

B064信息披露

(上接B063版)

		注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元1101室1101 法定代表人:李健 联系人:刘健 电话:0755-29250313 传真:0755-29250320 客服电话:400-320-0860 公司网址:www.jianzhu.com
98	深圳市金种子基金销售有限公司	注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元1101室1101 法定代表人:李健 联系人:刘健 电话:0755-29250313 传真:0755-29250320 客服电话:400-320-0860 公司网址:www.jianzhu.com
99	武汉市弘嘉基金销售有限公司	注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七楼23层14号414 法定代表人:周建 联系人:孔繁 电话:027-87060025 客服电话:027-87060003 网址:www.hongjia.com
100	北京汇成基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1101号 法定代表人:王刚 联系人:王刚 电话:400-619-0060 公司网址:www.hcfn.com.cn
101	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人:钱昊飞 联系人:王峰 电话:025-66996699-89726 传真:025-66996699 客服电话:95177 网址:www.snjfund.com
102	上海大智慧基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元 法定代表人:申健 联系人:邵明 电话:021-20219888 传真:021-20219888 客服电话:021-20290011 网址:http://www.wisdom.com.cn
103	北京广源达信基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层606室 办公地址:北京市朝阳区望京东四区13号绿地中心B座12层 法定代表人:李志刚 联系人:王爽 电话:010-57286334 客服电话:4006220000 传真:010-58265860 网址:www.jiayundaxin.com
104	上海中正达广基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙漕路190号201室202室 法定代表人:朱欣 联系人:程维 电话:021-33768132 客服电话:400-6767-523 网址:www.zhongzhengfund.com
105	海银基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室 办公地址:上海市浦东新区银城中路8号402室 法定代表人:刘翌 联系人:毛林 电话:021-80133697 传真:021-80133413 客服电话:400-808-1016 网址:www.haifund.com
106	深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201(人驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座 法定代表人:顾敏 联系人:陈云 电话:0755-89467221 客服电话:4009889877 网址:http://www.welink.com/
107	上海万得基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座 办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼 法定代表人:王廷富 联系人:李吉良 电话:021-51327185 传真:021-50710161 客服电话:400-621-0203
108	深圳前海凯恩斯基金销售有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(人驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金领大厦23A 法定代表人:高峰 联系人:廖嘉志 电话:0755-83865888 传真:0755-83865618 客服电话:4008048888 网址:www.kaynesasset.com
109	中民财富管理基金销售有限公司(上海)	注册地址:上海市黄浦区中山南路100号7楼605室 办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄正大大道1007号11楼27层 法定代表人:陈庆平 联系人:郭晓梅 电话:021-33357030 传真:021-63357376 客服电话:400-476-5716 网址:www.cmiwm.com
110	天津国美基金销售有限公司	注册地址:天津经济技术开发区南业工业园区综合服务区办公大楼二层202-124室 办公地址:北京市朝阳区霞云路30号鹏润大厦B座10层 法定代表人:丁东华 联系人:李海霞 电话:010-59287894 传真:010-59287825 客服电话:4001110889 网址:www.gomefund.com
111	北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区阜成门外大街11号B座1002室 办公地址:北京市东城区东直门内大街11号B座1002室 法定代表人:李健 联系人:李健 电话:010-61940638 传真:010-61940639 客服电话:400-0618158 网址:http://danjuanapp.com/
112	上海煜耀基金销售有限公司	注册地址:上海市崇明县长兴镇潘涇公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发区) 办公地址:上海市杨浦区昆山路518号A1002室 法定代表人:王期 联系人:王期 电话:021-65707077 传真:021-65808891 客服电话:4000260369 网址:www.yuanyuanfund.com
113	南京途牛基金销售有限公司	注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号 办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号 法定代表人:宋时琳 联系人:王健 电话:025-40083999 传真:025-89833960 客服电话:4007-099-999 网址:http://tuniu.com
114	上海恒钰基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区城南路新嘉路242号恒钰101室 办公地址:上海市浦东新区浦东南路370号金地大厦14楼C座 法定代表人:胡天明 联系人:李强 电话:021-50793659 传真:021-68413161 客服电话:4008060967 网址:http://www.hycfund.com/
115	凤凰金(银川)基金销售有限公司	注册地址:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海中央商务区万寿路142号1402 办公地址:北京市朝阳区景泰路18号院润峰科技园B座1001室 法定代表人:张旭 联系人:陈旭 电话:010-58160168 传真:010-58160173 客服电话:400-850-6519 网址:www.fenghuang.com
116	北京微动利基金销售有限公司	注册地址:北京市石景山区古城街道113号院11层1101室 办公地址:北京市石景山区古城街道113号院11层1101室 法定代表人:李长军 联系人:李长军 电话:010-52606651 传真:010-51587430 客服电话:400-819-8995 网址:www.bjwonderfund.com
117	北京广信信基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区东三环北路19号70109室 办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号70109室 法定代表人:李悦 联系人:曹庆良 电话:010-69881311 传真:010-69881323 客服电话:400-066-8586 网址:www.guoxin.com
118	北京瑞特瑞德资产管理有限责任公司	注册地址:北京市西城区中关村东路66号1号楼B22层2003-06 办公地址:北京市西城区金融大街33号新泰大厦B座10层 法定代表人:陈超 联系人:王立升 电话:010-88188000 客服电话:95118 网址:www.ruitiede.com
119	上海明义永续基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区上封路977号11幢B座12室 法定代表人:陈超 联系人:陈超 电话:021-20838988 传真:021-20838988 客服电话:400-820-1515 网址:www.amcfund.com
120	上海云湾基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼888室 办公地址:北京市西城区金融大街33号新泰大厦B座10层 法定代表人:李梅 联系人:李梅 电话:010-88188000 客服电话:95118 网址:www.ruitiede.com
121	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼888室 办公地址:北京市西城区金融大街33号新泰大厦B座10层 法定代表人:李梅 联系人:李梅 电话:010-88188000 客服电话:95118 网址:www.ruitiede.com
122	上海云湾基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼888室 办公地址:北京市西城区金融大街33号新泰大厦B座10层 法定代表人:李梅 联系人:李梅 电话:010-88188000 客服电话:95118 网址:www.ruitiede.com

123	上海挖财金融信息服务有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室 法定代表人:文雪琴 联系人:文雪琴 电话:021-50810887 传真:021-50800270 客户服务电话:021-50810673 网址:http://www.wacai.com.cn
124	深圳弘实智慧基金销售有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址:深圳市福田区东三环路北2号南大厦2009 法定代表人:张秋林 联系人:张秋林 电话:010-64108876 传真:010-64108875 客户服务电话:010-64108876 网址:http://fund.hongshifund.com
125	大同财基基金销售有限公司	注册地址:贵州省贵阳市南明区新街路110-134号中国国际广场16楼201室212室 办公地址:贵州省贵阳市南明区新街路110-134号中国国际广场16楼201室212室 法定代表人:王叔 联系人:方国良 电话:0851-89406006 传真:0851-89406009 客户服务电话:0851-89226758 网址:www.dongtai.com.cn
126	天津万家财富资产管理有限公司	注册地址:天津市自贸区(中心商务区)别克大道1989号滨海浙商大厦A-2413室 办公地址:天津市西城区丰盛国际28号太平洋保险大厦5层 法定代表人:李修峰 联系人:王芳芳 电话:022-58013942 传真:022-38906335 客户服务电话:010-58013825 网址:www.wanjiawang.com
127	北京电盈基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区车公庄大街9号101室 办公地址:北京市东城区朝阳门内大街136号顺泰大厦1122室 法定代表人:李志刚 联系人:李志刚 电话:010-57286334 客服电话:4006220000 传真:010-58265860 网址:www.diyinfund.com
128	通华(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区同丰路667号107室201室 办公地址:上海市浦东新区高东一路799号陆家嘴软件园1533号3号楼楼 法定代表人:杨俊 联系人:杨俊 电话:021-60018249 客服电话:021-65156156 网址:www.tonghuafund.com
129	嘉聘时基金销售有限公司	注册地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室 办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室 法定代表人:陈皓 联系人:曹明 电话:021-80133413 客服电话:400-808-1016 网址:www.jiapin.com
130	济安财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座15层 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座15层 法定代表人:杨文 联系人:李海霞 电话:010-65206916 传真:010-65206919 客户服务电话:400-673-7010 网址:www.jianfortune.com
131	华信期货股份有限公司	注册地址:郑州市郑东新区商务内环东27号1号楼1单元301室、2单元302室 办公地址:郑州市郑东新区商务内环东27号1号楼1单元301室、2单元302室 法定代表人:李强 联系人:李强 电话:0371-69106882 传真:0371-69106885 客户服务电话:400-6197-696 网址:http://www.hxinfo.com
132	洪泰财富(青岛)基金销售有限公司	注册地址:山东省青岛市香港东路196号9号楼701室 办公地址:北京市西城区西什库大街31号邦信大厦B座601室 法定代表人:王敬 联系人:王敬 电话:010-66162000 传真:0532-66728591 客户服务电话:4006700883 网址:www.hongtaifund.com
133	上海有鱼基金销售有限公司	注册地址:上海自由贸易试验区南汇区东大路2123号3层303-265室 办公地址:上海浦东新区桂桥路391号康桥国际大厦1002室 法定代表人:林强 联系人:徐海峰 电话:021-60807279 传真:021-60807279 客户服务电话:021-60807378 网址:www.youyufund.com
134	深圳盈信基金销售有限公司	注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路龙光大厦1101室(11-012) 办公地址:大连市中山区南山155号南山1910小区A2-1 法定代表人:李强 联系人:李强 电话:0411-69888805 传真:0411-69888827 客服电话:4007-3003-688 网址:www.yingxinfund.com
135	中收钱袋基金销售有限公司(上海)有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号28层 办公地址:上海市虹口区公平路18号8幢嘉里大厦1101室 法定代表人:李欣 联系人:李欣 电话:021-69006000-5905 传真:021-33830551 客服电话:400-700-9700(钱袋理财专线) 网址:https://www.qianguangun.com/
136	民商基金销售有限公司(上海)有限公司	注册地址:上海黄浦区北京东路666号A区(东源108C3室) 办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦33楼 法定代表人:董思 联系人:董思 电话:138-2642-0174 传真:021-50206001 客服电话:4000260369 网址:http://www.mtrcc.com
137	北京百度百盈基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区上地十街10号11幢1层101 办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号世纪科贸大厦 法定代表人:李强 联系人:李强 电话:010-61940638 传真:010-61940639 客服电话:400-700-9700(钱袋理财专线) 网址:https://www.qianguangun.com/

基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二) 登记机构

名称:景顺长城基金管理有限公司
住 所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人:丁益
电 话:0755-82373888-1902
传 真:0755-22313125
联系人:曹霞
(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、孙睿
联系人:孙睿
(四) 审计基金财产的会计师事务所
法定名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖山路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:许康伟、朱宏宇

四、基金的名称

景顺长城基金新动力股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金

基金的投资目标

本基金通过量化模型精选股票,在有效控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含中小企业私募债)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-20%,其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的保证金后,基金投资于股票资产不低于基金资产净值的95%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

本基金股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%,大类资产配置不作为本基金的核心策略,一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定,在综合考虑系统性风险、各类资产收益风险比、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后,对基金资产配置做出适当调整。

本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果,基金管理人结合市场环境 and 股票特性,精选个股进行投资组合,以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。

超额收益模型:该模型通过构建多因子量化系统,综合评价估值、市场趋势、盈利、企业质量、投资者情绪等多个因素,以自下而上为主,自上而下为辅,分辨各

类资产和各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值,定价过高的资产应当考虑回避。

风险模型:该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口,包括基金规模、资产波动率、行业集中度等,力求主动将风险控制在目标范围内。

成本模型:该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场中市成、印花税、佣金等数据测算本基金的交易成本,追求有效控制基金的换手率。

3、债券投资策略

出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量,本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况,采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度,确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率,确定债券资产配置。

4、权证、股指期货投资策略

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率和交易成本。

5、中小企业私募债券的投资

对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金会加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽的调研和分析。

6、资产支持证券的投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时,基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,考虑选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

九、基金的业绩比较基准

MSCI中国A国际指数(MSCI China A International Index)收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的投资风格及风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,基金管理人将在与托管人协商一致后可变更业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

基金管理人及董事、监事、高级管理人员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责任。

基金托管人根据本基金合同规定,已经复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2018年12月31日,本报告中所有财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	609,850,471.38	93.31
2	其中:股票	609,850,471.38	93.31
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	911,214.56	0.14
9	合计	610,761,685.94	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	8,870,394.00	1.36
B	采矿业	18,646,115.00	2.97
C	制造业	280,783,100.95	40.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,497,901.71	1.00
E	建筑业	22,510,019.92	3.46
F	批发和零售业	26,567,367.14	4.08
G	交通运输、仓储和邮政业	3,928,006.00	0.60
H	住宿和餐饮业	6,625,288.60	1.00
I	信息技术、软件和信息技术服务业	13,885,258.00	2.13
J	金融业	168,785,144.99	25.94
K	房地产业	50,719,890.12	7.79
L	租赁和商务服务业	6,651,319.40	1.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,313,265.46	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,229,561.10	0.50
R	文化、体育和娱乐业	8,430,883.00	1.30
S	综合	1,505,271.00	0.23
合计		609,850,471.38	93.71

2.2报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

3.报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	532,000	26,945,200.00	4.10
2	601166	兴业银行	1,798,600	26,874,084.00	4.13
3	601288	农业银行	6,937,400	24,974,640.00	3.94
4	601818	光大银行	5,830,400	21,572,400.00	3.31
5	601229	工商银行	1,872,984	20,568,690.96	3.22
6	000061	格力电器	575,700	20,546,723.00	3.16
7	600585	海螺水泥	693,182	20,296,368.96	3.12
8	600031	三一重工	2,394,500	19,970,130.00	3.07
9	600028	中国石化	3,692,300	18,646,115.00	2.87
10	601698	华泰证券	1,123,000	18,192,600.00	2.80

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.报告期末基金未持有债券。

6.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债券投资明细

7.报告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

8.基金本报告期末未持有贵金属。

9.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权证投资明细

10.基金本报告期末未持有权证。

11.报告期末基金投资股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率和交易成本。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.投资组合报告附注

11.1

1.光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”,股票代码:601818)于2018年11月9日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字(2018)10号)。其因违反资产管理严重违反审慎经营规则,以误导方式违规销售理财产品,以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品,违规以类信贷业务收费或提供低价不符的服务,同业投资违规接受担保,通过同业投资或贷款赠礼存款规模,违反了《商业银行理财产品销售管理办法》第五章、《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、《商业银行理财产品销售管理办法》第十三条、第六十条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条等,被处以没收违法所得100万元,罚款1020万元,合计1120万元。

本基金基金经理理谢理基金合同及投资管理,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对光大银行进行了投资。

2.上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”,股票代码:601229)因对底层资产为非标准化债权资产的投资提前尽职调查严重审慎,部分理财资金用于增资和交叉土地出让金,与合同约定用途不一致的问题,于2018年1月4日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银监罚决字(2018)1号),被处以责令改正,并处罚款人民币750万元。因内部管理与控制制度不健全或执行监督不力,于2018年10月8日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银监罚决字(2018)49号),被处以责令改正,并处罚款人民币50万元。因违反业务规定,违反了《中华人民共和国商业银行法》第七十四条第(八)项,于2018年10月18日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银监罚决字(2018)54号),被处以责令改正,并处罚款人民币109460.03元。

本基金基金经理理谢理基金合同及投资管理,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对上海银行进行了投资。

3.兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”,股票代码:601166)于2018年04月19日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字(2018)1号)。其因违反审慎经营规则,违规流贷信贷资产;信息披露及资料、文件等上报违规;违规办理同业业务;从事场外配资;未经任职资格审查或兼任重要、高级管理人员、首席代表;商业银行个人理财业务违规等,违反了《商业银行与内部人和股东关联交易管理办法》、《中华人民共和国银行业监督管理法》、《商业银行内部控制指引》、《商业银行房地产贷款风险管理指引》等相关规定,被处以罚款5870万元。

本基金基金经理理谢理基金合同及投资管理,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对兴业银行进行了投资。

4.其余七名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	143,417.64
2	应收证券清算款	227,069.02
3	应收股利	-
4	应收利息	10,072.36
5	应收申购款	530,655.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	911,214.56

11.4报告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。

11.5报告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。

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分无。

十二、基金的业绩

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。投资者有风险,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。基金业绩数据截至2018年12月31日。

1、净值增长率与同期业绩比较基准比较表

阶段	净值增长率(1)	净值增长率(2)	业绩比较基准收益率(3)	(1)-(3)	(2)-(4)
2016年	6.90%	0.72%	0.14%	6.76%	0.02%
2017年	35.55%	0.65%	15.05%	20.46%	0.08%
2018年	-19.81%	1.31%	-26.76%	6.95%	0.04%
2016年7月13日至2018年12月31日	16.20%	1.00%	-15.59%	31.79%	0.05%

2.累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较

注:本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-20%,其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2016年7月13日基金合同生效之日起6个月。建仓期结束后,本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

十三、基金费用概览

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费;

4.《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金的证券、期货交易费用;

7.基金的银行汇划费用;

8.证券、期货账户开户费用和账户维护费;

9.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

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

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3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。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

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3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。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

(三)与基金