B16 信息披露 | Disclosure

(上接B15版)

客服电话:96390
公司网址:htp://www.hjsec.com.cn
(68)民生证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:许梦圆
电话:010-85165398
客服电话:4008-888-108
公司网址:https://www.cscs108.com/
(69)民生证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人:冯鹤年
联系人:韩秀萍
电话:010-85127609
客服电话:96376
公司网址:www.msxz.com
(70)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
办公地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
法定代表人:吕春卫
联系人:丁蔚云
电话:01008499427
客服电话:4006208688
公司网址:www.lczq.com
(71)中信证券股份有限公司
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
办公地址:北京市朝阳区亮马桥48号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
联系人:马静懿
电话:010-60833889
客服电话:96548
公司网址:www.cscsctc.com
(72)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东楼2层
法定代表人:姜晓晓
联系人:孙洪光
联系电话:0632-85022326
传真:0632-85022605
客服电话:96548
公司网址:htp://www.citics.com
(73)中银期货有限公司
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1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:刘宏莹
电话:010-60833754
传真:0755-83217421
客服电话:400-990-8826
公司网址:htp://www.citicsf.com/
(74)华福证券有限责任公司
注册地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7-8楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18层
法定代表人:黄金琳
联系人:王虹
客服电话:96547
公司网址:htp://www.hfzq.com.cn
(75)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人:李俊杰
联系人:邵珍珍
电话:021-52696262
客服电话:4008918918
公司网址:www.shzq.com
(76)第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路投行大厦20楼
办公地址:广东省深圳市福田区福华一路投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
电话:0755-23839076
客服电话:95358
公司网址:www.firstcapital.com.cn
(77)财通证券股份有限公司
注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201.501.502.1103.1601-1615、1701-1716
法定代表人:陆建强
联系人:徐轶青
电话:0671-87822639
传真:0671-87818329
客服电话:95336
公司网址:www.ctsec.com
(78)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
联系人:张晓晨
电话:010-83251284
客服电话:96321
公司网址:www.cindasc.com
(79)东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏苏州工业园区星阳街5号
办公地址:江苏苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
联系人:陆晓敏
电话:0612-62938521
传真:0612-62938833
客服电话:96330
公司网址:www.dwzq.com.cn
(80)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人:李梅
联系人:陈敏
电话:021-33388211
客服电话:4008895523
公司网址:www.swhysc.com
(81)申万宏源西部证券有限公司
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
联系人:曹霞
电话:010-83065258
传真:010-83013005
客服电话:96523
公司网址:www.hysec.com
(82)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17
法定代表人:曹宏
联系人:贾爱
电话:0755-83516289
客服电话:400-6666-888
公司网址:www.ccsc.com.cn
(83)国信证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市梅山路18号
办公地址:安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券法定代表人:蔡咏
联系人:倪俊
联系电话:0651-62257039
客服电话:96578,4008888777
公司网址:www.gyzzq.com.cn
(84)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
办公地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:秦丽晴
电话:021-20315197
客服电话:96538
公司网址:www.zts.com.cn
(85)华通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
联系人:李楠
电话:021-23211961
客服电话:96553/4008989001
公司网址:www.htsec.com
(86)华西证券股份有限公司
注册地址:成都市高新区天府二街198号
办公地址:北京市西城区阜成门外大街22号外经贸大厦9层
法定代表人:杨炯洋
联系人:谢国辉
联系方式:010-58124967
客服电话:96594
公司网址:www.hx168.com.cn
(87)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36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:陈剑虹
电话:0755-82825551
传真:0755-82583555
客服电话:96517
公司网址:www.essence.com.cn
(88)华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路199号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路199号
法定代表人:章宏韬
联系人:樊思亚
联系方式:0651-65161675
客服电话:96318
公司网址:www.hazq.com
(89)弘业期货股份有限公司
注册地址:南京市中华路560号
办公地址:南京市中华路560号弘业大厦
法定代表人:周剑秋
联系人:张苏剑
电话:025-52279891
传真:025-52278733
客服电话:400-8281283
公司网址:www.ftol.com.cn
(90)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市江东中路228号
办公地址:江苏省南京市江东中路228号
法定代表人:周易
联系人:马艺珈
电话:025-83390993
客服电话:96597

公司网址:htp://www.hjsec.com.cn/
(91)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址:广州市天河区河北路183号大都会广场5、7、10、18、19、36、38、39-44楼
法定代表人:孙树明
联系人:马梦洁
电话:020-87565888-6932
客服电话:96575
公司网址:www.gf.com.cn
(92)联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐勇
联系人:彭程
电话:0752-2119700
传真:0752-2119660
客服电话:95664
公司网址:www.lxsec.com
(93)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市珠江东路6号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址:广州市珠江江西路6号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:张永衡
客服电话:95396
公司网址:www.gzsc.com.cn
(94)东莞证券股份有限公司
注册地址:莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址:莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:陈耀庭
客服电话:96328
公司网址:htp://www.dgzq.com.cn/
(95)长川期货股份有限公司
注册地址:武汉市武昌区中北路9号长城门T2号写字楼第27、28层
办公地址:武汉市武昌区中北路9号长城门T2号写字楼第27层
法定代表人:谭显荣
联系人:梅晨
传真:06-27-85860102
客服电话:027-88861133
公司网址:htp://www.cjco.com.cn/main/index.html
(96)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:哈尔滨市松北区创新二路833号
法定代表人:赵廷伟
联系人:姜蕊佳
客服电话:400-666-2288
公司网址:www.jhzq.com.cn
(97)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区敕勒川大街东方君座D座光大街办公楼14-18楼
法定代表人:庞介民
联系人:熊丽
电话:0471-4972675
客服电话:0471-2943431
公司网址:htp://www.cnht.com.cn/
(98)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市临桂区桂林南环路13号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号国海大厦
法定代表人:何春梅
联系人:张彦
联系电话:021-50917510
客服电话:95663
公司网址:www.gqzq.com.cn
(99)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层
法定代表人:何如
联系人:李丽
电话:0651-68167601
客服电话:96536
公司网址:www.guosen.com.cn
(100)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋4层、18-21层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋4层、18-21层
法定代表人:高涛
联系人:陈楠
联系电话:0755-88320851
客服电话:95632
公司网址:htp://www.china-invs.cn/
(101)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路111号招商证券大厦
法定代表人:霍达
联系人:黄婵君
联系电话:86-755-82900167
客服电话:95565
公司网址:htp://www.newone.com.cn/
(102)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号(新大厦)12、15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号(新大厦)12、15层
法定代表人:魏庆华
联系人:和志鹏
联系电话:010-66569371
客服电话:95309
公司网址:www.dxzq.net
(103)中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区东四环中路27号A号楼
办公地址:北京市朝阳区东四环中路27号盘古大观A座40F-43F
法定代表人:姜志军
联系人:程博怡
电话:010-56437060
传真:010-56437032
客服电话:400889618/96571
网址:www.e618.com
(104)方正证券股份有限公司
注册地址:长沙市中心区湘江中路二段36号华远中心4、5号楼3701-3717
办公地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远国际中心37层
法定代表人:唐华
联系人:程博怡
电话:010-56437060
传真:010-56437032
客服电话:400889618/96571
网址:www.e618.com
(105)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人:倪捷
联系人:陈海盛
电话:021-32229888-33355
客服电话:4001-962-502
公司网址:www.ajzq.com
(106)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27/28层
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27/28层
法定代表人:沈如军
联系人:杨宇宁
电话:010-65051166
传真:010-65051166
公司网址:www.cicc.com.cn
(107)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
联系人:钟伟强
联系电话:021-38032294
客服电话:400-888-666/96521
公司网址:www.gtja.com
(108)广矿证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层
法定代表人:黄海洲
联系人:魏耘福
电话:0755-82545992
传真:0755-2390766
客服电话:4001840028
公司网站:www.wkzq.com.cn
(109)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号西南证券大厦
法定代表人:廖庆轩
联系人:廖庆轩
电话:023-67616310
客服电话:96355
公司网址:www.swsc.com.cn
(110)民商基金销售有限公司
注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区(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
电话:021-50206002
传真:021-50206001
客服电话:021-50260603
公司网址:mstftec.com
(111)江苏汇林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檀大道47号
办公地址:上海市华龙区园路868号绿地海外滩办公A1605室
法定代表人:吴言林
联系人:孙平
电话:025-66046166
传真:025-66069309
客服电话:025-80046166
公司网址:www.huilinbf.com
(112)中国人寿保险股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街16号中国人寿广场A座
办公地址:北京市西城区金融大街16号中国人寿广场A座
法定代表人:王滨
传真:010-63631539
客服电话:96519
公司网址:www.e-chinalife.com
(113)嘉财财富基金销售有限公司
注册地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
法定代表人:陈勇
客服电话:4008997719
公司网址:www.jiacaifund.com
(114)深圳前海财厚基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区南山大道1088号南园枫叶大厦15层15K室
法定代表人:杨艳华
联系人:李彦
电话:0755-96576665
客服电话:400-698-0071
公司网址:www.caihuo.com
(115)方德保险代理有限公司
注册地址:北京市东城区东直门内大街46号12层02室
办公地址:北京市东城区东直门内大街46号12层02室
法定代表人:林柏均

客服电话:010-64069617
网站:www.fundsource.cn
(116)和合期货有限公司
注册地址:太原市菜园东街2号
办公地址:太原市菜园东街2号
法定代表人:刘晓洁
客服电话:400-660-4882
公司网址:www.hhqh.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金。
二、注册登记机构
名称:财通基金管理有限公司
住所:上海市虹口区吴淞路619号505室
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心41楼
法定代表人:夏理芬
电话:021-20637888
联系人:薛晨
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:021-51151028
传真:021-51150398
联系人:刘佳
经办律师:刘佳、范佳军
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
执行事务合伙人:毛贻敏
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方向经济贸大厦(东三办公楼)16层
办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
公司电话:(021)22288888
公司传真:(021)22280000
签字会计师:蒋燕华、骆文星
业务联系人:蒋燕华
四、基金名称
财通基金价值优选灵活配置混合型证券投资基金
五、基金的类型
混合型证券投资基金
六、基金的投资目标
利用定量投资模型,在有效控制风险的前提下,追求资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
七、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)、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股指期货、权证以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%-96%,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%,每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
八、投资策略
1.股票投资策略
本基金主要通过定量投资模型,选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合,在有效控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下,为保护投资者的本金安全,股票资产比例可降至0%。本基金运用的量化投资策略主要包括:
(1)多因子Alpha模型——股票超额回报预测
多因子Alpha模型以中国股票市场较长期的回溯研究为基础,结合前瞻性市场判断,用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处,以多因子在不同个股上的不同体现估算个股的超额回报。概括来讲,本基金Alpha模型的因子可归为如下几类:价值(value)、质量(quality)、动量(momentum)、成长(growth)、市场预期等等。其中,本基金侧重从基本面投资价值角度出发,参考市盈率、市净率、市销率、PEG、EV/EBITDA等估值指标,优选价值相对其成长性被低估的上市公司和股票资产。公司的量化研发团队会持续研究市场的状态以及市场变化,并对模型和模型所采用的因子做出更新或调整。
多因子Alpha模型利用长期积累并最新扩展的数据库,科学地考虑了大量的各类信息,包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方面的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,适合调整各因子类别的具体组成及权重。
(2)风险估值模型——有效控制预期风险
本基金利用风险预测模型和适当的风险控制措施,有效控制投资组合的预期投资风险,并力求对投资组合的实现风险控制有目标范围内。
(3)交易成本模型——控制交易成本以保护交易业绩
本基金的交易成本模型综合考虑固定成本,也考虑交易的市场冲击效应,以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上,进行投资收益的优化。
(4)投资组合的优化和调整
本基金综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。投资组合构建完成后,本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况,对投资组合进行相应调整,并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。
2.固定收益类资产投资策略
固定收益投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用风险管理 and 时机策略相结合的积极投资策略,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
(1)利率策略
本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测未来利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合久期、期限结构策略,如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。
(2)个券选择策略
个券选择层面,对各信用品种进行详细的基本面分析和非财务分析后,进行个券选择。财务分析方面,以企业财务指标为依归,对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分;非财务分析方面,包括管理能力、市场地位及发展前景等指标)则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。
(3)时机策略
i.价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性,建立债券的估值模型,对当日无交易的债券计算理论价值,买进价格低于价值的债券,相反,卖出价格高于价值的债券。
ii.骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时持有的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。
iii.息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购所获得资金投资于债券以获取超额收益。
iv.利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析,对利差水平的未来走势做出判断,从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时,买入收益率较高的债券同时卖出收益率低的债券,通过债券利差的缩小获得投资收益;当预期利差水平扩大时,买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。
3.权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资。权证投资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,结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标,选择权证的买入和卖出时机,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
4.股指期货投资策略
本基金将根据股指期货的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。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。
5.资产支持证券投资新策略
资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。
九、业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。
沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所编制,旨在反映A股市场整体走势的指数。该指数从上海和深圳证券交易所中选取300只交易活跃、代表性强的A股作为成份股,是目前中国证券市场市值覆盖率最高、可代表性且公信力较好的股票指数。本基金为灵活配置混合型基金,股票资产的投资比例最高可达基金资产的96%,在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金净资产的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证指数的所有权归属上海证券交易所。
随着法律法规和市场环境发生变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金,或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,或者推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数,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,与基金托管人协商一致后,对业绩比较基准进行相应调整,并报中国证监会备案并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。
十、风险收益特征
本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金产品,属于中高风险、中高收益的基金产品。
十一、基金投资组合报告
基金管理人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。
本投资组合报告中所列出的数据截至2020年4月31日,于2020年4月21日复核了本投资组合财务指标、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。
本报告财务资料未经审计,本投资组合报告所载数据截至2020年3月31日。
1.报告期末基金资产组合情况

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	占基金总资产的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	482,794.00	1.21
B	采矿业	471,930.68	1.18
C	制造业	16,033,311.87	41.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	326,630.92	0.82
E	建筑业	944,934.30	2.12
F	批发和零售业	944,424.60	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	158,033.06	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	5,390,028.69	13.50
J	金融业	6,580,881.70	21.49
K	房地产业	1,567,606.66	3.93
L	租赁和商务服务业	273,189.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	332,891.98	0.83
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	721,064.45	1.81
R	文化、体育和娱乐业	184,963.12	0.46
S	综合	-	-
合计		42,577,363.08	100.00

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有通过港股通机制投资的港股。
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	688111	金山办公	14,659	3,065,394.44	7.75
2	601318	中国平安	30,012	2,075,930.04	5.20
3	600036	招商银行	39,100	1,262,148.00	3.16
4	600619	烟台万润	1,120	1,244,320.00	3.12
5	000533	美的集团	25,238	1,222,023.96	3.06
6	600031	三一重工	48,382	837,008.60	2.10
7	600890	海尔智家	50,836	732,024.00	1.83
8	002475	立讯精密	16,900	644,904.00	1.62
9	600858	海澜之家	11,400	628,140.00	1.57
10	600887	伊利股份	18,175	542,705.60	1.36

4.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有债券。
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
本基金本报告期末未有债券。
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序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未有权证。
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
本基金本报告期末未有股指期货合约。
9.2.本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据股指期货的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。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。
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
本基金不投资国债期货。
10.2.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未有国债期货合约。
10.3.本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未有国债期货合约。
11.投资组合报告附注
11.1.报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。
11.2.报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
11.3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	104,299.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,482.62
5	应收申购款	3,794.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	111,576.24

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

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	688111	金山办公	3,065,394.44	7.75	新股限售

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,本报告中文涉及比例计算的分项之和与合计数之间可能存在尾差。
十二.基金的业绩
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,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。
(一)基金净值表现
基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准收益②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2019年1月30日至2019年12月31日	16.03%	0.98%	22.06%	0.95%	-6.03%	0.04%
2020年1月1日至2020年3月31日	-8.18%	1.98%	-6.88%	1.46%	-1.30%	0.52%
自基金合同生效起至今(2019年1月30日至2020年3月31日)	6.54%	1.26%	13.67%	1.07%	-7.13%	0.19%

注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
(2)本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。
(3)自基金合同生效以来本基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动比较

注:(1)本基金合同生效日为2019年01月30日;
(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月,截至报告期末及建仓期末,本基金的资产配置符合基金合同的相关要求;
十三.基金费用与税收
1.基金费用种类
1.1.基金管理人的管理费;
1.2.基金托管人的托管费;
1.3.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
1.4.基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所、仲裁费和诉讼费;
1.5.基金的销售费用;
1.6.基金的证券、期货交易费用;
1.7.基金的银行汇划费用;
1.8.账户开户费用及账户维护费用;
1.9.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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初三个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,应及时联系基金托管人协商解决。
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管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初三个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,应及时联系基金托管人协商解决。
托管费账户:基金户
户名:基金托管费收入
账号:1001101738000001
开户银行:中国光大银行(系统支付号303100000006)
上述“(一)基金费用的种类”中第3-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1.基金管理人 and 基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失;
2.基金管理人 and 基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3.基金合同生效前的相关费用;
4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(四)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。
十四.对招募说明书更新部分的说明
1.“重要提示”部分
(1)增加了投资科创板股票的风险提示;
(2)更新了本招募说明书所载内容截止日及与有关财务数据截止日。
2.“三.基金管理人”部分
(1)更新了主要人员情况。
3.“四.基金托管人”部分
(1)更新了基金托管人基本情况;
(2)更新了基金托管部1及主要人员情况;
(3)更新了基金托管人内部控制制度;
(4)更新了基金托管人与基金管理人运作基金进行监督的方法和程序。
4.“五.相关服务机构”部分
(1)更新了直销机构方面信息;
(2)更新了代销机构方面信息;
(3)更新了基金份额的申购与赎回”部分
(4)更新了申购本基金份额单笔最低金额。
5.“九.基金的投资”部分
(1)更新了基金投资组合报告。
7.“十.基金的业绩”部分
(1)更新了基金的业绩。
(2)更新了基金的会计与审计”部分
(3)更新了基金的特有风险。
11.“二十一.对基金份额持有人的服务”部分
(1)更新了基金份额持有人的服务。
12.“二十二.其他应披露事项”部分
(1)更新了其他应披露事项。