部门及一线合规风控人员对其业务中涉及的风险管理负直接责任，直接参与相关业务的风险管理工作。

##### 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，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，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的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，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 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<br>2019年06月30日 |
|--------|--------------------|
| A-1    | -                  |
| A-1以下  | -                  |
| 未评级    | 189,722,100.80     |
| 合计     | 189,722,100.80     |

注：未评级债券为国债。

#### 6.4.13.2.2 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<br>2019年06月30日 |
|--------|--------------------|
| AAA    | -                  |
| AAA以下  | -                  |
| 未评级    | 127,434,216.00     |
| 合计     | 127,434,216.00     |

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 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于开放日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于每个开放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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注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，其余均能及时变现。

#### 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部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上市公司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）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，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6.4.12。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会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。

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为利率债、银行存款、存出保证金及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年<br>06月30<br>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                       | 169,265,311.50 | -     | -              | -    | -    | -                | 169,265,311.50   |
| 交易性金融资产                    | -              | -     | 317,156,316.80 | -    | -    | 4,754,166,394.83 | 5,071,322,711.63 |
| 买入返售金融资产                   | 673,000,000.00 | -     | -              | -    | -    | -                | 673,000,000.00   |
| 应收利息                       | -              | -     | -              | -    | -    | 3,535,128.92     | 3,535,128.92     |
| 应收股利                       | -              | -     | -              | -    | -    | 3,617,748.54     | 3,617,748.54     |
| 应收申购款                      | -              | -     | -              | -    | -    | 24,746,837.46    | 24,746,837.46    |
| 资产总计                       | 842,265,311.50 | -     | 317,156,316.80 | -    | -    | 4,786,066,109.70 | 5,945,487,738.00 |

|                 |                    |   |                    |   |   |                      |                      |
|-----------------|--------------------|---|--------------------|---|---|----------------------|----------------------|
| 计               | 0                  |   | 0                  |   |   | 5                    | 5                    |
| 负债              |                    |   |                    |   |   |                      |                      |
| 应付证<br>券清算<br>款 | -                  | - | -                  | - | - | 32,591,483.94        | 32,591,483.94        |
| 应付赎<br>回款       | -                  | - | -                  | - | - | 19,703,604.16        | 19,703,604.16        |
| 应付管<br>理人报<br>酬 | -                  | - | -                  | - | - | 6,897,652.47         | 6,897,652.47         |
| 应付托<br>管费       | -                  | - | -                  | - | - | 689,765.25           | 689,765.25           |
| 应付销<br>售服务<br>费 | -                  | - | -                  | - | - | 291,679.64           | 291,679.64           |
| 其他负<br>债        | -                  | - | -                  | - | - | 99,129.63            | 99,129.63            |
| 负债总<br>计        | -                  | - | -                  | - | - | 60,273,315.09        | 60,273,315.09        |
| 利率敏<br>感度缺<br>口 | 842,265,311.5<br>0 | - | 317,156,316.8<br>0 | - | - | 4,725,792,794.6<br>6 | 5,885,214,422.9<br>6 |

#### 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<br>2019年06月30日          |
|    | 市场利率下降100个基点       | 2,095,819.89                |
|    | 市场利率上升100个基点       | -2,068,508.88               |

注： 1、上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于2019年3月26日生效。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年06月30日  |                |                       |                |
|---------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------------|
|               | 美元<br>折合<br>人民币     | 港币折合人民币        | 其他<br>币种<br>折合<br>人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                     |                |                       |                |
| 交易性金融资产       | -                   | 807,600,348.00 | -                     | 807,600,348.00 |
| 应收股利          | -                   | 3,617,748.54   | -                     | 3,617,748.54   |
| 资产合计          | -                   | 811,218,096.54 | -                     | 811,218,096.54 |
| 以外币计价的负债      |                     |                |                       |                |
| 应付证券清算款       | -                   | 32,591,483.94  | -                     | 32,591,483.94  |
| 负债合计          | -                   | 32,591,483.94  | -                     | 32,591,483.94  |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                   | 778,626,612.60 | -                     | 778,626,612.60 |
| 项目            | 上年度末<br>2019年03月26日 |                |                       |                |
|               | 美元<br>折合<br>人民币     | 港币折合人民币        | 其他<br>币种<br>折合<br>人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                     |                |                       |                |
| 资产合计          | -                   | -              | -                     | -              |
| 以外币计价的负债      |                     |                |                       |                |
| 负债合计          | -                   | -              | -                     | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                   | -              | -                     | -              |

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                  |
|----|------------------|
| 假设 | 除外汇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<br>2019年06月30日          |
|    | 港币相对人民币升值5% | 40,380,017.40               |
|    | 港币相对人民币贬值5% | -40,380,017.40              |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 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<br>2019年06月30日 |              |
|---------------|--------------------|--------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 4,754,166,394.83   | 80.78        |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -            |
| 交易性金融资产—债券投资  | 317,156,316.80     | 5.39         |
| 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            | 5,071,322,711.63   | 86.17        |

##### 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<br>2019年06月30日          |
|    | “沪深300”指数上升5% | 231,379,683.83              |
|    | “沪深300”指数下降5% | -231,379,683.83             |

注：1、本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于2019年3月26日生效。

#### 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              | 4,754,166,394.83 | 79.96         |
|    | 其中：股票             | 4,754,166,394.83 | 79.96         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 317,156,316.80   | 5.33          |
|    | 其中：债券             | 317,156,316.80   | 5.33          |
|    | 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          | 673,000,000.00   | 11.32         |
|    | 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      | 169,265,311.50   | 2.85          |
| 8  | 其他各项资产            | 31,899,714.92    | 0.54          |

|   |    |                  |        |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 5,945,487,738.05 | 100.00 |
|---|----|------------------|--------|

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币807,600,348.00元，占期末净值比例13.72%。

## 7.2 报告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

| 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              | 363,438.35       | 0.01         |
| C  | 制造业              | 3,818,895,815.28 | 64.89        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 30,850,480.00    | 0.52         |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,597,500.00     | 0.03         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 39,603.76        | 0.00         |
| J  | 金融业              | 2,640,889.94     | 0.04         |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 49,842,639.45    | 0.85         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 42,278,760.00    | 0.72         |
| 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        | 56,920.05        | 0.00         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 3,946,566,046.83 | 67.06        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值(人民币)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----------|----------------|--------------|
| 基础材料     | 32,501,700.00  | 0.55         |
| 非日常生活消费品 | 32,357,690.00  | 0.55         |
| 日常消费品    | 209,834,790.00 | 3.57         |
| 信息技术     | 474,470,433.00 | 8.06         |
| 公用事业     | 935,680.00     | 0.02         |
| 地产业      | 57,500,055.00  | 0.98         |
| 合计       | 807,600,348.00 | 13.72        |

### 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(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 002475 | 立讯精密    | 20,219,724 | 501,246,957.96 | 8.52         |
| 2  | 002422 | 科伦药业    | 16,179,000 | 481,001,670.00 | 8.17         |
| 3  | 002271 | 东方雨虹    | 18,264,145 | 413,865,525.70 | 7.03         |
| 4  | 601012 | 隆基股份    | 17,819,090 | 411,799,169.90 | 7.00         |
| 5  | H00700 | 腾讯控股    | 1,032,900  | 320,374,593.00 | 5.44         |
| 6  | 002001 | 新和成     | 16,400,000 | 316,356,000.00 | 5.38         |
| 7  | 600309 | 万华化学    | 7,359,444  | 314,910,608.76 | 5.35         |
| 8  | H01112 | H&H国际控股 | 5,379,000  | 209,834,790.00 | 3.57         |
| 9  | 002180 | 纳思达     | 8,924,993  | 201,704,841.80 | 3.43         |
| 10 | 300285 | 国瓷材料    | 11,478,589 | 186,358,386.59 | 3.17         |
| 11 | 600519 | 贵州茅台    | 164,115    | 161,489,160.00 | 2.74         |
| 12 | 300326 | 凯利泰     | 17,973,847 | 160,208,059.35 | 2.72         |

|    |        |       |            |                |      |
|----|--------|-------|------------|----------------|------|
| 13 | H00968 | 信义光能  | 45,456,000 | 154,095,840.00 | 2.62 |
| 14 | 600438 | 通威股份  | 8,953,999  | 125,893,225.94 | 2.14 |
| 15 | 300558 | 贝达药业  | 2,501,403  | 100,398,224.50 | 1.71 |
| 16 | 000661 | 长春高新  | 259,000    | 87,542,000.00  | 1.49 |
| 17 | 601877 | 正泰电器  | 3,289,852  | 75,962,682.68  | 1.29 |
| 18 | H06098 | 碧桂园服务 | 3,489,000  | 55,440,210.00  | 0.94 |
| 19 | 300124 | 汇川技术  | 2,399,237  | 54,966,519.67  | 0.93 |
| 20 | 300207 | 欣旺达   | 4,170,268  | 48,041,487.36  | 0.82 |
| 21 | 600138 | 中青旅   | 3,782,405  | 47,998,719.45  | 0.82 |
| 22 | 300012 | 华测检测  | 3,914,700  | 42,278,760.00  | 0.72 |
| 23 | 600201 | 生物股份  | 2,301,990  | 36,118,223.10  | 0.61 |
| 24 | H03323 | 中国建材  | 5,390,000  | 32,501,700.00  | 0.55 |
| 25 | 603181 | 皇马科技  | 2,136,980  | 31,734,153.00  | 0.54 |
| 26 | 600031 | 三一重工  | 2,289,200  | 29,942,736.00  | 0.51 |
| 27 | H00839 | 中教控股  | 2,778,000  | 29,807,940.00  | 0.51 |
| 28 | 600323 | 瀚蓝环境  | 1,745,500  | 29,464,040.00  | 0.50 |
| 29 | 603043 | 广州酒家  | 678,693    | 21,942,144.69  | 0.37 |
| 30 | 002955 | 鸿合科技  | 343,100    | 20,188,004.00  | 0.34 |
| 31 | 600887 | 伊利股份  | 427,000    | 14,266,070.00  | 0.24 |
| 32 | 000858 | 五粮液   | 69,000     | 8,138,550.00   | 0.14 |
| 33 | 600867 | 通化东宝  | 410,400    | 6,320,160.00   | 0.11 |
| 34 | 603228 | 景旺电子  | 121,400    | 4,857,214.00   | 0.08 |
| 35 | H00175 | 吉利汽车  | 217,000    | 2,549,750.00   | 0.04 |
| 36 | H00960 | 龙湖集团  | 79,500     | 2,059,845.00   | 0.04 |
| 37 | 601888 | 中国国旅  | 20,800     | 1,843,920.00   | 0.03 |
| 38 | 000001 | 平安银行  | 120,000    | 1,653,600.00   | 0.03 |
| 39 | 600557 | 康缘药业  | 108,700    | 1,615,282.00   | 0.03 |
| 40 | 601021 | 春秋航空  | 35,500     | 1,597,500.00   | 0.03 |
| 41 | 002039 | 黔源电力  | 101,200    | 1,386,440.00   | 0.02 |
| 42 | 601128 | 常熟银行  | 123,500    | 953,420.00     | 0.02 |



|    |        |              |         |            |      |
|----|--------|--------------|---------|------------|------|
| 43 | H01071 | 华电国际<br>电力股份 | 344,000 | 935,680.00 | 0.02 |
| 44 | 600104 | 上汽集团         | 35,400  | 902,700.00 | 0.02 |
| 45 | 002179 | 中航光电         | 16,250  | 543,725.00 | 0.01 |
| 46 | 002415 | 海康威视         | 14,700  | 405,426.00 | 0.01 |
| 47 | 600968 | 海油发展         | 102,377 | 363,438.35 | 0.01 |
| 48 | 300782 | 卓胜微          | 743     | 80,927.56  | 0.00 |
| 49 | 300788 | 中信出版         | 3,833   | 56,920.05  | 0.00 |
| 50 | 601698 | 中国卫通         | 10,103  | 39,603.76  | 0.00 |
| 51 | 603863 | 松炆资源         | 1,612   | 37,204.96  | 0.00 |
| 52 | 601236 | 红塔证券         | 9,789   | 33,869.94  | 0.00 |
| 53 | 300594 | 朗进科技         | 721     | 31,803.31  | 0.00 |
| 54 | 603867 | 新化股份         | 1,045   | 26,971.45  | 0.00 |

#### 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末基金资产净值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       | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------------|----------------|----------------|
| 1  | 002475 | 立讯精密       | 654,765,936.89 | 11.13          |
| 2  | 002422 | 科伦药业       | 523,155,784.99 | 8.89           |
| 3  | 600309 | 万华化学       | 475,450,294.12 | 8.08           |
| 4  | 601012 | 隆基股份       | 422,445,604.06 | 7.18           |
| 5  | 002271 | 东方雨虹       | 420,929,290.81 | 7.15           |
| 6  | 002001 | 新和成        | 359,625,838.50 | 6.11           |
| 7  | 000661 | 长春高新       | 341,178,227.84 | 5.80           |
| 8  | H00700 | 腾讯控股       | 338,566,504.86 | 5.75           |
| 9  | 002180 | 纳思达        | 281,376,389.27 | 4.78           |
| 10 | H01112 | H & H 国际控股 | 218,006,809.81 | 3.70           |
| 11 | 600519 | 贵州茅台       | 194,910,584.36 | 3.31           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 12 | 300326 | 凯利泰  | 193,282,276.17 | 3.28 |
| 13 | 300285 | 国瓷材料 | 188,794,044.46 | 3.21 |
| 14 | H00968 | 信义光能 | 165,255,998.57 | 2.81 |
| 15 | 600438 | 通威股份 | 134,701,054.79 | 2.29 |
| 16 | 300558 | 贝达药业 | 108,393,041.00 | 1.84 |
| 17 | 601877 | 正泰电器 | 93,866,201.79  | 1.59 |
| 18 | 300124 | 汇川技术 | 89,752,509.00  | 1.53 |
| 19 | 002415 | 海康威视 | 61,249,463.00  | 1.04 |
| 20 | 300207 | 欣旺达  | 61,217,366.46  | 1.04 |

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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       | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 000661 | 长春高新 | 272,096,554.56 | 4.62           |
| 2  | 600309 | 万华化学 | 145,239,566.33 | 2.47           |
| 3  | 002475 | 立讯精密 | 116,049,289.09 | 1.97           |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 59,012,049.90  | 1.00           |
| 5  | 002180 | 纳思达  | 58,190,426.10  | 0.99           |
| 6  | 002415 | 海康威视 | 56,640,082.13  | 0.96           |
| 7  | 600426 | 华鲁恒升 | 44,149,837.42  | 0.75           |
| 8  | 601012 | 隆基股份 | 26,529,102.40  | 0.45           |
| 9  | 002271 | 东方雨虹 | 26,185,953.00  | 0.44           |
| 10 | 603228 | 景旺电子 | 25,572,668.51  | 0.43           |
| 11 | 002422 | 科伦药业 | 22,043,291.38  | 0.37           |
| 12 | 300124 | 汇川技术 | 21,770,804.85  | 0.37           |
| 13 | 002001 | 新和成  | 20,716,541.12  | 0.35           |
| 14 | 601877 | 正泰电器 | 14,422,409.00  | 0.25           |
| 15 | 300285 | 国瓷材料 | 12,460,063.00  | 0.21           |
| 16 | 603043 | 广州酒家 | 10,630,997.90  | 0.18           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 300558 | 贝达药业 | 9,788,806.00 | 0.17 |
| 18 | H03323 | 中国建材 | 8,020,960.53 | 0.14 |
| 19 | 300012 | 华测检测 | 7,708,734.00 | 0.13 |
| 20 | 600887 | 伊利股份 | 6,944,002.00 | 0.12 |

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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 | 5,852,853,509.06 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 999,398,077.11   |

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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      | 189,722,100.80 | 3.22         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 127,434,216.00 | 2.17         |
|    | 其中：政策性金融债 | 127,434,216.00 | 2.17         |
| 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        | 317,156,316.80 | 5.39         |

#### 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 |
|----|------|------|-------|------|-------|
|----|------|------|-------|------|-------|

|   |        |        |           |                    | 产净<br>值比<br>例(%) |
|---|--------|--------|-----------|--------------------|------------------|
| 1 | 019611 | 19国债01 | 1,898,740 | 189,722,100.8<br>0 | 3.22             |
| 2 | 108602 | 国开1704 | 1,261,600 | 127,434,216.0<br>0 | 2.17             |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 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

注：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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1

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

##### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 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   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | 3,617,748.54  |
| 4  | 应收利息    | 3,535,128.92  |
| 5  | 应收申购款   | 24,746,837.46 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 31,899,714.92 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|---------------|----------|
| 1  | 300285 | 国瓷材料 | 137,961,891.80 | 2.34          | 大宗交易流通受限 |

注：根据《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采用大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%；前款交易的受让方在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

## § 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

| 份额级别 | 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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
|-------------------|---------|------------|----------------|------------|------------------|------------|
| 睿远成<br>长价值<br>混合A | 402,236 | 12,502.86  | 95,217,777.77  | 1.89%      | 4,933,883,711.47 | 98.11%     |
| 睿远成<br>长价值<br>混合C | 7,135   | 131,439.49 | 22,780,000.00  | 2.43%      | 915,040,745.21   | 97.57%     |
| 合计                | 409,371 | 14,575.83  | 117,997,777.77 | 1.98%      | 5,848,924,456.68 | 98.02%     |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别          | 持有份额总数<br>(份) | 占基金总份额比<br>例 |
|----------------------|---------------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持<br>有本基金 | 睿远成长价值<br>混合A | 145,606.98    | 0.00%        |
|                      | 睿远成长价值<br>混合C | 23,563,966.62 | 2.51%        |
|                      | 合计            | 23,709,573.60 | 0.40%        |

注：基金管理人的从业人员持有睿远成长价值混合A占基金总份额比例实际为0.003%。

## 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情况

| 项目                                     | 份额级别          | 持有基金份额总量的数量区<br>间（万份） |
|--|---------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资<br>和研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 睿远成长价值混合<br>A | 0                     |
|  | 睿远成长价值混合<br>C | >100                  |
|  | 合计            | >100                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 睿远成长价值混合<br>A | 0-10                  |
|  | 睿远成长价值混合<br>C | 0                     |
|  | 合计            | 0-10                  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 睿远成长价值混合A        | 睿远成长价值混合C      |
|----------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2019年03月26日)基金份额总额 | 4,941,294,456.79 | 933,436,140.72 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 103,699,908.40   | 8,780,832.49   |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | 15,892,875.95    | 4,396,228.00   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额     | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 5,029,101,489.24 | 937,820,745.21 |

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期被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

1、基金管理人于2019年1月12日公告，傅鹏博先生担任公司副总经理，不再担任公司董事长职务。

2、基金管理人于2019年1月12日公告，刘桂芳女士担任公司董事长并代行督察长职责，代行期限不超过6个月。

3、基金管理人于2019年1月21日公告，许志雄先生担任公司副总经理。

4、本报告期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

本报告期内基金投资策略无变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是上会会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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监管部门的稽查或处罚。

### 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 |    |
| 中信证券 | 2      | 6,835,972,693.65 | 100.00%      | 5,470,392.48 | 100.00%    | -  |

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

#### 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 |              | 基金交易 |              |
|------|------------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 中信证券 | 1,592,772,922.37 | 100.00%      | 44,188,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

### 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  | 睿远基金成长价值混合型证券投资基金基金合同  | 上海证券报，公司网站 | 2019-03-15 |
| 2  | 睿远基金成长价值混合型证券投资基金招募说明书 | 上海证券报，公司网站 | 2019-03-15 |



|    |                                      |             |            |
|----|--------------------------------------|-------------|------------|
| 3  | 睿远基金成长价值混合型证券投资基金发售公告                | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-15 |
| 4  | 睿远基金成长价值混合型证券投资基金合同内容摘要              | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-15 |
| 5  | 关于增加睿远成长价值混合型证券投资基金代理销售机构的公告         | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-16 |
| 6  | 关于增加睿远成长价值混合型证券投资基金代理销售机构的公告         | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-19 |
| 7  | 关于增加睿远成长价值混合型证券投资基金代理销售机构的公告         | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-20 |
| 8  | 关于增加睿远成长价值混合型证券投资基金代理销售机构的公告         | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-21 |
| 9  | 关于睿远成长价值混合型证券投资基金提前结束募集的公告           | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-22 |
| 10 | 关于睿远成长价值混合型证券投资基金A类份额认购申请确认比例的公告     | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-23 |
| 11 | 睿远成长价值混合型证券投资基金基金合同生效公告              | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-27 |
| 12 | 关于睿远成长价值混合型证券投资基金基金合同生效公告的补正说明公告     | 上海证券报, 公司网站 | 2019-03-28 |
| 13 | 关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告           | 上海证券报, 公司网站 | 2019-04-16 |
| 14 | 关于睿远成长价值混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及限制 | 上海证券报, 公司网站 | 2019-06-19 |

|    |  |             |            |
|----|--|-------------|------------|
|    | 大额申购业务的公告                                      |             |            |
| 15 | 睿远成长价值混合型证券投资基金2019年非港股通交易日暂停申购、赎回等交易类业务的公告    | 上海证券报, 公司网站 | 2019-06-19 |
| 16 | 关于增加睿远成长价值混合型证券投资基金代理销售机构的公告                   | 上海证券报, 公司网站 | 2019-06-19 |
| 17 | 睿远基金管理有限公司关于睿远成长价值混合型证券投资基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告 | 上海证券报, 公司网站 | 2019-06-21 |

## § 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

注：本报告期内本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 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、中国证监会批准睿远成长价值混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《睿远成长价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《睿远成长价值混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《睿远成长价值混合型证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内睿远成长价值混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼42-43层 睿远基金管理有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.foresightfund.com](http://www.foresightfund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-920-1000 查询相关信息。

睿远基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十四日