

B102 信息披露 Disclosure

(上接B101版)

		办公地址:上海市静安区南京西路100号恒信大厦10楼 法定代表人:李景松 联系人:陈少华 电话:(021)63088888 传真:(021)63088800 客服电话:01005258, 4008018818 网址: http://www.shibao.com.cn
121	上海证券有限责任公司	办公地址:北京市西城区北二环路68号恒信大厦10楼1011 法定代表人:李景松 联系人:陈少华 电话:(010)63088888 传真:(010)63088800 客服电话:01005258, 4008018818 网址: http://www.shibao.com.cn
122	国联证券股份有限公司	办公地址:山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心12层1211室 法定代表人:董增平 联系人:薛建 电话:(0351)4133222 传真:(0351)4133222 客服电话:4007121222 网址: http://www.guolian.com.cn
123	大同证券有限责任公司	办公地址:山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心12层1211室 法定代表人:董增平 联系人:薛建 电话:(0351)4133222 传真:(0351)4133222 客服电话:4007121222 网址: http://www.guolian.com.cn
124	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
125	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
126	平安证券股份有限公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
127	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
128	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
129	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
130	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
131	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
132	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
133	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
134	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
135	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
136	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
137	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
138	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
139	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
140	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
141	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
142	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
143	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
144	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
145	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
146	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
147	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
148	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn
149	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
150	泰康证券有限责任公司	办公地址:深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室 法定代表人:杨斌 联系人:王健 电话:(0755)43837438 传真:(0755)43837438 客服电话:4006788888 网址: http://www.taikang.com.cn

151	华泰证券股份有限公司	办公地址:江苏省南京市江东中路228号华泰证券大厦10楼 法定代表人:李峰 联系人:李峰 电话:(025)83333333 传真:(025)83333333 客服电话:4008888888 网址: http://www.htsc.com.cn
152	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
153	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
154	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
155	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
156	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
157	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
158	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
159	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
160	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
161	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
162	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
163	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn
164	国联证券股份有限公司	办公地址:浙江省杭州市文晖路201号 法定代表人:陈少华 联系人:陈少华 电话:(0571)87901912 传真:(0571)87901912 客服电话:(0571)86777777 网址: http://www.guolian.com.cn

名称	华泰证券股份有限公司
住所、办公地址	江苏省南京市江东中路228号华泰证券大厦10楼
法定代表人	李峰
联系人	李峰
电话	(025)83333333
传真	(025)83333333
网址	http://www.htsc.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	泰康证券股份有限公司
住所、办公地址	深圳市福田区益田路5015号平安金融中心45层4501室
法定代表人	杨斌
联系人	王健
电话	(0755)43837438
传真	(0755)43837438
网址	http://www.taikang.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

名称	国联证券股份有限公司
住所、办公地址	浙江省杭州市文晖路201号
法定代表人	陈少华
联系人	陈少华
电话	(0571)87901912
传真	(0571)87901912
网址	http://www.guolian.com.cn

a.盈利模式:通过综合考虑企业利润来源、核心竞争力、渠道影响力、客户忠诚度、创新能力等分析判断企业是否具备稳健或领先的盈利模式。

b.管理层能力:通过综合考虑企业管理团队的稳定性、专业程度以及所倡导的企业文化等分析判断企业管理层是否具备带领企业积极健康发展的能力。

c.公司战略:通过综合考虑企业战略定位、发展规划、经营策略和执行力等分析判断企业是否具备清晰的发展目标和明确的实现手段。

d.财务报表健康程度:通过综合考虑企业资产负债情况、利润结构分解和现金流情况等分析判断企业财务状况是否与其战略发展相匹配。

e.体外或有资产:通过综合考虑企业的行业地位、兼并收购能力等分析判断企业扩大产能实现跨越式发展的可能性。

(3)中观因素与个股因素相结合

本基金遵循“宏观指导中观,中观指导微观”的动态投资策略,并结合中观因素与个股因素确定优势个股,并根据组合风险特征、资产配置策略的变化等进行股票投资组合的构建与调整。

3.债券投资策略

本基金在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类别的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅助,构建能够提供稳定收益的债券和货币市场组合。

4.衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货、权证等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

5.风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如Barns多因子模型、风险预算模型等,并结合公司现有的风险管理流程,在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。

具体而言,在大类资产配置策略的风险控制上,由股票投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控;在行业配置策略的风险控制上,风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外,也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上,本基金将严格遵守公司的内部规章制度,控制单一股权投资风险。

未来,根据市场情况,基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

九、基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×70%+上证国债指数×30%。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深300指数或上证国债指数的编制及发布,或沪深300指数或上证国债指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数,或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高风险/风险特征的基金。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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3月31日(“报告期末”),本报告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	类别	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	881,225,274.86	85.07
2	债券投资	881,225,274.86	85.07
3	货币投资	47,451,723.09	4.53
4	资产支持投资	47,451,723.09	4.53
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	30,658,097.00	2.98
8	其他资产	1,421,773.99	0.13
9	合计	1,005,361,793.70	96.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	61,430,523.00	5.99
B	制造业	-	-
C	消费品	100,150,448.24	9.80
D	电力、热力、燃气及热力生产和供应业	-	-
E	建筑业	88,232,369.00	8.59
F	交通运输、仓储业	38,046,184.22	3.69
G	信息、计算机、通信设备制造业	82,912,623.20	8.08
H	其他制造业、其他信息业、其他服务业	62,409,762.00	6.08
I	房地产业	-	-
J	批发和零售业	10,440,000.00	1.01
K	科学研究和技术服务业	10,440,000.00	1.01
L	水利、环境和公共设施管理业	-	-
M	文化、体育和娱乐业	7,138,200.00	0.69
N	综合	-	-
合计	-	881,225,274.86	85.07

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商银行	11,777,281	103,480,262.00	10.14
2	中国平安	85,888	66,727,470.00	6.49
3	华泰证券	7,466,400	66,278,460.00	6.43
4	中信证券	869,399	62,386,430.00	6.08
5	招商银行	3,769,768	41,430,523.00	4.04
6	中国平安	3,496,399	30,658,097.00	2.98
7	招商银行	1,343,369	14,516,461.70	1.41
8	招商银行	2,436,280	21,331,760.00	2.09
9	招商银行	156,546	16,560,816.00	1.60
10	招商银行	1,471,558	16,200,720.00	1.56

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商银行	47,451,723.09	4.53
2	招商银行	47,451,723.09	4.53

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	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	47,461,733.00	4.46
其中:政策性金融债		47,461,733.00	4.46
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转换(可交换)	--	--