

中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资 基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 日

§ 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。

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、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中银证券健康产业混合
场内简称	-
基金主代码	002938
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 7 日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
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	99,796,417.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极把握健康产业主题相关行业的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过大类资产配置策略、个股优选策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	50%*中证医药卫生指数收益率+50%*中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银国际证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵向雷	张燕
	联系电话	021-20328000	0755-83199084
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-61195566, 400-620-8888	95555
传真		021-50372474	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§ 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	10,364,494.75
本期利润	19,103,472.00
加权平均基金份额本期利润	0.1791
本期基金份额净值增长率	20.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0790
期末基金资产净值	94,946,844.58
期末基金份额净值	0.9514

注: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。

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。

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,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

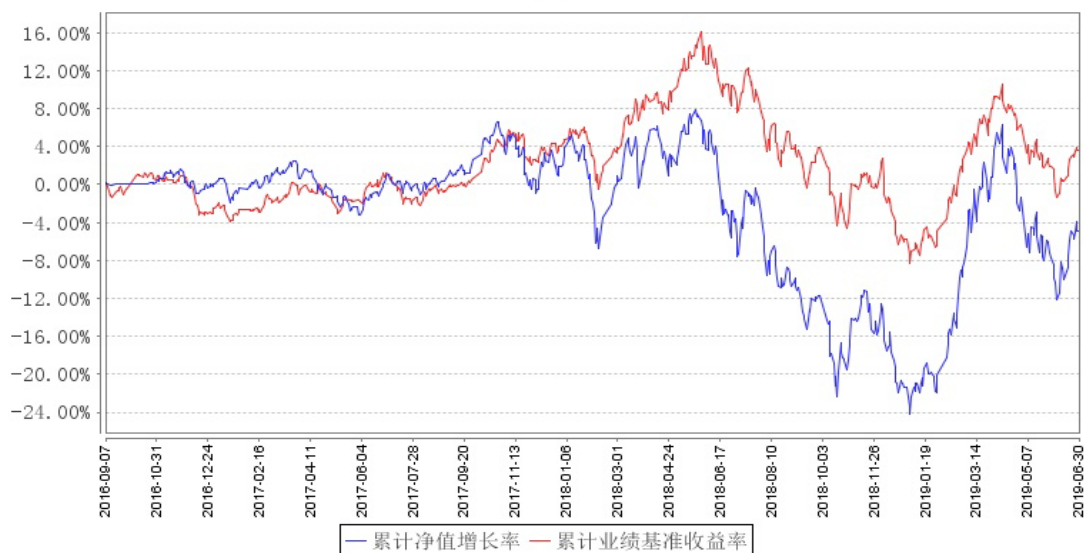
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.20%	1.35%	1.68%	0.67%	1.52%	0.68%
过去三个月	-5.55%	1.58%	-4.07%	0.80%	-1.48%	0.78%
过去六个月	20.97%	1.57%	10.01%	0.85%	10.96%	0.72%
过去一年	-2.14%	1.49%	-6.11%	0.88%	3.97%	0.61%
自基金合同生效起至今	-4.86%	1.05%	3.66%	0.67%	-8.52%	0.38%

注:本基金成立于2016年9月7日,本基金的业绩比较基准为:50%*中证医药卫生指数收益率+50%*中证全债指数收益率。

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

中银证券健康产业混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金基金合同于 2016 年 9 月 7 日生效。

§ 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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 25 亿元人民币。股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、凯瑞富海实业投资有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝乾企业管理中心(有限合伙)、江西铜业集团财务有限公司、达濠市政建设有限公司、万兴投资发展有限公司。中银国际证券的经营经营范围包括:证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销、融资融券、代销金融产品、公开募集证券投资基金管理业务、为期货公司提供中间介绍业务。截至 2019 年 6 月 30 日,本管理人共管理十七只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券

投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金。

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		
罗众球	本基金基金经理	2016年9月7日	-	9	罗众球，中国药科大学药学硕士，通过美国特许金融分析师二级考试(CFA II)。2009年至2010年任职于复星医药药品研发部；2010年至2012年任职于恒泰证券，担任医药行业研究员；2012年至2013年8月任职于宏源证券资产管理分公司，担任医药行业研究员。2013年8月加盟中银国际证券股份有限公司，历任中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券保本1号混合型证券投资基金基金经理，现任中国红稳定价值、中国红稳健增长、中国红1号集合资产管理计划投资主办人、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张燕	本基金基金经理	2018年1月31日	2019年2月11日	7	张燕，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2011年7月至2015年5月任职新华基金管理有限公司。

				司研究部,担任基金经理助理兼研究员;2015年5月至2016年11月任职中欧基金管理有限公司事业部策略十组,担任基金经理;2016年11月至2017年10月任职中国人寿养老保险股份有限公司投资中心,担任高级权益投资经理。2017年10月加盟中银国际证券股份有限公司,历任中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--

注:1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规,建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，上证指数上涨 19.45%，创业板指数上涨 20.87%。上半年 A 股市场整体先扬后抑，投资者情绪回暖。一季度市场在流动性改善和贸易战缓和的情况下，市场出现普涨行情。二季度的市场调整主要由于一系列的政策的预先调整加上贸易摩擦，降低了市场的风险偏好。货币政策操作出现边际收紧迹象，央行一季度货币政策例会表态对宏观经济增长信心加强，并重提“管好货币政策总闸门”，股指期货的放开进一步显示监管层走市场化的决心，劳动节后中美贸易的不确定性进一步加剧了市场情绪的放大。

报告期内，本基金投资主要以健康医药产业为主，5G 领域，细分领域上，主要集中在疫苗、OTC、血液制品等受医保控费政策影响较小的细分领域。

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 0.9514 元；本报告期基金份额净值增长率为 20.97%，业绩比较基准收益率为 10.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体来看，市场目前风险收益比呈中性，展望下半年，预计下一轮行情展开的契机应在于中美贸易摩擦落地、改革预期的强化、以及对经济和盈利的悲观修复预期。下半年中美贸易战的不确定性是影响市场的主导因素，目前来看，预计市场未来一段时间依然处在休整的状态，震荡磨底概率较大，但三四季度行情重新走强的基础依然存在：1) 市场整体估值处于低位；2) 去杠杆的阵痛暂时过去，减税降费等利多还在发酵；3) 库存周期和产能周期将逐步开始同时上行，整体来看下半年行情值得期待。

目前本基金投资方向上主要以健康医药产业为主，细分领域上，主要集中在疫苗、OTC、血液

制品等受医保控费政策影响较小的细分领域，目前优质专科仿制药已经有较好的估值性价比，预计未来有政策和估值修复行情。

我们将在健康产业中继续发挥专业投资的优势，灵活调整仓位并且持续优化配置，审慎投资、勤勉尽责、兢兢业业持续为基金持有人创造价值，谋求长期、稳定的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任组长，成员由基金事业部、业务营运部、内控与法律合规部、审计部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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

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/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/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：中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		9,687,018.72	10,322,737.60
结算备付金		516,704.73	486,784.52
存出保证金		108,437.21	61,535.25
交易性金融资产		83,050,274.48	81,090,803.03
其中：股票投资		83,050,274.48	81,090,803.03
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,815,644.85	-
应收利息		2,130.65	1,870.24
应收股利		-	-
应收申购款		395.85	1,773.39
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		95,180,606.49	91,965,504.03
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	2,660,145.90
应付赎回款		42.98	23,300.40
应付管理人报酬		113,271.55	117,970.27
应付托管费		15,102.89	15,729.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		36,061.73	69,661.78
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		69,282.76	150,000.00
负债合计		233,761.91	3,036,807.73
所有者权益：			
实收基金		99,796,417.49	113,063,079.85
未分配利润		-4,849,572.91	-24,134,383.55
所有者权益合计		94,946,844.58	88,928,696.30
负债和所有者权益总计		95,180,606.49	91,965,504.03

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9514 元，基金份额总额 99,796,417.49 份。

6.2 利润表

会计主体：中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	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
一、收入		20,775,601.91	-1,472,058.90
1. 利息收入		40,516.13	156,034.53
其中：存款利息收入		40,516.13	156,034.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,967,018.96	7,016,994.20
其中：股票投资收益		11,570,494.14	6,374,858.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益		-	-
股利收益		396,524.82	642,135.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		8,738,977.25	-8,714,838.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		29,089.57	69,751.16
减：二、费用		1,672,129.91	1,965,787.59
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	725,956.84	1,164,485.11
2. 托管费	6.4.8.2.2	96,794.32	155,264.65
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		757,336.81	547,685.71
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		92,041.94	98,352.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,103,472.00	-3,437,846.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,103,472.00	-3,437,846.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	113,063,079.85	-24,134,383.55	88,928,696.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,103,472.00	19,103,472.00
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）	-13,266,662.36	181,338.64	-13,085,323.72
其中：1. 基金申购款	6,386,118.19	-167,103.69	6,219,014.50

2. 基金赎回款	-19,652,780.55	348,442.33	-19,304,338.22
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）	99,796,417.49	-4,849,572.91	94,946,844.58
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）	199,378,393.11	3,775,581.03	203,153,974.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,437,846.49	-3,437,846.49
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）	-80,927,012.95	-3,631,444.05	-84,558,457.00
其中：1. 基金申购款	2,358,879.95	45,941.55	2,404,821.50
2. 基金赎回款	-83,285,892.90	-3,677,385.60	-86,963,278.50
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）	118,451,380.16	-3,293,709.51	115,157,670.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

宁敏

沈锋

戴景义

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

中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金(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]1288 号文《关于准予中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券健康产业灵活配置混合型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 560,845,462.27 元,已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1170 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 561,008,147.28 份基金份额,其中认购资金利息折合 162,685.01 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券健康产业灵活配置混合型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(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%,其中投资于基金合同界定的健康产业主题相关证券不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准:50%×中证医药卫生指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券有限责任公司于 2018 年 8 月 28 日批准报出。

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》、《中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列式的中国证监会、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。

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 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间不存在需要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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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无。

6.4.7.2 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
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中银证券	566,355,828.29	100.00	394,260,110.53	100.00

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	414,214.64	100.00	36,061.73	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银证券	288,322.19	100.00	32,652.43	100.00

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	725,956.84	1,164,485.11
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人中银国际证券有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年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	96,794.32	155,264.65

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

注:本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期及上年度可比期间本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

6.4.8.4.2 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:本基金本报告期末及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年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
招商银行股份有限公司	9,687,018.72	35,429.44	11,641,997.01	153,399.30
招商银行股份有限公司	9,687,018.72	35,429.44	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项需要说明。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 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	83,050,274.48	87.26
	其中：股票	83,050,274.48	87.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,203,723.45	10.72
-	-	-	-
8	其他各项资产	1,926,608.56	2.02
9	合计	95,180,606.49	100.00

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

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	4,139,272.60	4.36
C	制造业	56,408,796.95	59.41
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	10,211,867.85	10.76

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	4,394,366.48	4.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,088,500.00	1.15
L	租赁和商务服务业	4,036,304.00	4.25
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	2,771,166.60	2.92
S	综合	-	-
	合计	83,050,274.48	87.47

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期无港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000063	中兴通讯	246,684	8,024,630.52	8.45
2	300142	沃森生物	188,200	5,337,352.00	5.62
3	600085	同仁堂	183,587	5,324,023.00	5.61
4	002332	仙琚制药	692,800	4,683,328.00	4.93
5	603605	珀莱雅	68,200	4,513,476.00	4.75
6	600718	东软集团	340,200	4,361,364.00	4.59
7	600267	海正药业	435,600	4,356,000.00	4.59
8	000963	华东医药	163,080	4,233,556.80	4.46
9	600976	健民集团	252,645	4,166,116.05	4.39
10	600285	羚锐制药	492,685	4,153,334.55	4.37

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	002343	慈文传媒	10,516,791.80	11.83
2	000796	凯撒旅游	9,024,906.99	10.15
3	000063	中兴通讯	8,389,211.00	9.43
4	002589	瑞康医药	7,818,714.79	8.79

5	002332	仙琚制药	7,467,035.00	8.40
6	600351	亚宝药业	6,816,791.00	7.67
7	603605	珀莱雅	6,499,392.25	7.31
8	002683	宏大爆破	6,234,024.00	7.01
9	002019	亿帆医药	5,835,885.00	6.56
10	000963	华东医药	5,671,982.00	6.38
11	300523	辰安科技	5,511,144.00	6.20
12	002007	华兰生物	5,474,378.41	6.16
13	600138	中青旅	5,428,537.09	6.10
14	300005	探路者	5,426,107.00	6.10
15	600781	辅仁药业	5,402,673.00	6.08
16	002735	王子新材	5,147,422.00	5.79
17	002821	凯莱英	5,120,570.00	5.76
18	600718	东软集团	4,857,444.00	5.46
19	002001	新和成	4,754,774.46	5.35
20	600161	天坛生物	4,727,342.70	5.32
21	300142	沃森生物	4,528,026.13	5.09
22	002022	科华生物	4,517,571.00	5.08
23	603883	老百姓	4,412,315.00	4.96
24	002696	百洋股份	3,806,733.00	4.28
25	000568	泸州老窖	3,663,424.00	4.12
26	600267	海正药业	3,635,539.00	4.09
27	000538	云南白药	3,590,636.00	4.04
28	002462	嘉事堂	3,584,975.06	4.03
29	002396	星网锐捷	3,535,571.00	3.98
30	600467	好当家	3,527,370.00	3.97
31	002262	恩华药业	3,355,260.00	3.77
32	000423	东阿阿胶	3,354,363.00	3.77
33	603589	口子窖	3,270,136.00	3.68
34	600521	华海药业	3,195,562.00	3.59
35	002422	科伦药业	2,875,391.00	3.23
36	300136	信维通信	2,524,103.00	2.84
37	600466	蓝光发展	2,517,435.00	2.83
38	600085	同仁堂	2,260,000.00	2.54
39	601788	光大证券	2,233,623.00	2.51
40	000403	振兴生化	2,225,562.00	2.50
41	600976	健民集团	2,209,171.00	2.48
42	600062	华润双鹤	2,193,698.00	2.47
43	600664	哈药股份	2,181,321.16	2.45
44	603323	苏农银行	2,146,274.00	2.41
45	300613	富瀚微	2,104,706.00	2.37
46	300123	亚光科技	2,083,058.00	2.34

47	000566	海南海药	2,045,249.00	2.30
48	600422	昆药集团	2,033,806.00	2.29
49	000623	吉林敖东	1,996,905.00	2.25
50	002793	东音股份	1,905,372.00	2.14
51	002138	顺络电子	1,905,002.00	2.14
52	300427	红相股份	1,903,139.00	2.14
53	300310	宜通世纪	1,891,648.00	2.13
54	600079	人福医药	1,882,483.00	2.12
55	300360	炬华科技	1,877,349.00	2.11
56	603639	海利尔	1,869,151.20	2.10
57	300033	同花顺	1,858,909.00	2.09
58	002726	龙大肉食	1,851,705.00	2.08
59	002384	东山精密	1,845,495.00	2.08
60	002415	海康威视	1,822,512.00	2.05
61	300129	泰胜风能	1,794,300.00	2.02

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600466	蓝光发展	12,363,864.67	13.90
2	002589	瑞康医药	11,144,271.84	12.53
3	002821	凯莱英	9,389,849.67	10.56
4	000063	中兴通讯	8,683,849.88	9.76
5	002422	科伦药业	8,434,887.88	9.49
6	002007	华兰生物	6,770,616.65	7.61
7	600161	天坛生物	6,640,793.50	7.47
8	002343	慈文传媒	6,091,318.91	6.85
9	000796	凯撒旅游	5,884,409.65	6.62
10	300129	泰胜风能	5,746,584.00	6.46
11	002022	科华生物	5,575,249.38	6.27
12	603883	老百姓	5,092,020.20	5.73
13	300523	辰安科技	4,915,044.60	5.53
14	300005	探路者	4,753,767.31	5.35
15	600138	中青旅	4,497,482.28	5.06
16	002390	信邦制药	4,450,829.00	5.00
17	002462	嘉事堂	4,318,628.90	4.86
18	300142	沃森生物	4,304,194.89	4.84
19	002735	王子新材	4,204,250.62	4.73
20	002696	百洋股份	4,153,045.00	4.67
21	000661	长春高新	4,056,502.73	4.56
22	600781	辅仁药业	4,017,584.00	4.52
23	600467	好当家	3,965,213.91	4.46

24	600436	片仔癀	3,943,830.94	4.43
25	002382	蓝帆医疗	3,793,562.00	4.27
26	000423	东阿阿胶	3,717,057.66	4.18
27	000568	泸州老窖	3,692,659.00	4.15
28	002396	星网锐捷	3,652,414.00	4.11
29	000538	云南白药	3,644,066.00	4.10
30	300326	凯利泰	3,592,669.62	4.04
31	002675	东诚药业	3,591,013.62	4.04
32	002262	恩华药业	3,441,386.00	3.87
33	002001	新和成	3,398,894.00	3.82
34	603589	口子窖	3,391,984.00	3.81
35	600351	亚宝药业	3,355,434.18	3.77
36	600976	健民集团	3,259,153.06	3.66
37	002332	仙琚制药	2,785,397.32	3.13
38	300310	宜通世纪	2,768,580.00	3.11
39	600422	昆药集团	2,730,959.47	3.07
40	603127	昭衍新药	2,599,460.20	2.92
41	300136	信维通信	2,581,556.30	2.90
42	603605	珀莱雅	2,466,022.00	2.77
43	600664	哈药股份	2,271,882.00	2.55
44	600521	华海药业	2,267,793.00	2.55
45	000403	振兴生化	2,259,977.40	2.54
46	600062	华润双鹤	2,245,009.00	2.52
47	600085	同仁堂	2,183,612.66	2.46
48	300123	亚光科技	2,180,440.00	2.45
49	601788	光大证券	2,177,106.00	2.45
50	300033	同花顺	2,155,551.00	2.42
51	600285	羚锐制药	2,091,475.04	2.35
52	603323	苏农银行	2,084,666.00	2.34
53	002683	宏大爆破	2,023,961.00	2.28
54	000623	吉林敖东	2,020,194.00	2.27
55	002138	顺络电子	1,982,240.00	2.23
56	600525	长园集团	1,952,581.06	2.20
57	300360	炬华科技	1,948,718.00	2.19
58	000566	海南海药	1,947,625.00	2.19
59	300613	富瀚微	1,938,869.00	2.18
60	002019	亿帆医药	1,933,118.80	2.17
61	002793	东音股份	1,917,800.00	2.16
62	002415	海康威视	1,881,680.00	2.12
63	300595	欧普康视	1,792,265.60	2.02
64	000590	启迪古汉	1,782,254.00	2.00

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	274,529,292.86
卖出股票收入（成交）总额	292,879,292.80

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，但对于 ETF，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本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

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

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

本报告编制日前一年以内，本基金持有的“沃森生物”的发行主体云南沃森生物技术股份有限公司于 2018 年 12 月 5 日收到中国证券监督管理委员会云南证监局出具的行政监管措施决定书《云南证监局关于对云南沃森生物技术股份有限公司及李云春、姜润生、张荔、周华采取出具警示函措施的决定》（〔2018〕16 号），公司因“未对河北大安制药有限公司采浆量是否达标等事项及其对 2017 年全年业绩的影响进行充分的会计估计，导致你公司于 2018 年 1 月 13 日披露业绩预告修正公告，将 2017 年 11 月 2 日披露的 2017 年度业绩预告中预计的 2017 年归属于上市公司股东的净利润从盈利 3,000 万元至 5,100 万元修正为亏损 53,350 万元至 53,850 万元，出现盈亏反转且金额差异巨大”、“山东实杰生物科技股份有限公司第二期股权转让款逾期付款未披露”和“公司大股东未披露股权质押情况”等违法违规行为，云南证监局对公司采取出具警示函的监督管理措施。本基金持有的“海正药业”的发行主体浙江海正药业股份有限公司于 2018 年 11 月 29 日收到上海证券交易所出具的纪律处分决定书《关于对浙江海正药业股份有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定》（〔2018〕67 号），公司因“未经决策擅自修改重要子公司合资合同的重要条款，且未及时披露”、“未按规定披露重大日常经营合同相关内容”和“隐瞒影响处置收益确认的回购权等合资合同重要条款”等违法违规行为，上海证券交易所对公司予以通报批评并记入上市公司诚信档案的纪律处分。

本基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、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中，不存在投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	108,437.21
2	应收证券清算款	1,815,644.85
3	应收股利	-

4	应收利息	2,130.65
5	应收申购款	395.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	1,926,608.56

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
9,281	10,752.77	3,576,262.74	3.58	96,220,154.75	96.42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,703.62	0.01

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年9月7日)基金份额总额	561,008,147.28
本报告期期初基金份额总额	113,063,079.85
本报告期基金总申购份额	6,386,118.19

减：本报告期基金总赎回份额	19,652,780.55
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	99,796,417.49

§ 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

中银国际证券股份有限公司董事会秘书翟增军先生担任公司公募基金管理业务副总经理，熊文龙先生不再担任公司副执行总裁。

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

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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

未有管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
中银证券	2	566,355,828.29	100.00%	414,214.64	100.00%	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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
中银证券	-	-	-	-	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20190612-20190630	20,007,400.00	0.00	0.00	20,007,400.00	20.05
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

中银国际证券股份有限公司

2019 年 8 月 26 日