

(上接B065版)

44	天相投资顾问有限公司	注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505 法定代表人:林义相 客服电话:010-66045678 网址:www.txsec.com
45	信达证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 法定代表人:张志刚 客服电话:95321 网址:www.cindasc.com
46	华龙证券股份有限公司	注册地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼 办公地址:兰州市城关区东岗西路638号19楼 法定代表人:陈牧原 客服电话:96368 网址:www.hlzq.com
47	平安证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区益田路6033号平安金融中心46层—64层 办公地址:深圳市福田区益田路6033号平安金融中心61层—64层 法定代表人:何之江 客服电话:95511-8 网址:stock.pingan.com
48	浙商证券股份有限公司	注册地址:浙江省杭州市江干区五星路201号 办公地址:浙江省杭州市江干区五星路201号 法定代表人:吴承根 客服电话:96345 网址:www.stocke.com.cn
49	中银国际证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层 法定代表人:宁敏 客服电话:4006208888 网址:www.bocichina.com
50	西南证券股份有限公司	注册地址:重庆市江北区桥北苑8号 办公地址:重庆市江北区桥北苑8号 法定代表人:廖庆轩 客服电话:96355、400-809-6096 网址:www.swsc.com.cn
51	国都证券股份有限公司	注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 客服电话:400-818-8118 网址:www.guodu.com
52	华鑫证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元 办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号 法定代表人:俞萍 客服电话:96323 网址:www.cfsc.com.cn
53	国金证券股份有限公司	注册地址:四川省成都市东城根上街95号 办公地址:四川省成都市东城根上街95号 法定代表人:冉云 客服电话:4006600109 网址:www.gjzq.com.cn
54	申万宏源证券股份有限公司	注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人:李琦 客服电话:4008000562 网址:www.hysec.com
55	中信期货有限公司	注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1306室、14层 办公地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1306室、14层 法定代表人:张皓 客服电话:400-990-8826 网址:www.citics.com
56	中国人寿保险股份有限公司	注册地址:中国北京市西城区金融大街16号 办公地址:中国北京市西城区金融大街16号 法定代表人:王滨 客服电话:96519 网址:www.e-chinalife.com
57	诺亚正行基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋 法定代表人:汪静波 客服电话:400-821-5399 网址:www.noah-fund.com
58	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室 法定代表人:杨文斌 客服电话:400-700-9665 网址:www.ehowbuy.com
59	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室 办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人:祖国明 客服电话:4000-766-123 网址:www.fund123.cn
60	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801 法定代表人:薛峰 客服电话:4006-788-887 网址:www.zlfund.com及 www.jimwm.com
61	上海长量基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层 法定代表人:张庆伟 客服电话:400-820-2899 网址:www.erichfund.com
62	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址:杭州市文二西路1号903室 办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大厦 法定代表人:凌顺平 客服电话:4008-773-772 网址:www.5ifund.com
63	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦 法定代表人:其实 客服电话:4001818188 网址:www.1234567.com.cn
64	浦领基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京园四区13号楼A座9层908室 办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08 法定代表人:聂婉君 客服电话:400-876-9988 网址:www.zscfund.com
65	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区月坛园3号楼5层521室 办公地址:北京市海淀区月坛园3号楼5层521室 法定代表人:李凌峰 客服电话:400-158-5050 网址:www.9ifund.com
66	浙江金观诚基金销售有限公司	注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室 办公地址:杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富 法定代表人:徐崇宇 客服电话:400-068-0068 网址:www.jincheng-fund.com

67	嘉实财富管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元 办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层(100022) 法定代表人:赵学军 客服电话:400-021-8850 网址:www.harvestwm.cn
68	宜信晋泽(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼1809 办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C1809 法定代表人:戎兵 客服电话:400-6099-200 网址:www.yixinfund.com
69	一路财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208 办公地址:北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层 法定代表人:吴雪秀 客服电话:400-001-1566 网址:www.yilucaifu.com
70	上海联泰基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路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 客服电话:400-166-6788 网址:www.661lantai.com
71	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 法定代表人:王之光 客服电话:40082119031 网址:www.lufunds.com
72	泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中路3号 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中路3号 法定代表人:李春光 客服电话:4000411001 网址:www.taichengcaifu.com
73	北京钱景基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 办公地址:北京市海淀区丹棱街6号丹棱soho1008-1012 法定代表人:赵荣春 客服电话:400-893-6885 网址:www.qianjing.com
74	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号裙楼2层222单元 办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心9座裙楼二层 法定代表人:郑魁栋 客服电话:400-618-0707 网址:www.hongdianfund.com
75	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西路113号景山财富中心3层342室 办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心342室和341室 法定代表人:李长军 客服电话:400-188-5687 网址:www.buyforyou.com.cn
76	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层 法定代表人:洪汉 客服电话:400-166-1188 网址:8.jr.com.cn
77	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 客服电话:0755-83999907 网址:www.fujiFund.cn
78	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东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203单元 法定代表人:肖雯 客服电话:020-89629066 网址:www.yingmi.cn
79	北京新浪金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518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518室 法定代表人:李纪琛 客服电话:010-62675369 网址:www.xincail.com
80	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:中国(上海)浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼 法定代表人:王廷富 客服电话:400-799-1888 网址:www.520fund.com.cn
81	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(苏宁总部) 法定代表人:王锋 客服电话:96177 网址:www.snjijin.com
82	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层1108 办公地址:北京市海淀区中关村大街11层1108 法定代表人:王伟刚 客服电话:400-619-9059 网址:www.hcjin.com
83	万家财富基金销售有限公司(天津)有限公司	注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室 办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋大厦A座6层 法定代表人:李修静 客服电话:010-59013895 网址:www.wanjiawealth.com
84	北京创金启富基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室 办公地址:北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室 法定代表人:梁静 客服电话:400-6262-818 网址:www.51rich.com
85	北京格上富信基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室 办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室 法定代表人:叶楠一 客服电话:400-066-8586 网址:www.igesafe.com
86	北京肯特瑞基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区龙山路19号1幢4层1座401 办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院 法定代表人:江卉 客服电话:965118 网址:fund3j.com
87	北京恒泰基金销售有限公司	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:北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层 法定代表人:荆斐斐 客服电话:4001599288 网址:danjuanapp.com
88	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室 法定代表人:周斌 客服电话:4008980618 网址:www.chtwm.com
89	上海华夏财富管理有限公司	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:毛伟峰 客服电话:400-817-5666 网址:www.amcfortune.com

90	通华财富(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室 办公地址:上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7层 法定代表人:沈丹尹 客服电话:4001019301 网址:www.tonghuafund.com
91	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室-67 办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号 法定代表人:于龙 客服电话:4008-802-123 网址:www.zhixin-inv.com
92	和耕传承基金销售有限公司	注册地址:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼6楼503 办公地址:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼6楼503 法定代表人:王旋 客服电话:4000-555-671 网址:www.hgcpb.com
93	腾安基金销售有限公司(深圳)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:深圳市南山区科技中一路腾讯大厦 法定代表人:刘明军 客服电话:95017 网址:tenganxinxi.com
94	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号环球财讯中心A座6层 法定代表人:钱昊昊 客服电话:4008909998 网址:www.jnlc.com
95	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号壹科大厦 法定代表人:张旭阳 客服电话:010-59922163 网址:www.baiyingfund.com

二、登记机构
名称:国泰基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室
办公地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

法定代表人:陈勇胜
联系人:辛怡
传真:021-31081800
客户服务专线:400-888-8688,021-31089000
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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
联系电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛
四、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:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银银行大厦507单元
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:魏佳亮
经办注册会计师:许康璞、魏佳亮

第四部分 基金的名称
国泰智能汽车股票型证券投资基金
第五部分 基金的类别和存续期限
1.基金类型:股票型证券投资基金
2.基金运作方式:契约型开放式
3.基金的存续期间:不定期
第六部分 投资目标
本基金主要投资于智能汽车主题股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票(含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票)、股指期货、股票期权、权证等权益类金融工具、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,投资于《基金合同》界定的智能汽车主题证券资产占非现金资产的比例不低于80%;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%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围和投资比例限制。

第八部分 投资策略
本基金在投资运作中,淡化大类资产配置,侧重在智能汽车主题下精选个股,以期实现基金资产的稳健增值。

1.股票投资策略
随着技术的快速发展,传统汽车正在加速驶入智能时代。从需求方面来看,人们对安全、舒适、环保、智能的追求促使传统汽车向智能汽车转型升级;从供给方面来看,实现装备制造的智能化将提升生产效率、产品技术水平和质量得到显著提高,能源、资源消耗和污染物的排放明显降低,传统繁重的人力成本也将大大降低。理由相信,在未来相对较长的一段时间里,智能汽车将得到长足发展。

(1)智能汽车主题的界定
本基金所指的智能汽车是指具有感知、沟通、关怀功能,最终可实现无人驾驶的汽车及其相关的制造、服务以及基于智能汽车所构建的智能生态环境的总称,它代表汽车电子、新能源汽车、车联网、无人驾驶以及与智能汽车相关服务等未来行业或领域的长期发展方向。智能汽车主题将随着科技进步而不断更新,基金管理人将持续跟踪科技进步及商业模式发展,对智能汽车主题所涉及领域进行重新调整。

本基金界定的智能汽车主题股票应至少符合以下标准之一:(1)上市公司目前主营业务属于上述智能汽车主题涵盖范围的;(2)上市公司目前非主营业务属于上述智能汽车主题涵盖范围,但该部分业务有可能转型为主营业务并成为公司主要利润来源的;(3)上市公司未来转型方向或重点发展业务属于上述智能汽车主题涵盖范围的。

(2)个股投资策略
本基金根据上市公司获利能力、成长能力、估值水平等指标精选个股。运用定性和定量相结合的方法,综合分析其投资价值 and 成长能力,确定投资标的股票,构建投资组合。

2.固定收益类投资工具投资策略
本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向,预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合,配置能够稳定提供收益的债券和货币市场工具组合,保证基金资产流动性。

3.股指期货投资策略
本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本,并利用股指期货的对冲作用,降低投资组合的系统性风险。

4.股票期权投资策略
本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对

证券市场的预判,并结合股指期货定价模型,选择估值合理的期权合约。

5.中小企业私募债投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征,选择具有相对优势的品种,在严格遵守法律法规和《基金合同》基础上,谨慎进行中小企业私募债的投资。

6.资产支持证券投资策略
本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

7.权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,立足于无风险套利,尽力减少组合净值波动率,力求稳健的超额收益。

第九部分 业绩比较基准
中证新能源汽车指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

如果今后法律法规发生变化,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并按照监管部门要求履行适当程序,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在指定媒介上公告,无需召开基金份额持有人大会审议。

第十部分 风险收益特征
本基金为股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

第十一部分 基金投资组合报告
本基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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2019年6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

(一)报告期末本基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	888,769,482.81	94.07
	其中:股票	888,769,482.81	94.07
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	55,311,679.38	5.85
7	其他各项资产	748,399.85	0.08
8	合计	944,829,562.04	100.00

(二)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	-	-
B	采矿业	363,431.25	0.04
C	制造业	760,397,643.82	80.76
D	电力、热力、燃气及生产 and 供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,367,448.88	1.84
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	110,583,982.32	11.74
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	-	-
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
合计		888,769,482.81	94.39

(三)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	600895	宏发股份	3,598,887	87,452,954.10	9.29
2	601799	宇星股份	1,088,889	85,978,675.44	9.13
3	002050	三花智控	7,989,181	84,241,665.95	8.95
4	002594	比亚迪	1,588,710	80,579,371.20	8.56
5	002466	天齐锂业	2,800,061	70,785,542.08	7.52
6	300124	汇川技术	2,704,231	61,953,932.21	6.58
7	002405	四维图新	3,433,200	55,274,520.00	5.87
8	300037	新宙邦	2,472,069	51,517,709.56	5.47
9	300496	中科创业	1,688,882	49,112,688.56	5.22
10	300450	先导智能	1,300,000	43,680,000.00	4.64

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

(五)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
本基金本报告期末未持有债券。

(六)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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前七名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)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
本基金本报告期末未持有权证。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

2.本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,

有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

(十一)投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	441,393.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,398.06
5	应收申购款	290,608.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	748,399.85

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可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002050	三花智控	1,015,448.40	0.11	增发中签

第十二部分 基金的业绩
本基金业绩截止日为2019年6月30日,并经基金托管人复核。

本基金管理人依照恪守职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年8月1日至2017年12月31日	-1.60%	0.99%	-3.07%	1.19%	1.47%	-0.20%
2018年度	-28.25%	1.74%	-30.35%	1.49%	2.10%	0.25%
2019年上半年	8.92%	1.71%	2.59%	1.48%	6.33%	0.23%
2017年8月1日至2019年6月30日	-23.10%	1.60%	-30.74%	1.43%	7.64%	0.17%

注:2017年8月1日为本基金合同生效日。

第十三部分 基金费用与税收

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用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼费和仲裁费;
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、基金的开户费用、账户维护费用;
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×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使