

A48 信息披露 Disclosure

(上接A47版)

法定代表人:李新华
联系人:奚博宇
电话:021-61118795
客服电话:95679或4008-888-999
公司网址:www.cjsccom.cn
(83) 名称:长城信期货有限公司
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1301-1305、14层
法定代表人:张皓
联系人:刘宏望
电话:010-60834022
客服电话:400-990-8826
公司网址:www.citicsf.com
(84) 名称:长城证券股份有限公司
地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:曹宏
联系人:张涛
电话:0755-33680000
客服电话:95514;400-6666-888
网址:www.cgws.com.cn
(85) 名称:中泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:山东省济南市市中区经七路 86 号
法定代表人:李玮
联系人:陈曦
电话:021-20315086
客服电话:95538(全国)
公司网址:www.qtlzq.com.cn
(86) 名称:世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心406
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人:李强
联系人:王斐
电话:0755-831199511
客服电话:400-8323-000
网址:www.csco.com.cn
(87) 名称:东北证券股份有限公司
注册地址:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
客服电话:95360
网址:www.nesc.cn
(88) 名称:大同证券有限责任公司
注册地址:山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:山西省太原市小店区长治路世贸中心12层
法定代表人:董祥
联系人:薛津
电话:0351-4130322
客服电话:4007-121212
网址:www.dtsbc.com.cn
(89) 名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单

元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层
法定代表人:王连志
联系人:彭洁琨
电话:0755-82558266
客服电话:95517
网址:www.essence.com.cn
(90) 名称:金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市福田区深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:王作义
联系人:刘辉
电话:0755-82505693
客服电话:95372
网址:www.jyzq.com.cn
(91) 名称:西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址:拉萨市北京中路101号
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
法定代表人:陈宏
联系人:付佳佳
电话:021-23586603
客服电话:95357
公司网址:www.18.cn
(92) 名称:爱建证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人:杜健
联系人:姚盛德
电话:021-32229898
客服电话:4001-962-502
网址:www.aizq.com
(93) 名称:宏信证券有限责任公司
地址:四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉明
联系人:杨磊
电话:028-86199041
客服电话:4008-366-366
网址:www.hxbzq.cn
(94) 名称:江苏汇保大基金销售有限公司
注册地址:南京市高淳区经济开发区古槐大道47号
办公地址:南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室
法定代表人:吴言林
联系人:林伊灵
电话:025-68046166-810
客服电话:025-66046166
网址:www.hubfunds.com
(95) 名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:陈四清
联系人:郭明
电话:010-66105799
客服电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn
(96) 名称:交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路189号
办公地址:上海市银城中路189号
法定代表人:任德奇
联系人:罗蔚敏
电话:021-20581724
客服电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com
(97) 名称:兴业银行股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路154号
办公地址:福建省福州市湖东路154号
法定代表人:陶以平
联系人:苏群
电话:0591-88520063
客服电话:95561
公司网址:www.cib.com.cn
(98) 名称: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室
法定代表人:林义相
联系人:谭磊
电话:010-68045182
客服电话:010-66046555
网址:www.txsec.com
(99) 名称: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2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦26楼
法定代表人:其实
联系人:黄妮娟
电话:021-54509998
客服电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn
(100) 名称: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号同花顺大楼
法定代表人:凌顺平
联系人:吴昊
电话:0571-888911818
客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
(101) 名称: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号鸿博大厦712室
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

室

法定代表人:梁睿
联系人:魏小清
电话:010-66154828-8006
客服电话:400-6262-1818
网址:www.5iirich.com
(102) 名称:杭州利地瑞富基金销售有限公司
注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人:陈刚
联系人:张丽琼
电话:0571-885267500
客服电话:0571-88655920
公司网址:www.wstnnewwealth.com
(103) 名称: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902-115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:陈健雄
联系人:黄伟
电话:021-63333389-230
客服电话:4006-433-389
公司网址: www.vstonewealth.com
(104) 名称: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:宁宇琦
电话:021-20665652
客服电话:4008219031
公司网址:www.lufunds.com
(105) 名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国金大厦C座
法定代表人:陈共炎
联系人:李国政
电话:010-83574507
客服电话:4008888888或95551
网址:www.chinastock.com.cn
(106) 名称:北京蛋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:北京市朝阳区望京SOHO塔2、B座2507
法定代表人:钟斐斐
联系人:王悦
电话:010-61940688
客服电话:400-0618-518
公司网址:www.danjuanapp.com
(107) 名称:方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4.5号楼3701-3717
办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层
法定代表人:施华
联系人:胡创
客服电话:95571
网址:www.foundersc.com
(108) 名称:中信证券华南股份有限公司
地址:广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:胡伏云
联系人:梁微
电话:020-88369999
客服电话:95396
网址:www.gzs.com.cn
(109) 名称:山西证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号国际贸易中心东28层
法定代表人:侯巍
联系人:孟婉婷
电话:0351-8686602
客服电话:95573
网址:www.i618.com.cn
(110) 名称:中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F
法定代表人:何亚刚
联系人:李小微
电话:010-59356930
客服电话:4008895618
公司网址:www.e618.com
(111) 名称:首创证券有限责任公司
地址:北京市西城德胜门内大街115号德胜尚城D座
法定代表人:毕劲松
联系人:李淑敏
电话:010-59366077
客服电话:4006200620
网址:www.sczq.com.cn
(112) 名称:太平洋证券股份有限公司
地址:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
法定代表人:李长伟
联系人:王婧
电话:010-88695182
客服电话:95397
网址:www.tpyzq.com
(113) 名称:招商银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
联系人:邓炯鹏
电话:0755-83077278
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com
(114) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山东路一十二号
办公地址:上海市黄浦区中山东路一十二号
法定代表人:郑杨
联系人:姜基彬
电话:021-61616885
客服电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn
(115) 名称:华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
法定代表人:李民吉
联系人:刘军祥
电话:010-85238820
客服电话:95577
公司网址:www.hxb.com.cn
(116) 名称:平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:谢永林
联系人:汤俊勋
电话:0755-22168301
客服电话:95511
公司网址:www.bank.pingan.com
(117) 名称:宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址:宁波市鄞州区宁东路345号
法定代表人:陆华裕
联系人:廖凯亮
电话:0574-89068258
客服电话:95574
公司网址:www.nbcb.com.cn
(118) 名称:民商基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海黄浦区北京东路666号11楼(东座)6楼A31室
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
法定代表人:贺惠琴
联系人:杨一彬
电话:021-50206003
客服电话:021-50206003
公司网址:www.msftcc.com
(119) 名称: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2401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903-905室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗丹
电话:021-20613643
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com
(120) 名称:北京新银汇基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村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:李阳琛
联系人:李唯
电话:010-62675369
客服电话:010-62675369
公司网址:www.xincal.com
(121) 名称: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港工业区综合服务区办公D座二二二02-124室
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层
法定代表人:丁东华
联系人:郭宝亮
电话:010-59297994
客服电话:010-5111-0899
公司网址:www.gomefund.com
(122) 名称:中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
办公地址:山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人:姜晓燕
联系人:孙秋美
电话:0632-85022026
客服电话:95548
网址:sd.citics.com
(123) 名称:深圳信诚基金销售有限公司
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:深圳市福田区中心区东南部时代财富大厦49A
法定代表人:周文
联系人:程浩然
电话:010-84965370
客服电话:0755-23494679
公司网址:www.xcfund.com
(124) 名称:东莞证券股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路一号
办公地址:东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人:陈照星
联系人:李荣
电话:0769-22115712
客服电话:95328
网址:www.dgzq.com.cn
(125) 名称:东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:陈耀庭
联系人:王一彦
电话:021-20333333
客服电话:95531;400-8888-588

网址:www.longone.com.cn
本基金投资于较高成长性中小盘股票,通过积极的投资组合管理,在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
七、基金的投资方向
本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金的股票投资主要投资于具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在 market 平均水平之下的中小盘股票(流通市值排名前20%(含20%)的新上市股票一年内不列入流通市值市场平均值的计算)。本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购等。
本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国家债券、金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券。
本基金的股票投资占基金资产总值的比例为50%到80%,债券投资占基金资产总值的比例为20%到40%,现金占基金资产总值的比例不超过10%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
八、基金的投资策略
(一)决策依据
本基金的投资决策依据包括:
(1)宏观经济形势及前景、有关政策趋向;
(2)行业发展现状及前景;
(3)上市公司基本面及发展前景;
(4)证券市场走势及预期;
(5)股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。
(二)决策程序
(1)基金管理人研究部门基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,和对各类资产收益率和风险水平的合理预期,向投资决策委员会提交投资建议,投资建议包括总体资产配置建议、类别资产配置建议、个股/券种投资建议等;
(2)投资决策委员会根据本基金的投资目标,结合对本基金投资相关因素的全局考虑,确定本基金的投资策略,制定总体资产配置计划;
(3)本基金基金经理根据投资决策委员会确定的基金的投资资产配置计划,考虑研究部门的相关建议,拟定投资计划,报投资决策委员会批准;
(4)本基金基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划,制定具体投资方案。
(三)组合原则
本基金的投资组合必须符合以下比例规定:
(1)本基金投资于股票、债券的比例,不得低于基金资产总值的80%;
(2)本基金投资于国家债券的比例,不得低于基金资产净值的20%;
(3)本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;
(4)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;
(5)运用基金资产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次的股票发售总量;
(6)基金投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资总额的80%;
(7)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;
(8)本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;
(9)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;
因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金不符合前款所定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。
(10)基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定投资范围保持一致一致;
(11)本基金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,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
(12)有关法律法规、中国证监会及本基金合同所规定的其他比例限制;
(13)法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。
(四)本基金股票投资策略
本基金采取主动的股票投资策略,在专业化研究的基础上,将系统的选股方法与积极的投资操作相结合,选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建股票投资组合,把握投资机会,实现收益。
股票投资组合包括中小盘股票组合和其他股票组合。中小盘股票组合通过选择具有较高成长性、基本面良好的中小盘股,依据有效分散的原则构建。其他股票投资主要是参与有较高投资价值的新股申购、股票增发申购以及根据市场情况的短期股票投资。
(五)本基金债券投资策略
采取稳健的混合管理投资策略,根据对利率、收益率走势的预测,考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素,依据修正久期、凸性等指标,构建债券组合。
九、基金的业绩比较基准
中证700指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
十、基金的风险收益特征
本基金属于中风险适中、预期收益较高的证券投资基金品种。
十一、基金的投资组合报告
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。
本基金的托管人根据本基金合同的规定,复核了本报告中的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告有关数据截止日为2019年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
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	251,676,046.07	65.07
	其中:股票	251,676,046.07	65.07
2	固定收益投资	96,469,500.00	24.68
	其中:债券	96,469,500.00	24.68
	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	15,443,073.94	3.99
7	其他各项资产	24,164,141.88	6.26
8	合计	388,754,766.40	100.00

注:其他资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。
2、报告期末按行业分类的股票投资组合
(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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	149,426,685.62	39.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,513,564.00	1.96
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,077,079.00	3.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,581,038.15	11.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,343,456.00	5.31
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	16,526,649.00	4.31
S	合计	261,678,040.07	66.66

(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通过港股通投资股票。
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	603517	唯德食品	524,200	19,569,200.00	3.24
2	600977	中国绿岛	822,160	12,701,446.00	3.31
3	601155	新城控股	426,300	12,396,394.00	3.23
4	603306	鼎胜股份	411,100	11,889,012.00	3.10
5	600061	格力电器	205,000	11,746,500.00	3.06
6	603983	久谦股份	197,256	11,697,221.50	3.04
7	002850	科达利	361,265	11,651,070.00	3.03
8	300655	艾罗能源	186,287	11,058,765.87	2.89
9	603005	珀莱雅	126,200	10,574,184.00	2.86
10	300783	三只松鼠	361,000	10,564,364.00	2.86

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	国债债券	35,446,500.00	4.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,024,000.00	20.88
	其中:政策性金融债	80,024,000.00	20.88
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	短期融资券(可转换债)	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	56,469,500.00	24.91
10	合计	16,469,500.00	24.91

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

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	180410	18农发10	800,000.00	80,024,000.00	20.88
2	210107	21国债07	150,000.00	15,446,500.00	4.03

注:本基金本报告期末仅持有2只债券。
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
本基金本报告期内未投资贵金属。
8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权

证投资明细
本基金本报告期内未投资权证。
9、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
本基金本报告期内未投资股指期货。
(2)本基金股指期货投资期的投资情况
无。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1)本期国债期货投资政策
无。
(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

六、基金的投资目标
本基金投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票,通过积极的投资组合管理,在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
七、基金的投资方向
本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金的股票投资主要投资于具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在 market 平均水平之下的中小盘股票(流通市值排名前20%(含20%)的新上市股票一年内不列入流通市值市场平均值的计算)。本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购等。
本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国家债券、金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券。
本基金的股票投资占基金资产总值的比例为50%到80%,债券投资占基金资产总值的比例为20%到40%,现金占基金资产总值的比例不超过10%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
八、基金的投资策略
(一)决策依据
本基金的投资决策依据包括:
(1)宏观经济形势及前景、有关政策趋向;
(2)行业发展现状及前景;
(3)上市公司基本面及发展前景;
(4)证券市场走势及预期;
(5)股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。
(二)决策程序
(1)基金管理人研究部门基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,和对各类资产收益率和风险水平的合理预期,向投资决策委员会提交投资建议,投资建议包括总体资产配置建议、类别资产配置建议、个股/券种投资建议等;
(2)投资决策委员会根据本基金的投资目标,结合对本基金投资相关因素的全局考虑,确定本基金的投资策略,制定总体资产配置计划;
(3)本基金基金经理根据投资决策委员会确定的基金的投资资产配置计划,考虑研究部门的相关建议,拟定投资计划,报投资决策委员会批准;
(4)本基金基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划,制定具体投资方案。
(三)组合原则
本基金的投资组合必须符合以下比例规定:
(1)本基金投资于股票、债券的比例,不得低于基金资产总值的80%;
(2)本基金投资于国家债券的比例,不得低于基金资产净值的20%;
(3)本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;
(4)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;
(5)运用基金资产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次的股票发售总量;
(6)基金投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资总额的80%;
(7)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;
(8)本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;
(9)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;
因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金不符合前款所定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。
(10)基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定投资范围保持一致一致;
(11)本基金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,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
(12)有关法律法规、中国证监会及本基金合同所规定的其他比例限制;
(13)法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。
(四)本基金股票投资策略
本基金采取主动的股票投资策略,在专业化研究的基础上,将系统的选股方法与积极的投资操作相结合,选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建股票投资组合,把握投资机会,实现收益。
股票投资组合包括中小盘股票组合和其他股票组合。中小盘股票组合通过选择具有较高成长性、基本面良好的中小盘股,依据有效充分分散的原则构建。其他股票投资主要是参与有较高投资价值的新股申购、股票增发申购以及根据市场情况的短期股票投资。
(五)本基金债券投资策略
采取稳健的混合管理投资策略,根据对利率、收益率走势的预测,考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素,依据修正久期、凸性等指标,构建债券组合。
九、基金的业绩比较基准
中证700指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
十、基金的风险收益特征
本基金属于中风险适中、预期收益较高的证券投资基金品种。
十一、基金的投资组合报告
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。
本基金的托管人根据本基金合同的规定,复核了本报告中的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告有关数据截止日为2019年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
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	251,676,046.07	65.07
	其中:股票	251,676,046.07	65.07
2	固定收益投资	96,469,500.00	24.68
	其中:债券	96,469,500.00	24.68
	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	15,443,073.94	3.99
7	其他各项资产	24,164,141.88	6.26
8	合计	388,754,766.40	100.00

注:其他资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。
2、报告期末按行业分类的股票投资组合
(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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	149,426,685.62	39.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,513,564.00	1.96
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,077,079.00	3.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,581,038.15	11.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,343,456.00	5.31
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	16,526,649.00	4.31
S	合计	261,678,040.07	66.66

(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通过港股通投资股票。
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

B	合计		396,754,776.43	100.00
---	----	--	----------------	--------

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证净清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	医药业	-	-
C	制造业	149,826,628.52	39.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,313,564.00	1.86
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,417,678.00	3.85
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-