（上接B121版）

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	17,539,200.00	2.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	356,989,310.95	52.02
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	176,363,223.54	25.70
J	金融业	134,343.00	0.02
K	房地产业	113,664.00	0.02
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	651,139,741.49	80.32

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。
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	000063	中兴通讯	1,287,470	37,010,124.00	5.39
2	002180	纳思达	1,154,091	36,365,407.41	5.30
3	002174	游族网络	1,515,300	36,064,140.00	5.26
4	002368	太极股份	791,233	29,584,201.87	4.31
5	300659	中孚信息	924,100	29,312,452.00	4.27
6	600050	中国联通	4,153,687	28,203,534.73	4.11
7	600760	中航沈飞	626,400	20,520,864.00	2.99
8	002281	光迅科技	612,100	19,317,876.00	2.82
9	002123	梦网集团	1,504,000	19,085,760.00	2.78
10	300546	雄帝科技	591,604	18,747,930.76	2.73

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	42,781,709.20	6.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	95,927,587.40	13.98
	其中:政策性金融债	95,927,587.40	13.98
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	138,709,296.60	20.21

5.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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21国债(7)	404,940	41,781,709.20	6.09
2	170205	17国开05	400,000	40,496,000.00	5.90
3	018005	国开1701	350,000	35,003,500.00	5.10
4	018006	国开1702	199,610	20,428,087.40	2.98
5	019537	16国债09	10,000	1,000,000.00	0.15

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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. 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。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的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
本基金本报告期末无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
本基金本报告期末股票投资比例达到或接近基金的主要投资原则，并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。
（2）决策程序
①决定主要投资原则：投资决策委员会决定基金的主要投资原则，并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。
②提出投资建议：研究部研究员以内外部研究报告、实地调研以及其他信息来源作为参考，对宏观经济运行状况、行业发展趋势和个股基本面进行深度研究，在研究员所覆盖的行业内精选个股进行推荐，结合市场走势和情绪根据基金经理提出的要求对各类投资品种提出投资建议。
③制定投资决策：基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。
④进行风险评估：风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估，并出具风险监控报告。
⑤评估和调整决策程序：基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

§9 基金业绩比较基准

沪深300指数收益率×60%＋上证国债指数收益率×40%
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的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会。

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	-	-
B	采矿业	2,872,896.00	1.53
C	制造业	130,074,849.39	69.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,431,132.00	0.76
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	296,200.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	592,342.94	0.31
J	金融业	14,451,073.00	7.68
K	房地产业	19,027,246.24	10.11
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	17,290.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	168,762,028.57	89.71

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。
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	600958	东方证券	814,000	9,702,880.00	5.16
2	300750	宁德时代	104,416	8,875,360.00	4.72
3	002594	比亚迪	165,600	8,857,944.00	4.71
4	603486	科沃斯	127,300	7,755,116.00	4.12
5	002896	沃特股份	313,400	7,358,632.00	3.91
6	600383	金地集团	480,500	6,606,875.00	3.51
7	001979	招商蛇口	277,981	6,404,682.24	3.40
8	002759	天际股份	653,900	6,290,518.00	3.34
9	002810	山东赫达	245,132	6,189,583.00	3.29
10	002796	世嘉科技	123,200	6,097,168.00	3.24

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	18,572,400.00	9.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,202,020.00	10.74
	其中:政策性金融债	20,202,020.00	10.74
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	38,774,420.00	20.61

5.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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	202,000	20,202,020.00	10.74
2	010107	21国债(7)	180,000	18,572,400.00	9.87

注:上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。
6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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. 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。
8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的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
本基金本报告期末无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
本基金本报告期末股票投资比例达到或接近基金的主要投资原则，并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。
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
本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。
10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。
10.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期没有投资国债期货。
11.报告附注
11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，
在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
11.2基金投资的前十名股票均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	136,782.92
2	应收证券清算款	181,369.32
3	应收股利	-
4	应收利息	881,247.46
5	应收申购款	39,322.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,238,722.69

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未存在流通受限情况。
11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
泰达宏利基金管理有限公司
2019年6月6日

（上接B119版）

101	北京创金启富基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址:北京市西城区白纸坊东街2号 经济日报社综合楼A座712室 法定代表人:梁春 联系人:魏素清 电话:010-66154828-8006 传真:010-63638991 客服电话:400-6262-818 网址:www.5irich.com
102	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4楼 法定代表人:惠晓川 联系人:刘晖 电话:021-60206991 传真:021-80133413 客服电话:400-808-1016 网址:www.fundhaiyin.com
103	北京植信基金销售有限公司	注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67 办公地址:北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼 法定代表人:于龙 联系人:吴鹏 电话:010-56075718 传真:010-67767615 客服电话:4006-802-123 网址:http://www.zhixin-inv.com
104	上海大智慧基金销售有限公司	注册地址:上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层 办公地址:上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层 法定代表人:申健 联系人:张敏 电话:021-20219988(35346) 传真:021-20219923 客服电话:021-20219931 网址:http://www.wg.com.cn
105	上海联泰基金销售有限公司	注册地址:中国（上海）自由贸易试验区葵涛北路277号3层310室 办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层 法定代表人:尹彬彬 联系人:陈东 电话:021-52822063 传真:021-52975270 客服电话:400-166-6788 网址:http://www.66lianti.com
106	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区富川路5475号1033室 办公地址:上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层 法定代表人:李兴春 联系人:陈克明 电话:18516109631 传真:021-61101630 客服电话:95733 网址:www.leadfund.com.cn
107	汇付基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 上海市凤凰区中山南路100号金外滩国际广场19楼 法定代表人:金佶 联系人:陈云卉 电话:021-33323999 传真:021-33323837 客服电话:400-821-3999 网址:http://fixpower.com
108	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 法定代表人:陈洪生 联系人:梁云波 电话:0592-3122757 传真:0592-3122701 客服电话:400-918-0808 网址:www.xdcs.com.cn
109	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人:王之光 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com
110	北京加和基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层 办公地址:北京市西城区金融街11号703 法定代表人:徐福贺 联系人:张巍 电话:010-5086 6176 传真:010-5086 6173 客服电话:400-600-0030 网址:www.bzfunds.com
111	北京虹点基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元 办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元 法定代表人:郑毓栋 联系人:陈若拙 电话:010-65051887 客服电话:400-618-0707 网址:www.hongdianfund.com
112	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层-18室 办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层18室 法定代表人:李彤阳 联系人:吴翼 电话:010-60619607 客服电话:010-62675369 网址:http://www.xincai.com
113	珠海盈米基金销售有限公司	注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址:广州市海珠区琶洲大道89号保利国际广场南塔12楼 1201-1203室 法定代表人:肖雯 联系人:邱湘湘 电话:020-89629099 传真:020-89629011 客服电话:020-89629066 网址:www.yingmi.cn
114	深圳富济基金销售有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元 办公地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元 法定代表人:刘鹏宇 联系人:刘勇 电话:0755-83999907-8814 传真:0755-83999926 客服电话:0755-83999907 网址:www.fujifund.cn
115	北京唐鼎耀华基金销售有限公司	注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2楼236室 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室 法定代表人:张记宇 联系人:王丽敏 电话:010-85932810 客服电话:400-819-9868 网址:http://www.tdyhfund.com
116	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 法定代表人:陈楚武 联系人:阎慈辉 电话:021-63333389-230 传真:021-63333390 客服电话:4006-433-389 网址:www.vstonewealth.com
117	大泰金石基金销售有限公司	注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室 办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方地一大厦15楼 法定代表人:袁顺明 联系人:孟召杜 电话:15621569619 传真:021-20220799 客服电话:400-928-2266/021-22267995 网址:www.dtfunds.com
118	济安财富（北京）基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307 办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307 法定代表人:杨健 联系人:李薇薇 电话:010-65309516 传真:010-65330699 客服电话:400-673-7010 网址:http://www.jianfortune.com
119	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室 办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F 法定代表人:钱昊昊 联系人:孙爱 电话:010-59336519 传真:010-59336500 客服电话:4008-909-998 网址:www.jrjc.com
120	鼎信汇金（北京）投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区太月园3号楼5层5层21室 办公地址:北京市海淀区太月园3号楼5层5层21室 法定代表人:齐凌峰 联系人:郭志凌 电话:010-82050520 传真:010-82086110 客服电话:400-158-5050 网址:www.9ifund.com
121	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1108 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号1108 法定代表人:王伟刚 联系人:上铁路 电话:010-56282140 传真:010-62630227 客服电话:4006199059 网址:www.hcjjin.com
122	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 办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人:钱燕飞 联系人:王锋 电话:025-66996699-887226 传真:025-66996699 客服电话:95177 网址:www.snjijin.com
123	北京广源达信投资管理有限公司	注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室 办公地址:北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层 法定代表人:齐剑辉 联系人:姜英华 电话:4006236060 传真:010-82065860 客服电话:4006236060 网址:www.niuniufund.com
124	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:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼 法定代表人:王廷富 联系人:徐亚丹 电话:021-50717262 传真:021-50710161 客服电话:400-821-0203
125	北京展卷基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 法定代表人:韩梁梁 联系人:侯芳芳 电话:010-61840688 传真:010-61840699 客服电话:4009109928 网址:https://www.danjuanapp.com
126	上海云湾基金销售有限公司	注册地址:中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区 办公地址:中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区 法定代表人:冯姚明 联系人:王宇 电话:021-20638888 传真:021-20638999 客服电话:400-820-1515 网址:www.zhengtongfunds.com
127	上海中正达广基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 法定代表人:黄庆 联系人:戴凯微 电话:021-33768132 传真:021-33768132-802 客服电话:400-6767-523 网址:www.zhongzhengfund.com
128	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:贺杰 电话:025-86853969-66727 客服电话:4007-999-999 网址:http://jr.tuniu.com
129	上海基煜基金销售有限公司	注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6152室(上海泰和经济发展区) 办公地址:上海市昆明路518号北美广场A栋1002-1003室 法定代表人:王翔 联系人:孟杰 电话:021-35385621 传真:021-65085991 客服电话:400-820-5369 网址:www.jiyufund.com.cn
130	深圳市金斧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11层1108 办公地址: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11层1108 法定代表人:魏任军 联系人:刘新假 电话:0755-26320613 传真:0755-26920630 客服电话:400-9302-888 网址:www.jfzinv.com
131	北京肯特瑞基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部A座17层 法定代表人:江卉 联系人:徐怡宏 电话:010-89188356 传真:010-89189566 客服电话:95118 网址:kenterfund.com
132	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268室 办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层 法定代表人:毛淮平 联系人:仲秋玥 电话:010-88066632 传真:010-88066552 客服电话:400-817-5666 网址:www.amcfortune.com
133	大同财富基金销售有限公司	注册地址:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层12号 办公地址:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层12号 法定代表人:王民 联系人:潘健 电话:0851-88406506 传真:0851-88406002 客服电话:0851-88235678 网址:www.urainf.com
134	和耕传承基金销售有限公司	注册地址:郑州市郑东新区东风南路东康宁街北6号楼503 办公地址:郑州市郑东新区东风南路东康宁街北6号楼503 法定代表人:王俊 联系人:胡静怀 电话:0371-85518396 传真:0371-85518397 客服电话:4000-555-671 网址:http://www.hgccpb.com/
135	大连网金基金销售有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层2202室 办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层2202室 法定代表人:卜勇 客服电话:4000-899-100 网址:http://www.yibaijin.com/
136	腾安基金销售（深圳）有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区的南一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址:深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦16楼 法定代表人:刘明军 联系人:谭广臻 电话:0755-86013388转80618 传真:/ 客服电话:95017 网址:www.tenganxinxi.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1幢1层101 办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦 法定代表人:张旭阳 客服电话:95055 网址:https://licai.baidu.com/ 邮编:100085
138	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.2 登记机构南方基金管理股份有限公司
住所及办公地址:深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼
法定代表人:张海波
电话:（0755）82763849
传真:（0755）82763889
联系人:古和鹏
3.3 出具法律意见书的律师事务所
北京市盈科（深圳）律师事务所
注册地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座3层
负责人:姜敏
电话:(0755) 88604192
传真:(0755) 88604192
经办律师:戴瑞冬、付强
3.4 审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所: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:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系人:曹阳
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:薛亮、曹阳

§4 基金名称

南方新兴龙头灵活配置混合型证券投资基金

§5 基金的类型

混合型证券投资基金

§6 基金的投资目标

在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。

§7 基金的投资范围

本基金的投资范围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（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%。本基金投资于新兴龙头主题证券的比例不低于本基金非现金资产的80%。债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的5%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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。

§8 基金的投资策略

8.1 投资策略
1、资产配置策略
本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
2、股票投资策略
本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向，争取抓住新经济成长，努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。
本基金“新兴龙头”主题主要是指战略性新兴产业中的企业和各行业中的龙头企业。战略性新兴产业包括节能环保、新兴信息产业、生物产业、新能源、新能源汽车、高端装备制造业和新材料等产业。龙头企业是指在某个行业中，规模较大、经济效益好、带动能力强、产品具有市场竞争优势，对同行业的其他企业具有一定影响、号召力和一定的示范、引导作用，并对该地区、该行业或者国家做出贡献的企业。
股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。
1）定性分析
在定性分析方面，本基金主要挑选全部或部分具备以下特征的上市公司:
A、新经济体制下受益于改革，分享改革红利的优质企业;
B、公司所处的行业符合国家的战略发展方向，并且公司在行业中具有明显的竞争优势;
C、具备一定竞争壁垒的核心竞争力;
D、公司具有良好的治理结构，从大股东、管理层到中层业务骨干有良好的激励机制，并且企业的信息披露公开透明;
E、公司具有良好的创新能力。
2）定量分析
本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。
A、成长性指标:营业利润增长率、净利润增长率和收入增长率等;
B、财务指标:毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、经营活动净收益/利润总额等;
C、估值指标:市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值。
3）组合股票的投资吸引力评估方析
本基金利用相对价值评估，形成最终的股票组合进行投资。相对价值评估主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，将国内上市公司的有关估值与国际公司相应指标进行比较，选择其中价值被低估的公司。本基金采用包括自由现金流贴现模型、股息贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA等估值方法。力争选择最具有投资吸引力的股票构建投资组合。
4）投资组合构建与优化
基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化，同时监控组合中证券的估值情况，在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。
3、债券投资策略
在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用放大操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。
本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资人数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。
4、权证投资策略
本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理价值水平，主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。
基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。
5、股指期货等投资策略
本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。
6、资产支持证券投资策略
资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
8.2 投资决策依据和决策程序
（1）决策依据
①国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提;
②宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础;
③投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本基金维护投资人利益的重要保障。
（2）决策程序
①决定主要投资原则:投资决策委员会决定基金的主要投资原则，并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。
②提出投资建议:研究部研究员以内外部研究报告、实地调研以及其他信息来源作为参考，对宏观经济运行状况、行业发展趋势和个股基本面进行深度研究，在研究员所覆盖的行业内精选个股进行推荐，结合市场走势和情绪根据基金经理提出的要求对各类投资品种提出投资建议。
③制定投资决策:基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。
④进行风险评估:风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估，并出具风险监控报告。
⑤评估和调整决策程序:基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

§9 基金业绩比较基准

沪深300指数收益率×60%＋上证国债指数收益率×40%
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的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会。

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	7,665,280.00	5.57
B	采矿业	-	-
C	制造业	64,984,616.54	47.23
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	32,902.94	0.02
J	金融业	43,912,858.39	31.92
K	房地产业	1,988,135.00	1.45
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	66,837.76	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作