

(2019年第1号)

时,本基管理人有权以不超过前次募集资金总额的10%对基金资产进行垫款,但要求基金管理人提供相应的担保。

本基金为现金基金,以申购赎回款和赎回款水平于投资者垫款,属于于投资者垫款基金,属于中低风险、低风险的投资基金。

十一、基金投资范围和投资限制

基金管理人及基金托管人保证本基金所投资资产不存在任何违反法律法规或基金合同规定的行为,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。

本基金投资于中国境内依法发行或经中国证监会核准的基金合同,于2019年4月17日更新了本基金的投资材料,净值表现和投资组合符合各内容,但本基金内容中不存在任何虚假记载、误导性陈述。

本基金投资组合资产配置数据截至2020年3月31日“投资组合”,本报告期内未发生业务变更。

1. 投资组合资产配置数据

资产类别	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
货币市场基金	货币市场基金	1,000,000.00	100.00

1	股权投资	991,329,274.68	103.57
2	债权投资	991,329,274.68	103.57
3	其他权益工具投资	46,761,770.00	4.83
4	其他债权投资	46,761,770.00	4.83
5	金融资产减值准备	-	-
6	非货币性金融资产	-	-
7	以公允价值计量的买入返售金融资产	-	-
8	衍生金融资产和负债公允价值	30,280,200.00	3.12
9	其他金融资产	1,351,770.00	0.14
10	合计	1,970,861,795.36	204.00

[illegible]

5	000080	康平高科	3,789,700	61,620,522.00	5.79
6	000072	中航高新	1,006,995	58,747,114.28	5.58
7	002179	中航光电	1,363,399	54,616,483.76	5.13
8	300235	国瓷材料	2,436,240	52,321,756.00	5.01
9	000919	贵州茅台	169,548	50,880,854.56	4.76
10	000063	中兴通讯	1,471,600	42,590,720.00	4.04

9. 期末按公允价值计量的金融资产投资组合			
	公允价值(元)		占基金资产净值比例(%)
1	交易性金融资产	-	-
2	应收票据	-	-
3	应收账款	47,401,733.00	4.86
4	应收利息	47,401,733.00	4.86
5	应收股利	-	-
6	应收资产支持证券	-	-
7	其他应收款(可交易类)	-	-
8	其他应收款	-	-
9	其他	47,401,733.00	4.86

6. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名金融资产持仓信息

序号	股票代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101812	国债逆回购	600,000	60,110,000.00	3.27
2	010006	国债逆回购	73,390	7,330,733.01	0.80

注：(1) 报告期内本基金投资的前十名证券中，无属同一发行人；

6. 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持仓信息

报告期内，本基金未持有资产支持证券。

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金融衍生品持仓信息

报告期内，本基金未持有金融衍生品。

8. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属持仓信息

报告期内，本基金未持有贵金属。

9. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证持仓信息

报告期内，本基金未持有权证。

10. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券回购持仓信息

报告期内，本基金未持有债券回购。

(3) 投资组合报告附注

报告期内，本基金投资的前十名证券中不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体被公开谴责、处罚的情况。

报告期内，本基金投资的前十名证券中，没有涉及基金合同投资范围的投资品种之外的投资。

(四) 投资组合报告

	名称	公允价值(元)
1	存出保证金	177,208.20
2	应收证券清算款	177,208.20
3	应收利息	-
4	应收股利	0.00

5	应收账款	319,686.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,421,717.89

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券余额

[illegible]

注：1.本基金转型日期为2014年4月4日。
2.原基金合同对申购费率的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二）（二）投资范围即（四）投资限制的有关约定。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1.基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

（1）基金管理人管理费。

[illegible]

本基金基金份额赎回费率按赎回金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M<100万元	1.5%
50万元≤M<1000万元	1.2%
1000万元≤M<5000万元	0.8%

[illegible]

持有期限(T)	赎回费率
T<7天	1.5%
7天≤T<30天	0.75%
30天≤T<90天	0.50%
90天≤T<180天	0.25%
T≥180天	0

[illegible]

注：本基金前产业债、固定收益类资产、固定收益信用等级债、固定收益的混合、固定收益纯债类债券A、固定收益纯债类债券C、固定收益货币宝、固定收益货币宝C、固定收益货币B、固定货币A、固定货币B、固定短期理财债券A、固定多元债资产A、固定多元债资产B、固定信用债资产A、固定信用债资产B、固定周期优选股票A、固定现金类资产A、固定现金类资产B、固定纯债类资产A、固定纯债类资产B、固定货币B、固定货币C中期基金合长期权益类(LDF)、固定中证中长期价值指数(LDY)为单只单一公募基金账户下的单一认购人份额，固定增长组合B、固定货币型组合基金等符合中国证监会相关业务。具体详见基金网站相关公告，定期并放类基金已在规定时间内转换。

(四)中国证监会批准的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，不高于基金份额持有人%，具体计提方法、计提标准和在招募说明书和相关法律文件中载明。

(三) 不得列入基金费用的项目

[illegible]