
东方创新科技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：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十七日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方创新科技混合
基金主代码	001702
前端交易代码	001702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 8 日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,899,119.11 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在大类资产配置基础上精选个股，严格控制投资风险，追求基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总全价指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理有限责任公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	田青
	联系电话	010-66295888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	010-67595096
传真		010-66578700	010-66275853

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	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

§ 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	2,112,763.80
本期利润	5,952,495.94
加权平均基金份额本期利润	0.1226
本期基金份额净值增长率	21.87%
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	-0.2524
期末基金资产净值	55,043,920.48
期末基金份额净值	0.8107

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

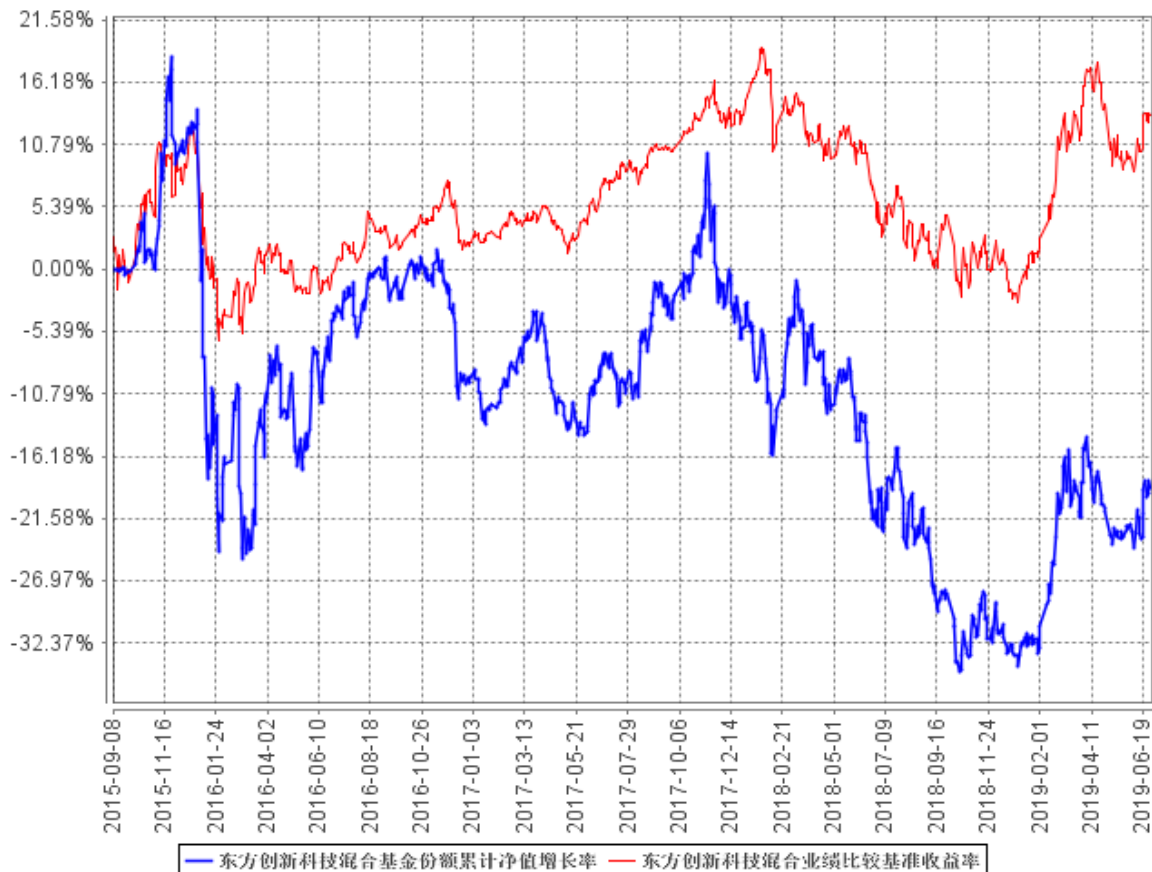
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.19%	1.38%	3.43%	0.68%	0.76%	0.70%
过去三个月	-0.64%	1.22%	-0.76%	0.90%	0.12%	0.32%
过去六个月	21.87%	1.43%	15.71%	0.92%	6.16%	0.51%
过去一年	0.14%	1.46%	7.18%	0.91%	-7.04%	0.55%
过去三年	-15.65%	1.30%	13.50%	0.66%	-29.15%	0.64%
自基金合同生效起至今	-18.93%	1.58%	13.33%	0.77%	-32.26%	0.81%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方创新科技混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

		任职日期	离任日期	业年限	
郭瑞（先生）	本基金基金经理	2016 年 12 月 27 日	-	8 年	中国科学院研究生院概率论与数理统计硕士，8 年证券从业经历，曾任中国移动通信集团公司项目经理、宏源证券股份有限公司北京资产管理分公司高级研究员、润晖投资咨询（北京）有限公司高级研究员。2015 年 8 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部研究员、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理助理、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于 2018 年 1 月 17 日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年一季度 A 股市场开始了一波较为明显的反弹，二季度震荡调整。2019 年上半年，上证指数上涨了 19.45%，深圳成指上涨了 26.78%，创业板指上涨了 20.87%，沪深 300 上涨了 27.07%。个股和行业进一步分化，食品饮料、家电、非银等行业表现较好，传媒、轻工、钢铁等行业表现较差。

我们继续坚持本产品的运作思路，在科技创新等相关领域中寻找优质成长标的进行长期研究和投资。

年初我们适时增加了仓位，并在 4 月份降低仓位，有效的避免了净值的回撤。

个股操作上，一季度，主要增持了启明星辰、中国国航、洲明科技、紫光国微、光大证券等个股，减持了利亚德、欧菲光、华宇软件、海格通信等个股。二季度，主要增持了海康威视、中航光电、国电南瑞、洲明科技、中兴通讯、立讯精密等个股，减持了启明星辰、中国国航、海能达、光大证券等个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日，本基金净值增长率为 21.87%，业绩比较基准收益率为 15.71%，高于业绩比较基准 6.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场经历了一季度的明显上涨，二季度的震荡调整，进入三季度，市场将更为关注上市公司中报情况。目前市场预期三季度宏观经济有望见底回升，流动性阶段性持续宽松。随着科创板开板，我们认为科技将成为阶段性的市场主线。我们认为市场在三季度将呈现震荡上行的趋势。

从操作策略上，我们将保持绝对收益的思维，继续精选个股，选择市场竞争格局好，行业发展较快，竞争力强，业绩增长较快，估值合理的个股进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

1. 委员会主任

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

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据

以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

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

4. 风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况。截至报告期末，本基金基金资产净值已达到五千万元以上。

§ 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，中国建设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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：东方创新科技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	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	9,744,198.16	11,232,521.16
结算备付金	661,155.33	125,666.16
存出保证金	64,905.58	15,793.01
交易性金融资产	48,682,407.10	14,957,680.00
其中：股票投资	48,682,407.10	14,957,680.00
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	431,370.04	3,142,406.18
应收利息	2,607.43	2,616.44
应收股利	-	-
应收申购款	8,773.09	57,910.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	59,595,416.73	29,534,593.32
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019 年 6 月 30 日	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	3,679,460.02	-
应付赎回款	111,357.06	80,465.11
应付管理人报酬	45,447.07	37,835.79
应付托管费	7,574.50	6,305.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	514,203.53	99,198.64

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	193,454.07	224,539.98
负债合计	4,551,496.25	448,345.45
所有者权益：		
实收基金	67,899,119.11	43,727,411.00
未分配利润	-12,855,198.63	-14,641,163.13
所有者权益合计	55,043,920.48	29,086,247.87
负债和所有者权益总计	59,595,416.73	29,534,593.32

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8107 元，基金份额总额 67,899,119.11 份。

6.2 利润表

会计主体：东方创新科技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	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	7,063,703.81	-5,345,775.02
1.利息收入	62,200.23	30,895.03
其中：存款利息收入	48,241.20	29,061.38
债券利息收入	106.60	3.93
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,852.43	1,829.72
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,033,545.42	-2,946,698.10
其中：股票投资收益	2,930,861.19	-3,118,826.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,391.67	-1,844.15
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	99,292.56	173,972.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,839,732.14	-2,591,118.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	128,226.02	161,146.23
减：二、费用	1,111,207.87	553,772.19

1. 管理人报酬	277,695.03	323,653.09
2. 托管费	46,282.48	53,942.14
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	715,816.22	117,226.01
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	0.02
7. 其他费用	71,414.14	58,950.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,952,495.94	-5,899,547.21
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,952,495.94	-5,899,547.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方创新科技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）	43,727,411.00	-14,641,163.13	29,086,247.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,952,495.94	5,952,495.94
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）	24,171,708.11	-4,166,531.44	20,005,176.67
其中：1.基金申购款	64,714,980.81	-12,962,424.96	51,752,555.85
2.基金赎回款	-40,543,272.70	8,795,893.52	-31,747,379.18
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）	67,899,119.11	-12,855,198.63	55,043,920.48

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)	52,458,923.65	-2,647,805.33	49,811,118.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,899,547.21	-5,899,547.21
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)	-7,938,452.02	71,645.61	-7,866,806.41
其中：1.基金申购款	27,945,444.18	-2,215,910.90	25,729,533.28
2.基金赎回款	-35,883,896.20	2,287,556.51	-33,596,339.69
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)	44,520,471.63	-8,475,706.93	36,044,764.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方创新科技混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 7 月 7 日中国证监会《关于准予东方创新科技混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1533 号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》自 2015 年 8 月 6 日至 2015 年 9 月 2 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 223,128,706.98 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2015]第 01300061 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 223,239,423.25 份基金单位，其中认购资金利息折合

110,716.27 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

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

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

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

税。

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

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

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

6.4.7 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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 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
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
渤海期货股份有限公司	本基金管理人股东（东北证券股份有限公司）控股公司

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
东北证券股份有限公司	264,068,725.85	55.34%	7,257,418.00	9.86%

6.4.8.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东北证券股份有限公司	1,202,576.09	48.10%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 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
东北证券股份有 限公司	246,737.15	55.23%	253,495.94	49.30%
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
东北证券股份有 限公司	6,758.79	9.86%	6,758.79	9.86%

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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

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	277,695.03	323,653.09

其中：支付销售机构的客户维护费	95,793.97	117,688.94
-----------------	-----------	------------

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计算，具体计算方法如下：

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

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,282.48	53,942.14

注：①计提标准：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提，具体计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

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

6.4.8.4 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 9 月 8 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,559,374.75	-
期间申购/买入总份额	-	1,559,374.75
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,559,374.75	1,559,374.75
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.30%	3.50%

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

6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2019 年 6 月 30 日		2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
渤海期货股份有限公司	24,911,559.54	36.6900%	-	-

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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	9,744,198.16	45,148.16	8,228,894.47	28,324.89

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，未在承销期内参与关联方承销的证券。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 28 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.9.3 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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	48,682,407.10	81.69
	其中：股票	48,682,407.10	81.69
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	10,405,353.49	17.46
8	其他各项资产	507,656.14	0.85
9	合计	59,595,416.73	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,385.20	0.04
C	制造业	32,924,047.41	59.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,118,750.00	2.03
E	建筑业	989,334.00	1.80
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,079,523.80	14.68
J	金融业	3,067,556.94	5.57
K	房地产业	1,599,299.00	2.91
L	租赁和商务服务业	882,510.75	1.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,682,407.10	88.44

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	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	110,300	3,042,074.00	5.53
2	002179	中航光电	89,500	2,994,670.00	5.44
3	600406	国电南瑞	117,800	2,195,792.00	3.99
4	300232	洲明科技	202,900	1,964,072.00	3.57
5	000063	中兴通讯	60,100	1,955,053.00	3.55
6	002475	立讯精密	77,300	1,916,267.00	3.48
7	000333	美的集团	32,300	1,675,078.00	3.04
8	600837	海通证券	116,300	1,650,297.00	3.00
9	603986	兆易创新	19,000	1,647,300.00	2.99
10	002230	科大讯飞	49,200	1,635,408.00	2.97

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	000002	万科A	7,186,883.03	24.71
2	000063	中兴通讯	5,961,073.00	20.49
3	002415	海康威视	5,842,635.50	20.09
4	300232	洲明科技	5,589,747.00	19.22
5	000333	美的集团	5,556,586.00	19.10
6	002179	中航光电	5,405,836.15	18.59
7	002583	海能达	5,355,517.19	18.41
8	600745	闻泰科技	4,860,038.07	16.71
9	601398	工商银行	4,764,512.00	16.38
10	600837	海通证券	4,756,661.00	16.35

11	002475	立讯精密	4,672,378.99	16.06
12	002049	紫光国微	4,569,962.00	15.71
13	002439	启明星辰	4,270,518.00	14.68
14	601318	中国平安	4,255,218.00	14.63
15	600900	长江电力	3,495,463.00	12.02
16	601888	中国国旅	3,457,848.25	11.89
17	600887	伊利股份	3,398,750.28	11.69
18	600406	国电南瑞	3,384,419.00	11.64
19	002456	欧菲光	3,088,724.00	10.62
20	600845	宝信软件	2,984,289.00	10.26
21	603019	中科曙光	2,958,780.17	10.17
22	603986	兆易创新	2,944,010.00	10.12
23	603160	汇顶科技	2,731,131.00	9.39
24	300136	信维通信	2,609,773.00	8.97
25	002230	科大讯飞	2,584,471.79	8.89
26	600271	航天信息	2,531,966.00	8.71
27	600030	中信证券	2,385,262.00	8.20
28	600588	用友网络	2,361,964.20	8.12
29	600703	三安光电	2,312,652.11	7.95
30	002036	联创电子	2,230,553.00	7.67
31	601933	永辉超市	2,225,462.00	7.65
32	000001	平安银行	2,151,957.94	7.40
33	002371	北方华创	2,147,865.94	7.38
34	002714	牧原股份	2,088,789.54	7.18
35	300015	爱尔眼科	2,007,978.00	6.90
36	002384	东山精密	1,993,227.00	6.85
37	300602	飞荣达	1,988,913.00	6.84
38	002146	荣盛发展	1,985,409.00	6.83
39	600309	万华化学	1,984,448.00	6.82
40	600570	恒生电子	1,979,980.00	6.81
41	002138	顺络电子	1,892,643.00	6.51
42	002375	亚厦股份	1,790,375.00	6.16
43	000625	长安汽车	1,783,428.55	6.13
44	002938	鹏鼎控股	1,767,255.00	6.08
45	601688	华泰证券	1,758,790.00	6.05
46	000977	浪潮信息	1,742,066.54	5.99

47	002396	星网锐捷	1,688,907.00	5.81
48	000858	五粮液	1,676,965.00	5.77
49	601111	中国国航	1,676,274.00	5.76
50	601988	中国银行	1,573,538.00	5.41
51	300252	金信诺	1,571,413.00	5.40
52	300271	华宇软件	1,527,232.00	5.25
53	300747	锐科激光	1,400,719.36	4.82
54	002268	卫士通	1,390,745.00	4.78
55	600201	生物股份	1,382,884.40	4.75
56	002008	大族激光	1,379,710.00	4.74
57	002241	歌尔股份	1,287,651.00	4.43
58	300166	东方国信	1,273,871.52	4.38
59	300408	三环集团	1,268,071.00	4.36
60	300498	温氏股份	1,205,401.00	4.14
61	300223	北京君正	1,187,374.22	4.08
62	002368	太极股份	1,177,557.00	4.05
63	600519	贵州茅台	1,148,831.00	3.95
64	002916	深南电路	1,138,463.00	3.91
65	002405	四维图新	1,125,314.16	3.87
66	300251	光线传媒	1,110,173.00	3.82
67	300383	光环新网	1,100,455.00	3.78
68	002013	中航机电	1,087,247.00	3.74
69	300604	长川科技	1,086,173.00	3.73
70	600600	青岛啤酒	1,081,924.00	3.72
71	601788	光大证券	1,080,858.00	3.72
72	603096	新经典	1,070,978.00	3.68
73	002449	国星光电	1,064,990.00	3.66
74	300133	华策影视	1,061,535.00	3.65
75	601006	大秦铁路	1,055,909.00	3.63
76	600390	五矿资本	1,010,888.00	3.48
77	002572	索菲亚	999,829.00	3.44
78	002920	德赛西威	997,628.14	3.43
79	000980	众泰汽车	985,976.00	3.39
80	000970	中科三环	975,390.00	3.35
81	601186	中国铁建	957,986.00	3.29
82	600183	生益科技	956,000.00	3.29

83	002594	比亚迪	939,871.00	3.23
84	600511	国药股份	921,769.00	3.17
85	600131	岷江水电	892,779.00	3.07
86	600125	铁龙物流	888,329.00	3.05
87	300348	长亮科技	880,458.00	3.03
88	300219	鸿利智汇	879,597.00	3.02
89	600528	中铁工业	872,337.00	3.00
90	601601	中国太保	858,756.00	2.95
91	300098	高新兴	855,272.00	2.94
92	300476	胜宏科技	822,057.02	2.83
93	600132	重庆啤酒	796,818.00	2.74
94	300253	卫宁健康	776,290.00	2.67
95	002796	世嘉科技	765,701.00	2.63
96	600999	招商证券	765,203.00	2.63
97	000895	双汇发展	764,759.00	2.63
98	601162	天风证券	762,512.00	2.62
99	603678	火炬电子	755,194.50	2.60
100	000998	隆平高科	749,828.00	2.58
101	000831	五矿稀土	745,190.00	2.56
102	600062	华润双鹤	744,592.00	2.56
103	603043	广州酒家	739,595.00	2.54
104	000725	京东方 A	739,232.00	2.54
105	600048	保利地产	733,359.00	2.52
106	000776	广发证券	728,933.00	2.51
107	600196	复星医药	724,049.00	2.49
108	600466	蓝光发展	723,146.00	2.49
109	300009	安科生物	713,363.00	2.45
110	603833	欧派家居	708,755.00	2.44
111	300183	东软载波	697,635.00	2.40
112	000933	神火股份	687,200.00	2.36
113	600728	佳都科技	682,731.80	2.35
114	603259	药明康德	673,284.00	2.31
115	600373	中文传媒	665,909.00	2.29
116	601319	中国人保	622,440.00	2.14
117	600584	长电科技	618,709.00	2.13
118	002185	华天科技	605,693.00	2.08

119	002555	三七互娱	599,158.00	2.06
-----	--------	------	------------	------

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	5,721,499.20	19.67
2	601398	工商银行	4,719,775.00	16.23
3	002583	海能达	4,715,593.00	16.21
4	002415	海康威视	4,636,534.72	15.94
5	000333	美的集团	4,389,213.00	15.09
6	600745	闻泰科技	4,187,853.13	14.40
7	002456	欧菲光	4,175,871.08	14.36
8	000063	中兴通讯	4,114,387.50	14.15
9	601318	中国平安	4,074,154.80	14.01
10	300232	洲明科技	3,751,680.80	12.90
11	603019	中科曙光	3,589,060.00	12.34
12	600837	海通证券	3,367,920.38	11.58
13	002049	紫光国微	3,326,436.98	11.44
14	600887	伊利股份	3,206,467.00	11.02
15	002439	启明星辰	2,909,554.00	10.00
16	600845	宝信软件	2,897,685.00	9.96
17	002475	立讯精密	2,692,786.84	9.26
18	601888	中国国旅	2,652,178.18	9.12
19	603160	汇顶科技	2,512,622.70	8.64
20	600703	三安光电	2,495,026.17	8.58
21	002179	中航光电	2,471,516.07	8.50
22	300271	华宇软件	2,444,572.28	8.40
23	600030	中信证券	2,431,386.00	8.36
24	300602	飞荣达	2,420,672.00	8.32
25	600900	长江电力	2,408,278.70	8.28
26	601933	永辉超市	2,291,131.71	7.88
27	002036	联创电子	2,280,743.37	7.84
28	600570	恒生电子	2,277,463.94	7.83
29	000001	平安银行	2,189,684.00	7.53

30	002146	荣盛发展	2,112,071.66	7.26
31	002714	牧原股份	2,084,554.92	7.17
32	300015	爱尔眼科	1,988,553.92	6.84
33	002371	北方华创	1,931,265.97	6.64
34	002938	鹏鼎控股	1,891,945.53	6.50
35	600309	万华化学	1,833,280.00	6.30
36	002230	科大讯飞	1,800,061.54	6.19
37	000625	长安汽车	1,784,279.32	6.13
38	000977	浪潮信息	1,761,751.00	6.06
39	601111	中国国航	1,758,018.00	6.04
40	300136	信维通信	1,716,795.00	5.90
41	300252	金信诺	1,691,702.58	5.82
42	603096	新经典	1,689,513.00	5.81
43	000858	五粮液	1,662,449.00	5.72
44	300383	光环新网	1,630,140.00	5.60
45	601988	中国银行	1,596,727.00	5.49
46	002405	四维图新	1,590,282.24	5.47
47	600373	中文传媒	1,504,480.00	5.17
48	002384	东山精密	1,433,940.00	4.93
49	002368	太极股份	1,419,608.02	4.88
50	600201	生物股份	1,417,746.50	4.87
51	600588	用友网络	1,376,780.00	4.73
52	002465	海格通信	1,368,924.00	4.71
53	603986	兆易创新	1,368,592.76	4.71
54	300408	三环集团	1,280,161.00	4.40
55	300166	东方国信	1,279,900.00	4.40
56	600271	航天信息	1,277,818.00	4.39
57	600406	国电南瑞	1,251,665.55	4.30
58	300498	温氏股份	1,227,608.00	4.22
59	002920	德赛西威	1,222,941.00	4.20
60	601788	光大证券	1,180,282.30	4.06
61	002449	国星光电	1,157,652.00	3.98
62	002572	索菲亚	1,134,108.00	3.90
63	002013	中航机电	1,122,819.00	3.86
64	002375	亚厦股份	1,093,359.00	3.76
65	300308	中际旭创	1,077,775.00	3.71
66	601006	大秦铁路	1,074,739.00	3.70
67	002236	大华股份	1,073,805.00	3.69

68	300604	长川科技	1,070,869.00	3.68
69	600600	青岛啤酒	1,067,323.00	3.67
70	300133	华策影视	1,056,253.00	3.63
71	300251	光线传媒	1,042,408.00	3.58
72	002138	顺络电子	1,040,597.00	3.58
73	000980	众泰汽车	990,144.00	3.40
74	600183	生益科技	981,380.00	3.37
75	300098	高新兴	964,155.00	3.31
76	600390	五矿资本	963,960.00	3.31
77	600131	岷江水电	908,412.00	3.12
78	600345	长江通信	907,144.00	3.12
79	601186	中国铁建	892,240.00	3.07
80	600132	重庆啤酒	881,798.00	3.03
81	000970	中科三环	881,484.00	3.03
82	002594	比亚迪	879,507.32	3.02
83	002396	星网锐捷	878,726.60	3.02
84	601601	中国太保	877,243.00	3.02
85	600511	国药股份	868,823.00	2.99
86	000831	五矿稀土	868,634.60	2.99
87	300747	锐科激光	864,798.00	2.97
88	600125	铁龙物流	864,703.00	2.97
89	300476	胜宏科技	861,480.00	2.96
90	600528	中铁工业	860,970.00	2.96
91	002008	大族激光	856,347.00	2.94
92	300219	鸿利智汇	849,034.00	2.92
93	600728	佳都科技	837,901.00	2.88
94	300348	长亮科技	837,565.00	2.88
95	601319	中国人保	834,541.58	2.87
96	601688	华泰证券	802,818.76	2.76
97	600048	保利地产	781,132.00	2.69
98	300296	利亚德	779,273.00	2.68
99	000895	双汇发展	777,860.00	2.67
100	600466	蓝光发展	765,744.00	2.63
101	603043	广州酒家	754,617.00	2.59
102	300253	卫宁健康	750,695.00	2.58
103	300009	安科生物	744,564.00	2.56
104	600062	华润双鹤	743,847.00	2.56
105	603259	药明康德	730,678.00	2.51

106	603678	火炬电子	728,161.00	2.50
107	002152	广电运通	728,108.00	2.50
108	603833	欧派家居	725,964.00	2.50
109	600999	招商证券	715,092.00	2.46
110	601162	天风证券	702,379.00	2.41
111	000776	广发证券	701,509.00	2.41
112	000998	隆平高科	694,419.00	2.39
113	000725	京东方 A	687,699.00	2.36
114	603186	华正新材	672,581.00	2.31
115	300183	东软载波	652,653.00	2.24
116	300401	花园生物	634,803.00	2.18
117	601989	中国重工	623,984.00	2.15
118	600196	复星医药	621,214.00	2.14
119	002421	达实智能	605,609.00	2.08
120	002185	华天科技	598,258.86	2.06
121	000933	神火股份	598,189.00	2.06
122	002241	歌尔股份	586,293.00	2.02

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	253,452,985.97
卖出股票收入（成交）总额	226,498,852.20

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有的洲明科技（300232）于 2018 年 10 月收到深圳证券交易所对公司本身“未依法履行其他职责，未及时披露公司重大事项”发出监管关注，违规行为为“你公司 2018 年半年报显示，报告期内计提资产减值准备 2884.00 万元，占 2017 年度经审计净利润的 10.14%。公司未按照《创业板信息披露业务备忘录第 10 号：定期报告披露相关事项》的要求履行董事会审议程序及相关信息披露义务。”

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

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

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

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

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

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

本基金投资洲明科技主要基于以下原因：公司主营业务包括 LED 显示屏和 LED 照明两大业务板块，是全球 LED 显示屏的领先企业。公司 LED 显示屏市场份额全球前三，租赁类显示屏市场份额全球第一、体育及创意类显示屏全球领先。随着 LED 灯珠之间的间距越来越小，分辨率越来越

高，小间距产品（间距 2.5mm 以下）应用领域逐渐切入安防、应急、智慧城市、交通、司法、能源、军工等领域。洲明科技作为处于第一梯队的领先企业，经营稳健，未来有望充分分享行业发展的红利。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,905.58
2	应收证券清算款	431,370.04
3	应收股利	-
4	应收利息	2,607.43
5	应收申购款	8,773.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	507,656.14

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债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,149	21,562.12	26,853,024.92	39.55%	41,046,094.19	60.45%

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	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月8日）基金份额总额	223,239,423.25
本报告期期初基金份额总额	43,727,411.00
本报告期期间基金总申购份额	64,714,980.81
减：本报告期期间基金总赎回份额	40,543,272.70
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	67,899,119.11

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券股	2	264,938,308.85	55.23%	246,737.15	55.23%	-

份有限公司						
银河证券股份有限公司	1	177,956,206.49	37.10%	165,731.75	37.10%	-
招商证券股份有限公司	1	36,770,728.44	7.67%	34,244.42	7.67%	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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

（2）交易单元的选择标准和程序

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

分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。
 券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3) 本报告期内，本基金新增 3 个交易单元，分别为西藏东方财富证券股份有限公司上海和深圳交易单元各 1 个，国盛证券股份有限公司深圳交易单元 1 个。

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
东北证券股份有限公司	1,202,576.09	48.10%	-	-	-	-
银河证券股份有限公司	1,297,423.60	51.90%	51,200,000.00	100.00%	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有	-	-	-	-	-	-

限责任公司						
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190529 - 20190529	-	12,559,979.90	12,559,979.90	-	-
	2	20190626 - 20190630	-	24,911,559.54	-	24,911,559.54	36.69%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

东方基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 27 日