

金信新能源汽车灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：金信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金信新能源汽车混合
基金主代码	002256
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 1 日
基金管理人	金信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,629,445.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资受益于新能源汽车主题的上市公司股票，采用积极主动的分散化投资策略，在严密控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五个方面：</p> <p>1、资产配置策略 本基金在资产配置将根据宏观经济环境，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，及时确定基金资产在股票、债券、货币市场工具等各类资产上的投资比例，降低投资组合的风险，优化投资收益。</p> <p>2、股票投资策略 本基金股票资产将主要投资于新能源汽车行业相关的上市公司股票。</p> <p>3、债券投资策略 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将深入分析市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、违约率等基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。</p> <p>5、衍生品投资策略 1) 股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。 2) 权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具。</p>
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是以新能源汽车为投资主题的混合型基金，其

	预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
--	------------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段卓立	张燕
	联系电话	0755-82510502	0755-83199084
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-866-2866	95555
传真		0755-82510305	0755-83195201

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

§ 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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-6,980,490.06
本期利润	-3,939,195.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1288
本期基金份额净值增长率	-13.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1419
期末基金资产净值	26,281,718.11
期末基金份额净值	0.858

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

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

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

3.2 基金净值表现

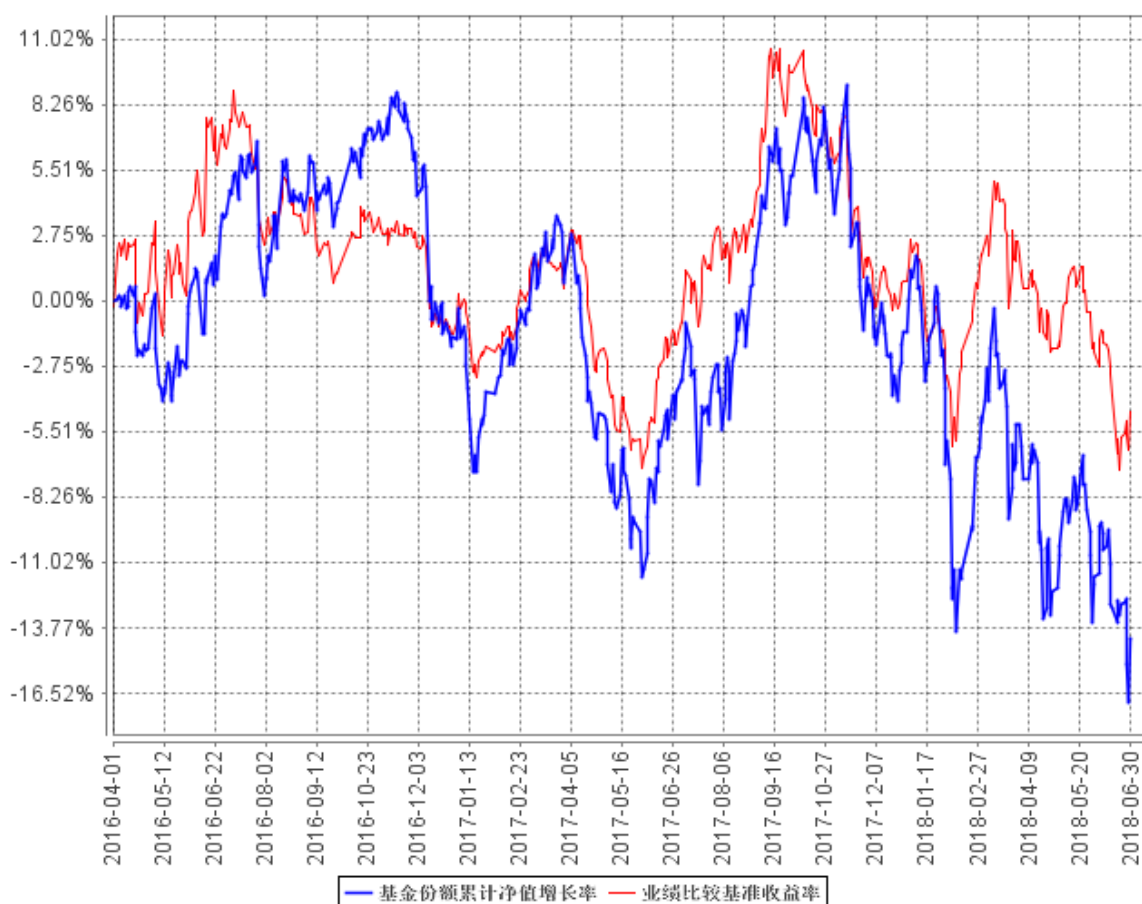
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-2.61%	1.41%	-3.27%	1.07%	0.66%	0.34%
过去三个月	-9.49%	1.44%	-7.14%	0.86%	-2.35%	0.58%
过去六个月	-13.07%	1.54%	-5.54%	0.95%	-7.53%	0.59%
过去一年	-10.90%	1.33%	-3.58%	0.85%	-7.32%	0.48%
自基金合同生效起至今	-14.20%	1.11%	-4.69%	0.77%	-9.51%	0.34%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

金信基金管理有限公司作为国内首家管理团队出任第一大股东的公募基金公司，管理团队持股 35%，是公司第一大股东。此外，公司股东还包括深圳市卓越创业投资有限责任公司及安徽国

元信托有限责任公司，两家机构出资比例分别为：34%、31%。

截至报告期末，金信基金管理有限公司管理资产规模超过 48.17 亿元，旗下管理 10 只开放式基金和 13 只专户理财投资组合。

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		
刘榕俊	本基金基金经理	2016年4月1日	-	16	男，北京大学经济学学士、中国科学院金融学硕士，具有基金从业资格。先后任职于招商基金、景顺长城基金、英大证券资产管理部。现任金信基金投资决策委员会委员、基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与

的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

新能源汽车无疑是未来确定的发展方向，但是新能源汽车短期内在财政去杠杆的条件下，新能源产业链上的企业补贴取消或者降低，在一定程度上将导致企业的发展速度放缓，甚至部分企业可能将破产，破产企业的市场份额长期而言将成为大企业的客户，短期内破产企业的配件也成为产业链上相关企业的痛点，无非通过其它的方式进行弥补，甚至大型企业面临着价格提升的风险。因此，短期内新能源汽车可能将面临着较大的风险。同时，新能源汽车发展的电池品类究竟是哪一种将成为主流的电池，全球范围内都在寻找解决方案。现阶段，纯电在中国市场获得了相对好的发展，不排除燃料电池也成为选择的对象。毕竟，燃料电池是日本丰田的杀手锏。因此，新能源汽车短期内难以有好的表现，在接下来的市场中可能需要观察的是新能源汽车的设备供应商的企业，设备制造企业可能将在未来的市场起步后首先得到市场的认可。同时，终端的整车企业也成为未来的市场的焦点，观察终端整车企业的品牌，成本控制能力将是投资的重点。

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 0.858 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.07%，业绩比较基准收益率为-5.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 2018 年 3 月 22 日美国对华 301 调查的结果公布后，中美贸易争端经历了几轮“紧张——缓和——紧张”的过程。但随着 7 月 6 日美国对华 340 亿美元关税措施的生效以及 7 月 11 日 2000 亿美元关税清单的公布。考虑到出口的乘数效应后，美国两批关税措施对国内 GDP 的累计冲击约为 0.4%，对于中国工业产出的影响约为 0.6%。贸易战也从预期变为现实，贸易战对于中国各个行业乃至整体 GDP 的影响到底已经受到了市场越来越多的关注。充分考虑乘数效应后，我们发现美国的关税措施影响较大的是，石油和天然气开采产品、烟草制品、家具、仪器仪表以及两个公用事业行业。虽然中美贸易战导致中国的部分行业受到了影响，但是长期而言，贸易战也让一些行业可能崛起成为细分领域的领导者。例如，“中兴事件”为例，若美方下达对于出口禁制令，那么可能其正常业务都无法开展，长期而言可能会阻碍中国科技进步的路径，无疑更加令人担心。而对未来美欧日建立零关税体系的猜测，也使投资者对未来更加悲观。实际上，各方都是既有利益冲突，也有共同利益，其中仍然有回旋的余地，关键的是中国从长远利益的角度出发来看待贸易摩擦的影响在贸易摩擦存在不确定性的背景下，加快自身的改革进度，以更加现代的标准融入世

界的规则之中。

面对当前全球经济发展格局，中国经济自身的发展规律，去杠杆的背景下中国经济转型的速度将加快。去杠杆的约束下，中国国内的优质企业也将获得更大的市场份额，对于拥有自身造血能力，拥有定价权的企业在未来的国际市场竞争中不仅可以稳定中国国内的市场份额，也可以在国际市场竞争中获得一席之地。对此，中国国内的优秀龙头企业也将在全球产业分工与经济竞争中获取长足发展。中国经济在 2008 年“次贷”危机后，开始逐步转型，部分行业已经转型成功，部分行业仍在转型中，转型速度快慢，转型后的质量决定了中国企业在未来的全球竞争中可能拥有的市场份额。因此，随着转型成功的企业逐渐拉动产业链上的相关企业，部分行业在内外力的作用下，取得较好的成果。当前经济看上去存在一些问题，但是社会的发展总是存在各种的矛盾，解决了相关矛盾后，社会也就进步了，企业的发展也顺理成章。因此，中国经过 30 多年的发展，中国经济也已经进入了后工业化的时代，在后工业化的时代中国经济的发展面对的问题有别于工业化时代。在后工业化时代的政策出台规律也有别于此前的工业化时代，对此，投资则需要调整思路，调整持仓的配置标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，报告期本基金无利润分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，截至 2018 年 6 月 30 日，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金净值的限制性条款暂不适用本基金。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		850,259.60	1,775,209.73
结算备付金		111,628.28	149,123.64
存出保证金		21,069.90	9,921.39
交易性金融资产		25,449,962.50	28,365,805.04
其中：股票投资		23,944,262.50	28,365,805.04
基金投资		-	-
债券投资		1,505,700.00	-
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		-	-
应收利息		13,536.40	794.60
应收股利		-	-
应收申购款		2,995.50	31,952.06
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		26,449,452.18	30,332,806.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		88.45	-
应付赎回款		21,910.47	-
应付管理人报酬		33,295.85	38,288.36
应付托管费		5,549.33	6,381.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		62,247.54	54,142.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		44,642.43	80,000.00
负债合计		167,734.07	178,812.71
所有者权益:			
实收基金		30,629,445.83	30,562,741.06
未分配利润		-4,347,727.72	-408,747.31
所有者权益合计		26,281,718.11	30,153,993.75
负债和所有者权益总计		26,449,452.18	30,332,806.46

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.858 元，基金份额总额 30,629,445.83 份。

2、后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
一、收入		-3,389,178.68	-288,608.97
1.利息收入		15,406.73	7,000.54
其中：存款利息收入		7,816.10	7,000.54
债券利息收入		2,485.48	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,105.15	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,449,830.42	-39,490.99
其中：股票投资收益		-6,698,681.53	-144,373.32
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		248,851.11	104,882.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		3,041,295.02	-256,661.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		3,949.99	543.04
减：二、费用		550,016.36	365,318.52
1. 管理人报酬		210,425.27	217,069.66
2. 托管费		35,070.89	36,178.32
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		259,499.22	67,234.56
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		45,020.98	44,835.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,939,195.04	-653,927.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,939,195.04	-653,927.49

注：1、后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	30,562,741.06	-408,747.31	30,153,993.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-3,939,195.04	-3,939,195.04
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）	66,704.77	214.63	66,919.40
其中：1.基金申购款	728,654.84	-55,003.95	673,650.89
2.基金赎回款	-661,950.07	55,218.58	-606,731.49
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）	30,629,445.83	-4,347,727.72	26,281,718.11
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	30,169,352.36	-465,635.58	29,703,716.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-653,927.49	-653,927.49
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）	161,653.74	-3,032.79	158,620.95
其中：1.基金申购款	286,880.37	-7,462.85	279,417.52
2.基金赎回款	-125,226.63	4,430.06	-120,796.57
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）	30,331,006.10	-1,122,595.86	29,208,410.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>殷克胜</u>	<u>殷克胜</u>	<u>陈瑾</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]447号《关于准予金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由金信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 31,122,709.37 元，业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 361 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 31,130,144.76 份基金份额，其中认购资金利息折合 7,435.39 份基金份额。本基金的基金管理人为金信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 20,001,150.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券）、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于新能源汽车主题相关的股票不低于非现金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金类资产或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：中证新能源汽车指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采取的会计政策、会计估计于最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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) 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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

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。

6.4.7.2 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
金信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
深圳市卓越创业投资有限责任公司（“深圳卓越创投”）	基金管理人的股东
安徽国元信托有限责任公司（“安徽国元信托”）	基金管理人的股东
深圳市巨财汇投资有限公司	基金管理人的股东
殷克胜	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	210,425.27	217,069.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,837.66	848.65

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,070.89	36,178.32

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未产生任何销售服务费。

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

本基金本报告期内与关联方无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 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**

本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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
深圳卓越创投	10,001,625.00	32.6536%	10,001,625.00	32.7249%
安徽国元信托	9,999,525.00	32.6468%	9,999,525.00	32.7180%

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	850,259.60	6,416.91	1,717,422.41	6,638.44

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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018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**

本基金本报告期末无因认购新发或增发而持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 23944262.50 元，属于第二层次的余额为 1505700.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》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、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起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的销售额确定做出规定。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23,944,262.50	90.53
	其中：股票	23,944,262.50	90.53
2	固定收益投资	1,505,700.00	5.69
	其中：债券	1,505,700.00	5.69
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	961,887.88	3.64
7	其他各项资产	37,601.80	0.14
8	合计	26,449,452.18	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,886,262.50	71.86

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,058,000.00	19.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,944,262.50	91.11

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	70,250	2,608,382.50	9.92
2	300015	爱尔眼科	80,000	2,583,200.00	9.83
3	600276	恒瑞医药	33,000	2,500,080.00	9.51
4	300347	泰格医药	40,000	2,474,800.00	9.42
5	000333	美的集团	47,000	2,454,340.00	9.34
6	600887	伊利股份	86,400	2,410,560.00	9.17
7	300124	汇川技术	72,000	2,363,040.00	8.99
8	002032	苏泊尔	45,100	2,322,650.00	8.84
9	002008	大族激光	35,000	1,861,650.00	7.08
10	300003	乐普医疗	42,000	1,540,560.00	5.86

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	002340	格林美	3,535,034.00	11.72
2	300718	长盛轴承	3,396,575.33	11.26
3	600521	华海药业	3,096,352.80	10.27
4	002415	海康威视	3,045,499.00	10.10
5	600703	三安光电	2,942,579.00	9.76
6	300347	泰格医药	2,873,214.00	9.53
7	002373	千方科技	2,671,010.07	8.86
8	600887	伊利股份	2,614,714.00	8.67
9	600031	三一重工	2,592,810.00	8.60
10	002334	英威腾	2,540,283.00	8.42
11	601012	隆基股份	2,524,672.00	8.37
12	600276	恒瑞医药	2,520,450.00	8.36
13	300015	爱尔眼科	2,518,406.00	8.35
14	000333	美的集团	2,511,087.00	8.33
15	002032	苏泊尔	2,400,318.00	7.96
16	300124	汇川技术	2,393,425.00	7.94
17	000513	丽珠集团	2,301,717.00	7.63
18	002294	信立泰	2,259,095.00	7.49
19	300304	云意电气	2,207,961.00	7.32
20	000001	平安银行	1,890,818.00	6.27
21	002008	大族激光	1,840,111.60	6.10
22	300001	特锐德	1,718,060.00	5.70
23	000069	华侨城 A	1,715,675.00	5.69
24	002027	分众传媒	1,582,780.00	5.25
25	600050	中国联通	1,572,342.00	5.21
26	300098	高新兴	1,399,542.00	4.64
27	300003	乐普医疗	1,383,858.00	4.59
28	002279	久其软件	1,371,183.00	4.55
29	300607	拓斯达	1,282,020.00	4.25
30	002475	立讯精密	1,222,547.00	4.05
31	600068	葛洲坝	1,213,638.00	4.02

32	601098	中南传媒	1,191,320.00	3.95
33	600409	三友化工	1,189,080.00	3.94
34	300401	花园生物	1,188,032.00	3.94
35	002594	比亚迪	1,177,806.00	3.91
36	603960	克来机电	1,122,484.20	3.72
37	300316	晶盛机电	1,109,432.00	3.68
38	600588	用友网络	1,087,940.00	3.61
39	600048	保利地产	1,076,560.00	3.57
40	002074	国轩高科	1,048,212.80	3.48
41	600136	当代明诚	1,021,334.00	3.39
42	002648	卫星石化	1,002,906.00	3.33
43	600884	杉杉股份	978,760.00	3.25
44	600525	长园集团	918,516.00	3.05
45	000425	徐工机械	884,930.00	2.93
46	002583	海能达	871,117.00	2.89
47	000888	峨眉山 A	860,262.00	2.85
48	300258	精锻科技	817,988.00	2.71
49	300136	信维通信	800,509.00	2.65
50	000100	TCL 集团	799,200.00	2.65
51	300197	铁汉生态	764,053.00	2.53
52	000997	新大陆	721,180.00	2.39
53	000823	超声电子	704,688.00	2.34
54	002456	欧菲科技	701,044.00	2.32
55	300183	东软载波	671,679.00	2.23
56	600522	中天科技	671,400.00	2.23
57	600388	龙净环保	666,591.00	2.21
58	600583	海油工程	603,840.00	2.00

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600031	三一重工	4,287,721.55	14.22
2	300718	长盛轴承	3,562,597.94	11.81
3	601012	隆基股份	3,342,170.00	11.08

4	002340	格林美	3,277,471.00	10.87
5	603960	克来机电	3,188,356.30	10.57
6	600521	华海药业	3,170,855.00	10.52
7	600703	三安光电	3,104,510.00	10.30
8	600050	中国联通	2,563,896.00	8.50
9	002294	信立泰	2,428,885.00	8.05
10	002373	千方科技	2,349,470.00	7.79
11	000513	丽珠集团	2,267,130.00	7.52
12	002334	英威腾	2,126,664.00	7.05
13	000425	徐工机械	2,123,120.00	7.04
14	000001	平安银行	1,926,214.00	6.39
15	000888	峨眉山A	1,837,138.00	6.09
16	300304	云意电气	1,826,512.00	6.06
17	000069	华侨城A	1,762,347.00	5.84
18	300001	特锐德	1,682,592.00	5.58
19	600366	宁波韵升	1,500,371.00	4.98
20	600699	均胜电子	1,490,861.98	4.94
21	000758	中色股份	1,462,582.00	4.85
22	002456	欧菲科技	1,458,625.00	4.84
23	300098	高新兴	1,434,932.00	4.76
24	600418	江淮汽车	1,416,608.00	4.70
25	000050	深天马A	1,408,557.47	4.67
26	002279	久其软件	1,396,840.00	4.63
27	600549	厦门钨业	1,364,008.00	4.52
28	002027	分众传媒	1,339,358.44	4.44
29	000970	中科三环	1,239,299.00	4.11
30	600048	保利地产	1,198,880.00	3.98
31	300607	拓斯达	1,194,475.00	3.96
32	300401	花园生物	1,172,144.00	3.89
33	002475	立讯精密	1,163,376.23	3.86
34	600584	长电科技	1,161,340.00	3.85
35	601098	中南传媒	1,132,417.00	3.76
36	600588	用友网络	1,131,817.00	3.75
37	300316	晶盛机电	1,126,930.00	3.74
38	002249	大洋电机	1,120,465.00	3.72
39	600068	葛洲坝	1,100,304.00	3.65
40	600409	三友化工	1,079,364.00	3.58
41	002594	比亚迪	1,066,989.00	3.54

42	600884	杉杉股份	1,058,687.00	3.51
43	002055	得润电子	1,039,344.00	3.45
44	600136	当代明诚	958,265.00	3.18
45	600820	隧道股份	954,096.00	3.16
46	002648	卫星石化	913,400.00	3.03
47	600525	长园集团	861,513.00	2.86
48	000100	TCL 集团	804,000.00	2.67
49	300136	信维通信	795,560.00	2.64
50	601668	中国建筑	786,400.00	2.61
51	000997	新大陆	772,796.00	2.56
52	600522	中天科技	763,600.00	2.53
53	300197	铁汉生态	754,188.00	2.50
54	300183	东软载波	738,895.00	2.45
55	000823	超声电子	728,604.00	2.42
56	002074	国轩高科	716,880.50	2.38
57	002583	海能达	692,400.00	2.30
58	600340	华夏幸福	684,200.00	2.27
59	600388	龙净环保	678,876.00	2.25
60	600066	宇通客车	636,672.25	2.11
61	600583	海油工程	624,000.00	2.07

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	104,277,250.31
卖出股票收入（成交）总额	105,036,756.34

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,505,700.00	5.73
	其中：政策性金融债	1,505,700.00	5.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,505,700.00	5.73

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	15,000	1,505,700.00	5.73

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,069.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,536.40
5	应收申购款	2,995.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,601.80

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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
115	266,343.01	30,005,408.85	97.96%	624,036.98	2.04%

注：户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数总计

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金未申请场内上市交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理均未持有本基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	20,001,150.00	65.30	20,001,150.00	65.30	自合同生效之日起不少于3年
其他	-	-	-	-	-
合计	20,001,150.00	65.30	20,001,150.00	65.30	自合同生效之日起不少于3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年4月1日）基金份额总额	31,130,144.76
本报告期期初基金份额总额	30,562,741.06
本报告期基金总申购份额	728,654.84
减：本报告期基金总赎回份额	661,950.07
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	30,629,445.83

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所无变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	4	59,343,266.79	28.35%	43,397.96	31.94%	-
中信建投	2	50,320,891.80	24.04%	20,696.99	15.23%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	31,784,601.63	15.19%	23,244.08	17.10%	-
海通证券	1	19,265,162.40	9.20%	13,703.17	10.08%	-
国信证券	2	14,018,973.80	6.70%	10,252.12	7.54%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	34,581,110.23	16.52%	24,597.56	18.10%	-

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

A: 选择标准

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

B: 选择流程

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

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就

有关专题提供研究报告和讲座；

b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	1,501,050.00	100.00%	34,100,000.00	100.00%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

§ 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	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	9,999,525.00	-	-	9,999,525.00	32.65%
	2	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	10,003,200.00	-	-	10,003,200.00	32.66%
	3	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	10,001,625.00	-	-	10,001,625.00	32.65%
产品特有风险							
<p>1、大额赎回风险</p> <p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风</p>							

险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

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

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

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

2、大额申购风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

金信基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日