

信息披露

(上接B048版)

基金经理小组和投资决策委员会之外,公司还有专门的经济金融研究员,负责分析市场趋势、宏观、进出口、政策、利率、汇率以及政府政策等因素,为资产配置提供技术支持。公司还设有固定收益、衍生品等投资研究。

2.资产配置决策

投资决策委员会定期或不定期内证券市场的基本走势,决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围。基金经理小组在投资决策委员会决定的资产配置比例范围内,决定基金的具体资产配置。

3.组合构建

基金经理小组根据研究报告提交投资报告,结合自己的研究判断,决定具体的投资品种并决定买卖时机,其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批。对于拟投资的个股,基金经理小组将长期关注,择机介入的方法,以期买入成本、控制投资风险。对于买入的股票,基金持有期间,基金经理小组将对标的操作策略能有效降低基金的交易费用和交易成本,从而提高基金的投资收益水平。

4.交易执行

基金经理负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责,监控内容包括基金资产配置、个股投资比例等。

5.风险控制与评估

风险管理部定期或不定期对基金进行风险和绩效评估,并提供相关报告。风险部使用投资决策委员会和基金经理小组定期了解所持仓的风险水平以及是否符合既定的投资策略,该评估能够确保组合是否实施了投资限制,组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理小组可以及时跟踪和调整,从而调整投资组合。

6.组合监控与报告

基金经理小组跟踪经济状况、证券市场及上市公司的变化,结合基金申购赎回和现金流入流出情况,以及组合风险和绩效评价的结果,对投资组合进行监控和调整,使之不断得到优化。基金经理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据市场变化和实际需要对上述投资组合进行调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

(二) 投资策略

1. 股票投资策略

本基金投资于我国境内依法发行、具有良好增长潜力的成长型上市公司发行的股票,从基本面的分析入手,挑选成长性、具有以下特点的公司作为基金重点投资的对象:①公司所处的行业发展的良好;②公司在行业处于领先地位,具有持续竞争优势和实力;③能充分运用行业发展新机,保持领先;④公司的经营模式或创新能力持续相对优势;⑤了解市场并能够不断推出新产品,真正满足市场需求;⑥公司治理规范且有较好的激励机制,能够对外部变化迅速作出反应。

本基金建立了一套基于成长性的上市公司综合评价指标体系,以上市公司过去两年的历史成长性作为主要指标,以成长型公司为核心,通过上市公司可行成长性及其在行业中的领先地位,包括盈利能力、市场占有率、行业地位、企业的经营管理能力、研发投入等方面因素进行综合评价,综合考虑上市公司成长性以及这种成长的可能性与持续性,结合其财务指标对应的现金流水平及其成长性指标综合评价,作出投资决策投资。

2. 债券投资策略

本基金投资于国内依法发行、金融债和国债(包括可转债)。本基金在对利率走势和债券发行人基本情况进行分析的基础上,综合考虑利率变化对不同债券品种的影响,收益水平,信用风险的大小,流动性的好坏等因素,建立由不同类、不同期限品种构成的组合。

3. 金融衍生品投资策略

根据基金合同,本基金可投资于股指期货。

本基金在证券投资组合中于中高风险的品种,其长期平均的预期收益风险高于债券基金和货币市场基金。

以下内容摘自本基金2019年第1季度报告:

“6. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	3,981,490,168.79	72.61
2	债券投资	2,381,489,262.29	45.01
3	货币市场工具	1,099,494,220.22	20.62
4	其他资产	1,099,494,220.22	20.62
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	股指期货投资	-	-
8	期货合约	-	-
9	其他	376,460,089.74	6.99
10	待摊费用	21,526,274.26	0.41
11	其他	5,301,972,681.27	100.00

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,160,407,528.84	22.08
B	制造业	2,879,149,148.29	54.59
C	信息技术业	96,176,244.26	1.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	989,147.26	0.02
E	建筑业	39,374,183.43	0.73
F	交通运输业	49,461,643.29	0.93
G	批发和零售业	22,622,234.28	0.43
H	金融业	649,331,268.26	12.29
I	房地产业	589,331,268.26	11.13
J	医药、生物业	1,399,560,263.12	26.16
K	其他	84,739,739.29	1.59
L	其他	84,739,739.29	1.59
M	持有待售非流动资产	14,219,260.00	0.27
N	其他	1,948,494,211.22	36.82
O	金融资产、其他投资	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
T	其他	3,981,490,168.79	75.67

6.3 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	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	002127	中联重科	39,364,267.27	0.74
2	002038	双环传动	36,906,687.26	0.70
3	000222	中联重科	31,297,025.30	0.59
4	001336	荣泰股份	31,943,204.14	0.61
5	000966	内蒙华电	1,568,446.26	0.03
6	300010	通裕重工	1,499,125.26	0.03
7	300019	中航光电	1,499,125.26	0.03
8	300033	振源	1,320,281.26	0.03
9	300039	振源	1,481,423.26	0.03
10	300029	金诚信	1,481,423.26	0.03

6.4 报告期末按品种分类的前十名债券投资明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债期货	69,128,000.00	1.30
2	可转债	69,128,000.00	1.30
3	金融债	69,128,000.00	1.30
4	其他	69,128,000.00	1.30
5	其他	69,128,000.00	1.30
6	其他	69,128,000.00	1.30
7	其他	69,128,000.00	1.30
8	其他	69,128,000.00	1.30
9	其他	69,128,000.00	1.30
10	其他	69,128,000.00	1.30

6.5 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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	300039	振源	2,900,000.00
2	300039	振源	1,450,000.00
3	300039	振源	1,450,000.00
4	10504202	19国债02	1,000,000.00
5	300039	振源	724,000.00

6.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

6.7 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

6.8 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股指期货投资明细

6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.11 投资组合报告附注

6.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

6.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票名单。

6.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	衍生金融资产	3,977,267.26
2	其他	-
3	其他	-
4	其他	-
5	其他	-
6	其他	-
7	其他	-
8	其他	-
9	其他	-
10	其他	-
11	其他	-
12	其他	-
13	其他	-
14	其他	-
15	其他	-
16	其他	-
17	其他	-
18	其他	-
19	其他	-
20	其他	-
21	其他	-
22	其他	-
23	其他	-
24	其他	-
25	其他	-
26	其他	-
27	其他	-
28	其他	-
29	其他	-
30	其他	-
31	其他	-
32	其他	-
33	其他	-
34	其他	-
35	其他	-
36	其他	-
37	其他	-
38	其他	-
39	其他	-
40	其他	-
41	其他	-
42	其他	-
43	其他	-
44	其他	-
45	其他	-
46	其他	-
47	其他	-
48	其他	-
49	其他	-
50	其他	-
51	其他	-
52	其他	-
53	其他	-
54	其他	-
55	其他	-
56	其他	-
57	其他	-
58	其他	-
59	其他	-
60	其他	-
61	其他	-
62	其他	-
63	其他	-
64	其他	-
65	其他	-
66	其他	-
67	其他	-
68	其他	-
69	其他	-
70	其他	-
71	其他	-
72	其他	-
73	其他	-
74	其他	-
75	其他	-
76	其他	-
77	其他	-
78	其他	-
79	其他	-
80	其他	-
81	其他	-
82	其他	-
83	其他	-
84	其他	-
85	其他	-
86	其他	-
87	其他	-
88	其他	-
89	其他	-
90	其他	-
91	其他	-
92	其他	-
93	其他	-
94	其他	-
95	其他	-
96	其他	-
97	其他	-
98	其他	-
99	其他	-
100	其他	-

6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	120902	20国债02	496,207.26
2	120916	20国债06	496,207.26

6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6.11.6 报告期末前十名债券中存在流通受限情况的说明

6.11.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

6.11.8 其他资产构成

6.11.9 其他资产构成

6.11.10 其他资产构成

6.11.11 其他资产构成

6.11.12 其他资产构成

6.11.13 其他资产构成

6.11.14 其他资产构成

6.11.15 其他资产构成

6.11.16 其他资产构成

6.11.17 其他资产构成

6.11.18 其他资产构成

6.11.19 其他资产构成

6.11.20 其他资产构成

6.11.21 其他资产构成

6.11.22 其他资产构成

6.11.23 其他资产构成

6.11.24 其他资产构成

6.11.25 其他资产构成

6.11.26 其他资产构成

6.11.27 其他资产构成

6.11.28 其他资产构成

6.11.29 其他资产构成

6.11.30 其他资产构成

6.11.31 其他资产构成

6.11.32 其他资产构成

6.11.33 其他资产构成

6.11.34 其他资产构成

6.11.35 其他资产构成

6.11.36 其他资产构成

6.11.37 其他资产构成

6.11.38 其他资产构成

6.11.39 其他资产构成

6.11.40 其他资产构成

6.11.41 其他资产构成

6.11.42 其他资产构成

6.11.43 其他资产构成

6.11.44 其他资产构成

6.11.45 其他资产构成

6.11.46 其他资产构成

6.11.47 其他资产构成

6.11.48 其他资产构成

6.11.49 其他资产构成

6.11.50 其他资产构成

6.11.51 其他资产构成

6.11.52 其他资产构成

6.11.53 其他资产构成

6.11.54 其他资产构成

6.11.55 其他资产构成

6.11.56 其他资产构成

6.11.57 其他资产构成

6.11.58 其他资产构成

6.11.59 其他资产构成

6.11.60 其他资产构成

6.11.61 其他资产构成

6.11.62 其他资产构成

6.11.63 其他资产构成

6.11.64 其他资产构成

6.11.65 其他资产构成

6.11.66 其他资产构成

6.11.67 其他资产构成

6.11.68 其他资产构成

6.11.69 其他资产构成

6.11.70 其他资产构成

6.11.71 其他资产构成

6.11.72 其他资产构成

6.11.73 其他资产构成

6.11.74 其他资产构成

6.11.75 其他资产构成

6.11.76 其他资产构成

6.11.77 其他资产构成

6.11.78 其他资产构成

6.11.79 其他资产构成

6.11.80 其他资产构成

6.11.81 其他资产构成

6.11.82 其他资产构成

6.11.83 其他资产构成

6.11.84 其他资产构成

6.11.85 其他资产构成

6.11.86 其他资产构成

6.11.87 其他资产构成

6.11.88 其他资产构成

6.11.89 其他资产构成

6.11.90 其他资产构成

6.11.91 其他资产构成

6.11.92 其他资产构成

6.11.93 其他资产构成

6.11.94 其他资产构成

6.11.95 其他资产构成

6.11.96 其他资产构成

6.11.97 其他资产构成

6.11.98 其他资产构成

6.11.99 其他资产构成

6.11.100 其他资产构成

基金经理小组和投资决策委员会之外,公司还有专门的经济金融研究员,负责分析市场趋势、宏观、进出口、政策、利率、汇率以及政府政策等因素,为资产配置提供技术支持。公司还设有固定收益、衍生品等投资研究。

2.资产配置决策

投资决策委员会定期或不定期内证券市场的基本走势,决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围。基金经理小组在投资决策委员会决定的资产配置比例范围内,决定基金的具体资产配置。

3.组合构建

基金经理小组根据研究报告提交投资报告,结合自己的研究判断,决定具体的投资品种并决定买卖时机,其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批。对于拟投资的个股,基金经理小组将长期关注,择机介入的方法,以期买入成本、控制投资风险。对于买入的股票,基金持有期间,基金经理小组将对标的操作策略能有效降低基金的交易费用和交易成本,从而提高基金的投资收益水平。

4.交易执行

基金经理负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责,监控内容包括基金资产配置、个股投资比例等。

5.风险控制与评估

风险管理部定期或不定期对基金进行风险和绩效评估,并提供相关报告。风险部使用投资决策委员会和基金经理小组定期了解所持仓的风险水平以及是否符合既定的投资策略,该评估能够确保组合是否实施了投资限制,组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理小组可以及时跟踪和调整,从而调整投资组合。

6.组合监控与报告

基金经理小组跟踪经济状况、证券市场及上市公司的变化,结合基金申购赎回和现金流入流出情况,以及组合风险和绩效评价的结果,对投资组合进行监控和调整,使之不断得到优化。基金经理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据市场变化和实际需要对上述投资组合进行调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

(二) 投资策略

1. 股票投资策略

本基金投资于我国境内依法发行、具有良好增长潜力的成长型上市公司发行的股票,从基本面的分析入手,挑选成长性、具有以下特点的公司作为基金重点投资的对象:①公司所处的行业发展的良好;②公司在行业处于领先地位,具有持续竞争优势和实力;③能充分运用行业发展新机,保持领先;④公司的经营模式或创新能力持续相对优势;⑤了解市场并能够不断推出新产品,真正满足市场需求;⑥公司治理规范且有较好的激励机制,能够对外部变化迅速作出反应。

本基金建立了一套基于成长性的上市公司综合评价指标体系,以上市公司过去两年的历史成长性作为主要指标,以成长型公司为核心,通过上市公司可行成长性及其在行业中的领先地位,包括盈利能力、市场占有率、行业地位、企业的经营管理能力、研发投入等方面因素进行综合评价,综合考虑上市公司成长性以及这种成长的可能性与持续性,结合其财务指标对应的现金流水平及其成长性指标综合评价,作出投资决策投资。

2. 债券投资策略

本基金投资于国内依法发行、金融债和国债(包括可转债)。本基金在对利率走势和债券发行人基本情况进行分析的基础上,综合考虑利率变化对不同债券品种的影响,收益水平,信用风险的大小,流动性的好坏等因素,建立由不同类、不同期限品种构成的组合。

3. 金融衍生品投资策略

根据基金合同,本基金可投资于股指期货。

本基金在证券投资组合中于中高风险的品种,其长期平均的预期收益风险高于债券基金和货币市场基金。

以下内容摘自本基金2019年第1季度报告:

“6. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	3,981,490,168.79	72.61
2	债券投资	2,381,489,262.29	45.01
3	货币市场工具	1,099,494,220.22	20.62
4	其他资产	1,099,494,220.22	20.62
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	股指期货投资	-	-
8	期货合约	-	-
9	其他	376,460,089.74	6.99
10	待摊费用	21,526,274.26	0.41
11	其他	5,301,972,681.27	100.00

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,160,407,528.84	22.08
B	制造业	2,879,149,148.29	54.59
C	信息技术业	96,176,244.26	1.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	989,147.26	0.02
E	建筑业	39,374,183.43	0.73
F	交通运输业	49,461,643.29	0.93
G	批发和零售业	22,622,234.28	0.43
H	金融业	649,331,268.26	12.29
I	房地产业	589,331,268.26	11.13
J	医药、生物业	1,399,560,263.12	26.16
K	其他	84,739,739.29	1.59
L	其他	84,739,739.29	1.59
M	持有待售非流动资产	14,219,260.00	0.27
N	其他	1,948,494,211.22	36.82
O	金融资产、其他投资	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
T	其他	3,981,490,168.79	75.67

6.3 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	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	002127	中联重科	39,364,267.27	0.74
2	002038	双环传动	36,906,687.26	0.70
3	000222	中联重科	31,297,025.30	0.59
4	001336	荣泰股份	31,943,204.14	0.61
5	000966	内蒙华电	1,568,446.26	0.03
6	300010	通裕重工	1,499,125.26	0.03
7	300019	中航光电	1,499,125.26	0.03
8	300033	振源	1,320,281.26	0.03
9	300039	振源	1,481,423.	