

光大保德信新增长混合型证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

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 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
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.....	5
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.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	45
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.9 其他重大事件	48
11 影响投资者决策的其他重要信息	49
12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信新增长混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信新增长混合
基金主代码	360006
交易代码	360006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月14日
基金管理人	光大保德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	248,260,712.21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司，为投资者获取稳定的收益。
投资策略	本基金为主动投资的混合型投资基金，强调投资于符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司，追求长期投资回报。
业绩比较基准	75% × 沪深 300 指数 + 20% × 中证全债指数 + 5% × 银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金及债券型基金，但低于股票型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。

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		光大保德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	毛宗倩	张燕
	联系电话	(021) 80262888	0755-83199084
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008-202-888	95555
传真		(021) 80262468	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼），6-7层、10层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040

法定代表人	林昌	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	《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金半年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、招商银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 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 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	20,972,814.12
本期利润	40,979,307.77
加权平均基金份额本期利润	0.1901
本期加权平均净值利润率	17.48%
本期基金份额净值增长率	23.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	16,431,788.39
期末可供分配基金份额利润	0.0662
期末基金资产净值	280,786,471.28
期末基金份额净值	1.1310
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	314.74%

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）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）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。

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	4.65%	1.33%	4.17%	0.87%	0.48%	0.46%
过去三个月	-3.71%	1.80%	-0.64%	1.14%	-3.07%	0.66%
过去六个月	23.32%	1.66%	20.53%	1.16%	2.79%	0.50%
过去一年	15.47%	1.44%	8.62%	1.14%	6.85%	0.30%
过去三年	23.69%	1.18%	19.20%	0.83%	4.49%	0.35%
自基金合同生效起至今	314.74%	1.72%	156.49%	1.34%	158.25%	0.38%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×富时中国 A200 成长指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”变更为“75%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”。

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

光大保德信新增长混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2006 年 9 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日）



注：1、为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×富时中国 A200 成长指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”变更为“75%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2006 年 9 月 14 日至 2007 年 3 月 13 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2019 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 45 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混

合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信超短债债券型证券投资基金、光大保德信晟利债券型证券投资基金、光大保德信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）及基金经理助理的简介

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		
魏晓雪	研究部总监、 基金经理	2013-02-28	-	12 年	魏晓雪女士，硕士，2003 年毕业于浙江大学，获经济学学士学位。2015 年获得复旦大学经济学硕士学位。2006 年 10 月至 2009 年 9 月曾在鹏远（北京）管理咨询有限公司上海分公司（原凯基管理咨询有限公司）担任研究员；2009 年 10 月加入光大保德信基金管理有

					限公司担任高级研究员。2012 年 11 月 15 日起担任光大保德信行业轮动混合型证券投资基金基金经理。现任研究部总监兼光大保德信新增长混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

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

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

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。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

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 年一季度经济情况较为乐观，但伴随中美摩擦的加剧，宏观经济又开始了继续回落。一季度，1 月份信贷超预期，3 月 PMI 反弹略超预期，种种迹象表明宏观经济略显企稳。由于油价及限产导致化工产品等价格企稳，二季度工业企业利润增速有望结束连续三个季度的下降。美国就业数据出现反复迹象，确认了美国经济开始放缓，是否出现较大幅度衰退仍需观察。美联储缩表进程接近尾声，降息预期或将升温。回顾 2019 年上半年，经济的主要支撑力体现在了建筑业相关产业，如房地产、钢铁、水泥、工程机械等，呈现了量价均强势的态势，但是制造业增加值和投资增速却在

不断下降，制造业整体表现疲弱。内需相对表现稳定，但是以汽车为代表的可选消费品需求萎靡。出口环境受到中美贸易战的影响较大，5 月份贸易摩擦的升级预计将对第三季度的国内经济产生明显拖累效果。国债收益率于 2 季度初期回弹后，在中美谈判破裂后显著下降，同时，国内通胀压力越来越大，猪价由于猪瘟的影响预计在下半年将继续上行，鸡价同时维持高位，通胀压力需警惕。美联储缩表进入尾声，降息预期明显升温，欧洲、日本、韩国经济景气度都有明显回落。综合来说，相较于年初，我们依然认为权益资产配置的意义非常重要，但是由于宏观经济的前景较年初更为悲观，中美贸易摩擦升级的速度超过预期，我们会相应降低收益率预期。未来最大的风险集中在：通胀超预期向上；中美贸易摩擦快速、深度恶化；国内地产景气度下滑超预期；海外经济过快下滑。

2019 年一季度股票市场虽有结构型差异，但基本属于普涨。期间上证 50、沪深 300、上证综指、创业板指、中小板指分别上涨了 23.8%、28.6%、23.9%、35.4%和 35.7%。2019 年二季度股票市场整体回落明显，仅上证 50 获得了 3%的正收益。跌幅较大的指数分别为：中小板指数和创业板指数，跌幅均在 10%以上。

从行业分布来看，一季度表现最好的行业为农业、计算机及非银行金融，单季度分别录得了 49%、47%和 42%以上的涨幅。涨幅较小的行业为银行、公共事业及建筑，三个行业的涨幅均在 19%以内。二季度表现最好的行业为食品饮料、家电和银行，单季度分别录得了 13%、3.5%和 2.9%以上的涨幅，餐饮旅游和非银两个行业也录得了微弱正收益。跌幅较大的行业为传媒和轻工，跌幅均在 13%以上，电子、电力设备、基础化工和纺织服装的跌幅也在 10%以上。

本基金一季度的操作中，季初维持了较低仓位，一月份伴随市场逐步走出底部，先在持仓结构上调整得更为激进，后在春节前后进行了明显加仓，2 月至今维持较高仓位。现持仓结构以消费为底仓，成长类如计算机、通信、机械等为主要方向，配置均衡偏向成长。二季度的操作中，仓位始终中性偏高。持仓结构以消费为底仓，成长类如计算机、通信、机械等为主要方向，配置均衡偏向成长。本基金在个股选择上始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 23.32%，业绩比较基准收益率为 20.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

综合 2019 年上半年的宏观背景展望，我们认为到年末或 2020 年，未来宏观经济依然承压。一方面，二季度初新增的美国 2000 亿关税由 10%升级为 25%必然会带来总需求端的下滑，中美贸易谈判虽在进程中，但是贸易摩擦暂时看不到全面缓解的迹象。加之日韩、欧盟等地区的经济都相对疲弱，德国制造业 PMI 快速下降，亚洲日韩的贸易摩擦也在加剧中，叠加下半年英国无协议脱欧的可

能性，我们对全球层面的总需求呈谨慎态度。另一方面，国内的制造业投资迟迟没有提升，固定资产投资增速也在低位徘徊，企业家信心尚需恢复，国内仅有建筑业产业链景气度维持高位，且持续了 3-4 年，继续维持高位的概率越来越低。第三，消费平稳，汽车大幅下滑的趋势不会再加剧，但是我们判断不会如市场预期般，在下半年转正。综上，我们认为中短期内，宏观经济承压，从总量或自上而下行业景气度角度寻找投资机会较为困难。

下半年作为经济下滑的对冲，政策表现大概率友好。下半年我们预估逐步进入全球降息周期，无风险利率中枢将会下移，叠加估值，股市现在的风险补偿依然不错。

综上，我们投资展望分为战略和战术两个层面。在战略层面：大方向上我们对权益资产并不悲观。中国经济乏力并不是中国特有的情况，全球都面临人口出生率在低位徘徊，缺乏经济增长点，只能靠不断的“货币放水”来维持。从大类资产比较的角度来看，A 股整体估值偏低，无论从政策角度加大直接股权融资比例还是从投资角度来看，权益类资产都是非常值得重视的资产。从战术上来看，由于宏观经济承压，从总量或者自上而下行业景气度转好的角度寻找投资机会均较为困难，我们倾向于寻找各个子行业中优秀的龙头企业作为基金的底仓。去寻找行业前景较好，市场空间较大，行业内竞争格局良好，或者在猛烈的竞争中已经存活下来，表现出超强的生存能力的公司，我们认为这类公司不但能够存活，还能在未来几年中继续抢占别的公司的份额以获取自身的成长，这类优秀的小行业龙头企业将有望从估值折价逐步变为估值平价，到估值溢价。我们将对这部分公司进行深入研究、加大持股比例且做到长期投资。另一方面，考虑到下半年无风险利率的下移及政策的扶持，我们会相应配置受益于利率曲线下移的板块和政策友好支持的板块。消费板块作为长期关注的领域，会一直有相应的持仓，不断考量估值与基本面之间的关系进行调整。同时在操作中会关注与风险偏好密切相关的中美贸易谈判，在贸易谈判呈现非常乐观的背景，或者市场认为非常乐观的情况下反而需要谨慎，反之亦然。

主要的风险集中于：全球经济超预期快速下滑、国内通胀超预期上行、信用利差快速上行、中美贸易谈判破裂，贸易关税继续上行。

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，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表（包括权

益、固定收益业务板块)、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,选择基金估值模型及估值模型假设,定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制,对需采用特别估值的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由公司估值委员会讨论特别估值方案,同时审慎平衡托管行、审计师意见和基金同业的惯常做法,与托管行沟通后形成建议,经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会提交建议一般需获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历,并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下:投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论,负责执行基金估值政策进行日常估值业务,负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项;监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见;投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估;金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估;IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况,本基金本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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信新增长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	6.4.7.1	37,905,145.32	9,467,022.31
结算备付金		1,508,868.24	1,788,613.18
存出保证金		113,897.67	81,329.38
交易性金融资产	6.4.7.2	233,104,811.70	114,776,918.80
其中：股票投资		233,104,811.70	111,763,718.80
基金投资		-	-
债券投资		-	3,013,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	55,000,000.00
应收证券清算款		9,585,053.29	-
应收利息	6.4.7.5	9,291.27	157,319.10
应收股利		-	-
应收申购款		229,004.88	4,834.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		282,456,072.37	181,276,037.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		555,738.40	-
应付赎回款		387,094.40	36,856.78
应付管理人报酬	6.4.10.2	330,098.61	234,335.18
应付托管费	6.4.10.2	55,016.40	39,055.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	251,782.83	181,067.25
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	89,870.45	260,022.13
负债合计		1,669,601.09	751,337.22
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	248,260,712.21	196,835,971.98
未分配利润	6.4.7.10	32,525,759.07	-16,311,272.09
所有者权益合计		280,786,471.28	180,524,699.89
负债和所有者权益总计		282,456,072.37	181,276,037.11

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1310 元，基金份额总额 248,260,712.21 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信新增长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 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		44,048,755.97	-26,519,812.50
1.利息收入		396,747.47	268,097.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	109,359.12	77,425.35
债券利息收入		29,515.07	8,031.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		257,873.28	182,641.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,609,949.26	629,191.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,354,598.46	26,991.80
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-14,910.00	77,841.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	1,270,260.80	524,359.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	20,006,493.65	-27,430,299.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	35,565.59	13,197.17
减：二、费用		3,069,448.20	3,351,627.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,735,515.82	1,656,123.93
2. 托管费	6.4.10.2	289,252.56	276,020.65

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	935,469.44	1,219,820.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	28.88
7. 其他费用	6.4.7.22	109,210.38	199,633.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,979,307.77	-29,871,440.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,979,307.77	-29,871,440.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信新增长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）	196,835,971.98	-16,311,272.09	180,524,699.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,979,307.77	40,979,307.77
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）	51,424,740.23	7,857,723.39	59,282,463.62
其中：1.基金申购款	73,678,231.61	10,916,653.18	84,594,884.79
2.基金赎回款	-22,253,491.38	-3,058,929.79	-25,312,421.17
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）	248,260,712.21	32,525,759.07	280,786,471.28
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）	198,686,737.28	47,711,289.46	246,398,026.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-29,871,440.12	-29,871,440.12

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）	-1,934,036.49	-2,438,712.66	-4,372,749.15
其中：1.基金申购款	18,384,640.02	1,328,647.39	19,713,287.41
2.基金赎回款	-20,318,676.51	-3,767,360.05	-24,086,036.56
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）	-	-19,430,960.13	-19,430,960.13
五、期末所有者权益（基金净值）	196,752,700.79	-4,029,823.45	192,722,877.34

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：

基金管理人负责人：包爱丽，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信新增长混合型证券投资基金（原名光大保德信新增长股票型证券投资基金以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]129 号文《关于同意光大保德信新增长股票型投资基金募集的批复》的核准，由光大保德信基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 9 月 14 日正式生效，首次设立募集规模为 409,913,619.78 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为光大保德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。

本基金为主动投资的混合型投资基金，强调投资于符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司，追求长期投资回报。本基金股票资产占基金资产不少于 60%，最高可达基金资产 90%，其余资产除应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券外，还可投资于中国证监会认可的其他金融工具，包括但不限于债券、可转债、央行票据、回购、权证等。本基金的业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率。

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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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>》及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。

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 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	37,905,145.32
定期存款	-
其他存款	-
合计	37,905,145.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	218,457,072.11	233,104,811.70	14,647,739.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	218,457,072.11	233,104,811.70	14,647,739.59

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,560.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	679.00
应收债券利息	-
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	51.30
合计	9,291.27

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	251,782.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	251,782.83

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,135.27
其他	-
预提费用	88,735.18
合计	89,870.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	196,835,971.98	196,835,971.98
本期申购	73,678,231.61	73,678,231.61
本期赎回（以“-”号填列）	-22,253,491.38	-22,253,491.38
本期末	248,260,712.21	248,260,712.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,521,838.08	-7,789,434.01	-16,311,272.09
本期利润	20,972,814.12	20,006,493.65	40,979,307.77
本期基金份额交易产生的变动数	3,980,812.35	3,876,911.04	7,857,723.39

其中：基金申购款	4,931,865.28	5,984,787.90	10,916,653.18
基金赎回款	-951,052.93	-2,107,876.86	-3,058,929.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,431,788.39	16,093,970.68	32,525,759.07

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	90,161.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,400.97
其他	796.43
合计	109,359.12

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	284,380,537.50
减：卖出股票成本总额	262,025,939.04
买卖股票差价收入	22,354,598.46

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-14,910.00
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	-14,910.00

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,113,400.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,014,910.00
减：应收利息总额	113,400.00
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-14,910.00

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期末未进行衍生工具投资。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,270,260.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,270,260.80

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	20,006,493.65
——股票投资	20,004,783.65
——债券投资	1,710.00
——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	20,006,493.65

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	29,376.50
转换费收入	6,189.09
合计	35,565.59

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	935,469.44
银行间市场交易费用	-
合计	935,469.44

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	63,939.99
银行汇划费用	1,875.20
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	109,210.38

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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
光大保德信基金管理有限公司（简称“光大保德信”）	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（简称“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下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

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
光大证券	257,136,621.74	39.81%	104,530,317.04	13.07%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期和上年度可比期间均未与关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	1,658,300,000.00	100.00%	110,000,000.00	11.27%

6.4.10.1.5 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
光大证券	239,471.55	40.33%	105,290.52	41.82%
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
光大证券	97,349.43	13.22%	28,015.33	9.57%

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	1,735,515.82	1,656,123.93
其中：支付销售机构的客户维护费	274,717.26	287,129.53

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人在收到计算结果当日完成复核,并于当日

从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	289,252.56	276,020.65

注：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。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，基金管理人应于次月首日起三个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并作出划付指令，基金托管人复核后于当日从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期以及上年度可比期间未做银行间市场债券（含回购）的关联交易。

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

本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	37,905,145.32	90,161.72	11,208,361.97	62,095.32

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	网下中签	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下中签	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无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。

6.4.12.3.2 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证券款余额。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务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内部管理制度和流程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。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上

年末：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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、外汇风险及其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	37,905,145.32	-	-	-	-	-	37,905,145.32
结算备付金	1,508,868.24	-	-	-	-	-	1,508,868.24
存出保证金	113,897.67	-	-	-	-	-	113,897.67
交易性金融资	-	-	-	-	-	233,104,81	233,104,81

产						1.70	1.70
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,585,053.29	9,585,053.29
应收利息	-	-	-	-	-	9,291.27	9,291.27
应收申购款	-	-	-	-	-	229,004.88	229,004.88
资产总计	39,527,911.23	-	-	-	-	242,928,161.14	282,456,072.37
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	555,738.40	555,738.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	387,094.40	387,094.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	330,098.61	330,098.61
应付托管费	-	-	-	-	-	55,016.40	55,016.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	251,782.83	251,782.83
其他负债	-	-	-	-	-	89,870.45	89,870.45
负债总计	-	-	-	-	-	1,669,601.09	1,669,601.09
利率敏感度缺口	39,527,911.23	-	-	-	-	241,258,560.05	280,786,471.28
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,467,022.31	-	-	-	-	-	9,467,022.31
结算备付金	1,788,613.18	-	-	-	-	-	1,788,613.18
存出保证金	81,329.38	-	-	-	-	-	81,329.38
交易性金融资产	-	-	3,013,200.00	-	-	111,763,718.80	114,776,918.80
买入返售金融资产	55,000,000.00	-	-	-	-	-	55,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	157,319.10	157,319.10
应收申购款	-	-	-	-	-	4,834.34	4,834.34

资产总计	66,336,964. 87	-	3,013,200.0 0	-	-	111,925,872 .24	181,276,03 7.11
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	36,856.78	36,856.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	234,335.18	234,335.18
应付托管费	-	-	-	-	-	39,055.88	39,055.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	181,067.25	181,067.25
其他负债	-	-	-	-	-	260,022.13	260,022.13
负债总计	-	-	-	-	-	751,337.22	751,337.22
利率敏感度缺口	66,336,964. 87	-	3,013,200.0 0	-	-	111,174,535 .02	180,524,69 9.89

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	233,104,811.70	83.02	111,763,718.80	61.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	233,104,811.70	83.02	111,763,718.80	61.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 3,500,929	增加约 1,834,873
	业绩比较基准下降 1%	减少约 3,500,929	减少约 1,834,873

注：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，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无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	233,104,811.70	82.53
	其中：股票	233,104,811.70	82.53
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	39,414,013.56	13.95
8	其他各项资产	9,937,247.11	3.52
9	合计	282,456,072.37	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

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	9,693,167.00	3.45
B	采矿业	158,653.05	0.06
C	制造业	161,108,993.21	57.38
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	5,848.00	0.00
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	55,292,844.16	19.69
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	121,815.74	0.04
M	科学研究和技术服务业	6,641,824.00	2.37
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	24,690.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	233,104,811.70	83.02

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300285	国瓷材料	860,000	14,628,600.00	5.21
2	000063	中兴通讯	400,000	13,012,000.00	4.63
3	600588	用友网络	470,080	12,635,750.40	4.50
4	603690	至纯科技	620,000	12,418,600.00	4.42
5	300033	同花顺	110,000	10,819,600.00	3.85
6	600600	青岛啤酒	210,000	10,485,300.00	3.73
7	600132	重庆啤酒	219,500	10,351,620.00	3.69
8	300724	捷佳伟创	380,000	10,115,600.00	3.60
9	300059	东方财富	720,000	9,756,000.00	3.47
10	300511	雪榕生物	1,200,000	9,660,000.00	3.44
11	002488	金固股份	900,000	7,497,000.00	2.67
12	002594	比亚迪	140,000	7,100,800.00	2.53
13	300253	卫宁健康	500,000	7,090,000.00	2.53
14	300014	亿纬锂能	220,000	6,701,200.00	2.39
15	600436	片仔癀	55,000	6,336,000.00	2.26
16	300274	阳光电源	660,000	6,171,000.00	2.20
17	603658	安图生物	90,000	6,152,400.00	2.19
18	600570	恒生电子	90,000	6,133,500.00	2.18
19	000651	格力电器	110,000	6,050,000.00	2.15
20	300012	华测检测	550,000	5,940,000.00	2.12
21	600690	海尔智家	330,000	5,705,700.00	2.03
22	601633	长城汽车	600,000	4,962,000.00	1.77
23	603208	江山欧派	130,000	4,475,900.00	1.59
24	600756	浪潮软件	180,000	4,305,600.00	1.53
25	603986	兆易创新	44,000	3,814,800.00	1.36
26	601966	玲珑轮胎	200,000	3,400,000.00	1.21
27	300450	先导智能	100,000	3,360,000.00	1.20
28	600720	祁连山	300,000	2,637,000.00	0.94
29	000333	美的集团	50,000	2,593,000.00	0.92
30	300604	长川科技	119,326	2,249,295.10	0.80

31	600990	四创电子	46,000	2,139,920.00	0.76
32	002138	顺络电子	110,000	1,933,800.00	0.69
33	002791	坚朗五金	120,000	1,899,600.00	0.68
34	300725	药石科技	30,030	1,871,769.90	0.67
35	300113	顺网科技	100,000	1,568,000.00	0.56
36	600855	航天长峰	100,000	1,389,000.00	0.49
37	300369	绿盟科技	100,000	1,281,000.00	0.46
38	300017	网宿科技	90,000	970,200.00	0.35
39	603259	药明康德	8,000	693,440.00	0.25
40	002230	科大讯飞	20,000	664,800.00	0.24
41	603899	晨光文具	10,000	439,700.00	0.16
42	300685	艾德生物	5,000	261,850.00	0.09
43	600968	海油发展	44,691	158,653.05	0.06
44	300747	锐科激光	1,000	140,010.00	0.05
45	300751	迈为股份	1,000	126,760.00	0.05
46	600519	贵州茅台	100	98,400.00	0.04
47	601888	中国国旅	1,000	88,650.00	0.03
48	603338	浙江鼎力	1,400	82,194.00	0.03
49	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
50	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.02
51	300122	智飞生物	1,000	43,100.00	0.02
52	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
53	603217	元利科技	584	39,268.16	0.01
54	002869	金溢科技	1,000	38,790.00	0.01
55	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
56	300679	电连技术	1,300	36,218.00	0.01
57	603960	克来机电	1,300	35,477.00	0.01
58	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
59	002458	益生股份	1,700	33,167.00	0.01
60	300781	因赛集团	727	33,165.74	0.01
61	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
62	300552	万集科技	1,000	28,790.00	0.01
63	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
64	002372	伟星新材	1,200	20,880.00	0.01
65	002568	百润股份	1,000	17,880.00	0.01
66	300244	迪安诊断	1,000	16,980.00	0.01
67	000596	古井贡酒	100	11,851.00	0.00
68	600742	一汽富维	1,000	10,670.00	0.00
69	603288	海天味业	100	10,500.00	0.00
70	600055	万东医疗	1,000	10,380.00	0.00
71	300347	泰格医药	100	7,710.00	0.00
72	600276	恒瑞医药	100	6,600.00	0.00
73	603883	老百姓	100	5,848.00	0.00
74	603156	养元饮品	140	5,191.20	0.00

75	603127	昭衍新药	100	4,818.00	0.00
76	002812	恩捷股份	100	4,675.00	0.00
77	000710	贝瑞基因	100	3,566.00	0.00
78	601100	恒立液压	100	3,138.00	0.00
79	603396	金辰股份	140	3,078.60	0.00
80	600516	方大炭素	149	1,831.21	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	300033	同花顺	15,352,881.39	8.50
2	600588	用友网络	11,721,786.78	6.49
3	300285	国瓷材料	11,171,921.00	6.19
4	300511	雪榕生物	11,022,370.65	6.11
5	300724	捷佳伟创	10,628,493.00	5.89
6	600132	重庆啤酒	9,250,815.90	5.12
7	002488	金固股份	8,735,840.50	4.84
8	600600	青岛啤酒	8,561,231.29	4.74
9	300450	先导智能	8,475,394.00	4.69
10	300183	东软载波	8,267,574.00	4.58
11	002594	比亚迪	8,124,586.00	4.50
12	600104	上汽集团	7,917,422.00	4.39
13	601633	长城汽车	6,987,539.00	3.87
14	300012	华测检测	6,741,556.00	3.73
15	000063	中兴通讯	6,606,075.54	3.66
16	600436	片仔癀	6,602,452.00	3.66
17	300339	润和软件	6,573,436.00	3.64
18	002095	生意宝	6,449,040.00	3.57
19	600570	恒生电子	6,365,609.00	3.53
20	603690	至纯科技	6,311,305.00	3.50
21	300348	长亮科技	6,203,888.00	3.44
22	000651	格力电器	6,116,675.00	3.39
23	600690	海尔智家	6,030,064.00	3.34
24	000686	东北证券	5,942,830.60	3.29
25	603019	中科曙光	5,697,691.00	3.16
26	300373	扬杰科技	5,697,319.00	3.16
27	600763	通策医疗	5,648,822.72	3.13
28	601881	中国银河	5,590,102.96	3.10
29	300014	亿纬锂能	5,587,793.27	3.10

30	600756	浪潮软件	5,262,381.00	2.92
31	002230	科大讯飞	5,260,984.88	2.91
32	603612	索通发展	5,069,455.00	2.81
33	603208	江山欧派	4,838,687.48	2.68
34	600373	中文传媒	4,789,558.00	2.65
35	000915	山大华特	4,749,010.01	2.63
36	603658	安图生物	4,699,327.00	2.60
37	603678	火炬电子	4,630,938.29	2.57
38	300604	长川科技	4,571,085.70	2.53
39	300144	宋城演艺	4,565,791.00	2.53
40	002250	联化科技	4,128,564.00	2.29
41	300760	迈瑞医疗	3,980,793.00	2.21
42	600885	宏发股份	3,686,841.00	2.04

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	002458	益生股份	11,596,692.00	6.42
2	600547	山东黄金	10,521,845.00	5.83
3	000591	太阳能	10,136,323.70	5.61
4	300012	华测检测	10,106,561.05	5.60
5	002250	联化科技	8,747,200.00	4.85
6	002746	仙坛股份	8,649,661.00	4.79
7	300183	东软载波	8,423,590.00	4.67
8	300339	润和软件	7,478,518.00	4.14
9	600104	上汽集团	7,042,534.00	3.90
10	600837	海通证券	6,517,800.73	3.61
11	600763	通策医疗	6,383,235.00	3.54
12	300373	扬杰科技	6,237,548.00	3.46
13	002095	生意宝	6,232,993.90	3.45
14	300450	先导智能	6,124,204.00	3.39
15	300348	长亮科技	5,565,839.00	3.08
16	600030	中信证券	5,210,478.00	2.89
17	603612	索通发展	5,146,957.00	2.85
18	603678	火炬电子	5,087,621.57	2.82
19	002230	科大讯飞	5,063,669.00	2.80
20	300144	宋城演艺	4,938,761.00	2.74
21	000686	东北证券	4,825,859.00	2.67
22	000915	山大华特	4,738,360.52	2.62
23	600383	金地集团	4,678,953.00	2.59
24	600038	中直股份	4,604,563.00	2.55

25	603019	中科曙光	4,511,371.60	2.50
26	600373	中文传媒	4,204,144.39	2.33
27	002557	洽洽食品	4,065,420.00	2.25
28	600885	宏发股份	4,064,668.00	2.25
29	601398	工商银行	3,993,100.00	2.21
30	601881	中国银河	3,952,873.35	2.19
31	300760	迈瑞医疗	3,942,324.00	2.18
32	300033	同花顺	3,883,200.00	2.15
33	600548	深高速	3,732,057.08	2.07
34	300119	瑞普生物	3,627,291.00	2.01
35	601229	上海银行	3,614,556.76	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	363,362,248.29
卖出股票的收入（成交）总额	284,380,537.50

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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。

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受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金未投资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	113,897.67
2	应收证券清算款	9,585,053.29
3	应收股利	-
4	应收利息	9,291.27
5	应收申购款	229,004.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,937,247.11

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
30,271	8,201.27	52,228,318.90	21.04%	196,032,393.31	78.96%

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	1,174,918.54	0.47%

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	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年9月14日）基金份额总额	409,913,619.78
本报告期期初基金份额总额	196,835,971.98
本报告期基金总申购份额	73,678,231.61
减：本报告期基金总赎回份额	22,253,491.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	248,260,712.21

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

本报告期内，经公司十届一次董事会会议审议通过，自 2019 年 4 月 22 日起，李常青先生正式离任公司督察长，由本基金管理人董事长林昌先生代任公司督察长。李常青先生自 2019 年 4 月 22 日起担任公司副总经理兼子公司执行董事。自李常青先生任子公司执行董事职务之日起，本基金管理人总经理包爱丽女士不再担任子公司执行董事。自 2019 年 5 月 9 日起，管江女士担任公司督察长，自管江女士任督察长职务之日起，本基金管理人董事长林昌先生不再代行督察长职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.7 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，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
光大证券	1	257,136,621.74	39.81%	239,471.55	40.33%	-
华信证券	1	388,805,537.27	60.19%	354,318.79	59.67%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

中邮证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期内新增方正证券（44136,002922）、天风证券（43750,007780）共4个交易单元，退出广发证券（61052）共1个交易单元。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

(3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照 (2) 中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准, 对备选的证券经营机构进行初步筛选;

对通过初选的各证券经营机构, 投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内, 对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分, 得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名, 拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构, 并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后, 由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

10.8.2 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		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
光大证券	-	-	1,658,300,000.00	100.00%	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.9 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	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	《证券日报》	2019-01-02
2	光大保德信基金管理有限公司关于部分代销机构暂停基金业务的公告	《证券日报》	2019-01-16
3	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《证券日报》	2019-01-19
4	光大保德信基金管理有限公司关于旗下代销机构名称变更的公告	《证券日报》	2019-02-15
5	光大保德信基金管理有限公司新增西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	《证券日报》	2019-03-22
6	光大保德信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	《证券日报》	2019-03-26
7	关于旗下部分开放式基金在中国中投证券有限责任公司开通基金定期定额投资并参与费率优惠的公告	《证券日报》	2019-03-27
8	光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费优惠活动的公告	《证券日报》	2019-03-30
9	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2018 年年度报告	《证券日报》	2019-03-30
10	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	《证券日报》	2019-03-30
11	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行电子银行费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019-03-30
12	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泰诚财富基金销售(大连)有限公司为代销机构并参与其费用优惠活动的公告	《证券日报》	2019-04-12
13	光大保德信基金管理有限公司关于旗下代销机构名称变更的公告	《证券日报》	2019-04-22
14	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《证券日报》	2019-04-22
15	光大保德信新增长混合型证券投资基金招募说明书摘要(更新)	《证券日报》	2019-04-26

16	光大保德信新增长混合型证券投资基金招募说明书（更新）	《证券日报》	2019-04-26
17	光大保德信基金管理有限公司关于旗下代销机构名称变更的公告	《证券日报》	2019-05-06
18	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为代销机构并参与其费用优惠活动的公告	《证券日报》	2019-05-15
19	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为代销机构并参与其费用优惠活动的公告	《证券日报》	2019-05-28
20	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在东莞农村商业银行股份有限公司开通定期定额投资及转换业务的公告	《证券日报》	2019-06-13
21	光大保德信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	《证券日报》	2019-06-13
22	光大保德信基金管理有限公司关于旗下代销机构名称变更的公告	《证券日报》	2019-06-14
23	光大保德信基金管理有限公司关于旗下代销机构名称变更的公告	《证券日报》	2019-06-21
24	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券日报》	2019-06-21
25	光大保德信基金管理有限公司关于调整通过网上交易平台（含移动端）办理赎回、转换业务的最低份额及保有最低份额的公告	《证券日报》	2019-06-28

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

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

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、中国证监会批准光大保德信新增长混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信新增长混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信新增长混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信新增长混合型证券投资基金托管协议

- 5、光大保德信新增长混合型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信新增长混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层本基金管理人办公地址。

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。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日