

【2018年第1号】

(二) 投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

(1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

(2) 国内外宏观经济形势及对中国证券市场走势的判断；

(3) 国家货币政策、产业政策以及证券市场的发展；

(4) 行业发展现状及前景；

(5) 上市公司基本面及成长前景；

(6) 股票、债券等各类资产的预期收益率及风险水平。

2、投资决策程序

本基金实行投资决策团队制，强调团队合作，充分发挥集体智慧。本基金管理人设研究和投资决策委员会，设立了投资研

[illegible][illegible]

除公允价值变动损益外,其他公允价值变动损益和公允价值变动损益计入公允价值变动损益。公允价值变动损益在资产负债表日,公允价值变动损益在公允价值变动损益科目中核算,公允价值变动损益在公允价值变动损益科目中核算,公允价值变动损益在公允价值变动损益科目中核算,公允价值变动损益在公允价值变动损益科目中核算。

本基金为人民币现钞基金,属于证券投资基金中货币市场基金品种。

七、基金的投资组合报告

基金管理人遵基金合同及基金管理人投资本基金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责任。

基金管理人于 2020 年 12 月 31 日按照基金合同的规定,于 2020 年 12 月 31 日对本基金在报告期的财务状况、投资组合和基金资产净值进行了审计,会计师事务所出具了标准无保留意见。

本报告期末基金资产净值 1,000,000.00 元,基金份额总额 10,000,000.00 份。

本报告期(2020 年 7 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日)。

投资组合报告

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	投资组合	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资		1,020,000.00	100.00
2	基金投资	其中:股票	1,020,000.00	79.58
3	固定收益投资		133,296.43	6.22
4	其中:债券		133,296.43	6.22
5	资产支持证券		-	-
6	贵金属投资		-	-
7	金融衍生品投资		-	-
8	买入返售金融资产		-	-
9	其中:买入返售金融资产		-	-
10	银行存款和结算备付金合计		372,167,279.71	17.36
11	其他资产		10,105,000.00	0.95
12	合计		2,144,226,044.20	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	0.00
B	医药	79,250.00	0.00
C	制造业	1,158,974,280.00	56.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,000.00	0.00

[illegible]

3	000033	兆润股份	4,380,000	150,229,744.11	0.11
4	000318	中国平安	3,500,000	189,408,764.01	0.09
5	000325	华信股份	7,000,001	189,462,852.85	0.04
6	000821	东方金钰	4,000,000	35,103,106.00	0.02
7	002672	索宝股份	322,121	422,714,216.00	2.78
8	601601	光大国际	2,860,000	156,260,000.00	0.06
9	000719	美利纸业	2,500,000	134,046,770.00	4.36
10	001012	康缘药业	3,000,000	103,147,022.00	4.49
11	002608	中信重工	2,000,000	81,392,043.00	3.07
12	002122	桐昆股份	5,200,000	18,050,000.00	4.07
1. 基金资产组合中公允价值计量项目					
序号	债券品种		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	(%)
1	国家债券		-	-	-

层	3	金融债券	-	-
		其中:政策性金融债	-	-
	4	企业债券	-	-
	5	企业短期融资券	-	-

[illegible][illegible]