

B090 信息披露 | Disclosure

(上接B089版)

公司网址:www.e-chinallie.com
 (46) 中信证券华南股份有限公司
 注册地址: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
 办公地址: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
 客户服务热线:95396
 公司网址:www.gzs.com.cn
 (47) 上海好买基金销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
 办公地址:上海市浦东新区1118号鄂尔多斯大厦903-906室
 法定代表人:杨文斌
 客服电话:400-700-9665
 公司网站:www.ehowbuy.com
 (48) 深圳众基金销售股份有限公司
 注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
 办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
 法定代表人:薛峰
 客服电话:4006-788-887
 公司网站:www.zfund.cn www.jjmmw.com
 (49) 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:杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6楼
 法定代表人:祖国明
 客服电话:400-0766-123
 公司网站:www.fund123.cn
 (50) 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号东方财富大厦
 法定代表人:其实
 客服电话:400-1818-188
 网站:www.1234567.com.cn
 (51) 浙江同花顺基金销售有限公司
 注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
 办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
 法定代表人:凌顺平
 客服电话:4008-773-772
 公司网站:www.5ifund.com
 (52) 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:胡学勤
 客服电话:400-821-9031
 网站:www.lufunds.com
 (53) 北京虹点基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室
 办公地址:北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室
 法定代表人:何静
 客服电话:400-618-0707
 网站:www.hongdianfund.com
 (54) 珠海盈米财富管理有限公司
 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
 法定代表人:肖雯
 客服电话:020-89629066
 网站:www.yingmi.cn
 (55) 北京新浪乐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:李昭琛
 客服电话:010-62675369
 网站:www.xincail.com
 (56) 北京肯特瑞基金销售有限公司
 注册地址:北京市通州区西三旗建材城中路12号17号平房157
 办公地址:北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座15层
 法定代表人:王苏宁
 客服电话:95118
 网站:kentretui.jd.com
 (57) 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号环球金融中心A座5层
 法定代表人:钱昊旻
 客服电话:4008-909-998
 网站:www.jnlccom
 (58) 奕丰基金销售有限公司
 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:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
 法定代表人:TEO WEE HOWE
 客服电话:400-684-0500
 网站:www.ifastps.com.cn
 (59) 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:北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼
 法定代表人:葛新
 客户服务热线:95055
 公司网站:www.baiyingfund.com
 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,并在基金管理人网站公示。
 (二) 基金注册登记机构:
 上投摩根基金管理有限公司(同上)
 (三) 律师事务所及经办律师:
 名称:上海源泰律师事务所
 注册地址:上海市浦东新区256号华夏银行大厦14楼
 负责人:廖海
 联系电话:021-5115 0298
 传真:021-5115 0398
 经办律师:梁丽娟、刘佳
 (四) 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)
 注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展银银行大厦楼
 办公地址:中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
 执行事务合伙人:李丹
 联系电话:(021) 23238888
 传真:(021) 23238900
 联系人:沈兆杰
 经办注册会计师:薛竟、沈兆杰
 四、基金概况
 基金名称:上投摩根核心优选混合型证券投资基金
 基金的类别:混合型证券投资基金
 基金运作方式:契约型开放式
 五、基金份额的申购、赎回及转换
 1.基金申购份额的计算
 申购费用 = (申购金额 × 申购费率) / (1 + 申购费率)
 净申购金额 = 申购金额 - 申购费用
 申购份额 = 净申购金额 / T日基金份额净值
 申购费率如下表所示:

申购金额区间	费率
人民币0元(含)以下	1.5%
人民币0元(含)以上,5000元以下	1.0%
人民币5000元以上(含)	每笔人民币1,000元

2.基金赎回份额的计算
 本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,
 赎回总额 = 赎回份数 × T日基金份额净值
 赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率
 赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用
 赎回费率如下表所示:

持有基金份额期限	费率
小于7日	1.5%
大于等于7日,小于1年	0.5%
大于等于1年,小于3年	0.35%
大于等于3年,小于5年	0.2%
三年以上(含)	0%

3. 基金转换
 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。
 六、基金的投资
 (一) 投资目标
 本基金将充分利用基金管理人研究团队的集体智慧,以内部研究组合作为核心股票,从中优选出具有良好基本面和较高成长性的公司进行投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。
 (二) 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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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)。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
 基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的75%—95%,其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的80%;权证投资占基金资产净值的0—3%;现金或到期日在一年期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。
 (三) 投资策略
 1、资产配置策略
 本基金将从宏观层面出发,采用定量分析和定性分析相结合的手段,对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析,结合股票、债券等各类资产风险收益特征,确定合适的资产配置比例。本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化,适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例,动态优化投资组合。
 在控制风险的前提下,本基金将优先配置股票资产,本基金股票资产占基金资产的比例为75%—95%,其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的80%
 2. 股票投资策略
 本基金将依托本基金管理人的研究平台,采用“自下而上”的个股精选策略,基于公司内部研究团队对于个股的基本面的深入研究和细致的实地调研,选择具有良好基本面和成长空间的个股。
 本基金将研究团队的集体智慧与基金经理的个人能力充分结合,强调研究对于投资的前导作用和支撑作用,目标是更有价值的研究成果尤其是内部研究成果转化为基金业绩。本基金的股票投资包含核心股票和优选股票两个层面。核心股票由公司内部研究组合构成,主要包含了研究员推荐股票,是研究员在对个股进行深度研究和实地调研基础上提出的投资建议; 优选股票是指基金经理基于对宏观经济、政策、行业以及个股的深入研究与把握,从核心股票中优选具有良好投资价值的股票,构建股票投资组合。
 本基金明确提出将不低于80%的股票资产投资于公司内部研究组合中的股票。通过纪律化的投资约束,将研究成果积极转化为投资业绩。内部研究组合的构建主要由研究团队负责,具体而言,研究员采用定性分析与定量分析相结合的分析方法,通过对行业内个股的深入的基本面研究,对上市公司的投资价值进行综合评价,精选质地优良、具有较强竞争优势的公司,构建内部研究组合。基本面研究由于专注于企业在管理、品牌、资源、技术、创新能力各方面的深入分析,因此可以更加准确地挑选出具有投资价值的公司。
 在具体操作上,我们将采用自下而上的个股精选策略,综合运用定量分析与定性分析的手段,对公司基本面上进行价值挖掘。
 (1) 定量分析
 定量的方法主要通过对公司财务状况、盈利质量、成长能力、估值水平等方面的综合评估,选择财务健康、成长性好的公司。
 ①财务状况:评估公司的财务穿越宏观经济和行业的萧条和衰退期的能力,主要考察指标为资产负债率、资产周转率、流动比率等;
 ②盈利质量:评估公司持续发展能力,主要考察近三年平均净资产收益率(ROE)、近三年平均投资资本回报率(ROIC);
 ③成长能力:评估公司未来发展趋势与发展速度,成长能力是随着市场环境的变化,企业资产规模、盈利能力、市场占有率持续增长的能力,反映了企业未来的发展前景。主要考察指标为净利润增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率;
 ④估值分析:评估公司相对市场和行业的相对投资价值,选择价格低于价值的上市公司,或是比较企业动态市盈率等指标,选择目前估值水平明显较低或估值合理的上市公司,主要考察指标为市盈率(P/E)、市净率(P/B)、PEG、EV/EBITDA等。
 (2) 定性分析
 在定量分析的基础上,本基金将从以下几个方面,对公司基本面上做进一步的定性分析,选择具备投资潜力的个股。
 ①行业地位突出,有市场定价能力。属于行业龙头,具有较高的市场占有率,对产品定价具有较强的影响力。
 ②具有核心竞争力。在管理、品牌、资源、技术、创新能力中的某一方面或多个方面具有竞争对手在短时间内难以模仿的显著优势,从而能够获得超越行业平均的盈利水平和增长速度。
 ③主营业务突出,具有良好的盈利能力。主营业务收入占比高,盈利能力高于行业平均水平,未来盈利具有可持续性。
 ④公司治理结构规范,管理能力强。已建立合理的公司治理结构和市场化经营机制,管理层对企业未来发展有明确的方向和清晰的思路。
 3、行业配置策略
 本基金在精选个股的基础上,对投资组合进行适度均衡的行业配置。本基金将对宏观经济的发展状况及趋势、行业周期性及景气度、行业相对估值水平等方面进行研究,判断各个行业的相对投资价值。在此基础上,参考整体市场的行业资产分布比例,确定和动态调整各个行业的配置比例。
 4、固定收益类投资策略
 对于固定收益类资产的选择,本基金将以价值分析为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。
 在类属配置层次,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。
 在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体策略有:
 (1) 利率预期策略:本基金首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成合理预期。
 (2) 估值策略:建立不同品种的收益率曲线预测模型,并利用这些模型进行估值,确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值的券种。
 (3) 久期管理:本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化评估为核心,通过久期管理,合理配置投资品种。
 (4) 流动性管理:本基金通过紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等,建立组合流动性预警指标,实现对基金资产的结构化管理,以确保基金资产的整体变现能力。
 5、可转换债券投资策略
 可转换债券(含交易分离可转债)兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征,在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析,投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券,获取稳健的投资回报。
 6. 权证投资策略
 权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金在投资权证时,将通过权证标的证券基本面的深入研究,结合权证定价模型及其隐含波动率等指标,寻求其合理的估值水平,谨慎投资,以追求较稳定的当期收益。
 7. 股指期货投资策略
 本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,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,将通过对冲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。
 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。
 (四) 投资限制
 1. 组合限制
 基金的投资组合应遵循以下限制:
 (1) 股票资产占基金资产的75%—95%,其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的80%;
 (2) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
 (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;
 (4) 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,不超过该公司可流通股票的15%;
 (5) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该公司可流通股票的30%;

(6) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
 (7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
 (8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
 (9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
 (10) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
 (11) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
 (12) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
 (13) 本基金投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
 (14) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
 (15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
 (16) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金投资协议中明确基金投资流通受限证券的条件,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;
 (17) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;
 (18) 本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;
 (19) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;
 本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;
 (20) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的75%—95%;
 (21) 本基金在任何交易日日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;
 (22) 本基金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、应收申购款等;
 (23) 本基金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以外的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;
 (24) 本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的投资范围保持一致。
 本基金在开始进行股指期货投资之前,应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。
 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人以外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,除上述(13)、(22)、(23)、(24)条所述情况外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。
 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
 法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。
 2、禁止行为
 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
 (1) 承销证券;
 (2) 向他人贷款或者提供担保;
 (3) 从事承担无限责任的投资;
 (4) 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
 (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
 (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
 (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
 (8) 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。
 (五) 业绩比较基准
 沪深300指数收益率 × 85% + 上证国债指数收益率 × 15%
 沪深 300指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300只 A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。
 本基金是混合型基金,基金在运作过程中将维持75%—95%的股票资产,其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为85%和15%,并用上证国债指数收益率代表债券资产收益率。因此,“沪深300指数收益率 × 85% + 上证国债指数收益率 × 15%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。
 如果出现上述基准指数停止计算编制或更名,或者今后法律法规发生变化,或者是市场中出现更有代表性、更能科学反映投资组合更合理的复合指数更具比例,本基金将根据实际情况在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更履行适当的程序,报中国证监会备案,并予以公告。
 (六) 风险收益特征
 本基金是一只主动投资的混合型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。
 根据2017年7月1日施行的《证券投资基金销售适用管理办法》,基金管理人及相关销售机构已对本基金重新进行风险评级, 风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征,但由于风险等级分类标准的变化,本基金的风险等级表述可能有相应变化,具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。
 (七) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法
 1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益;
 2.不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;
 3.有利于基金财产的安全与增值;
 4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不正当利益。
 (八) 基金的融资、融券
 本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。
 (九) 基金的投资组合报告
 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	656,272,092.94	86.69
2	其中:股票	656,272,092.94	86.69
3	其中:债券	499.29	0.00
4	资产支持证券	499.29	0.00
3	金融投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	108,332,546.76	14.17
7	其他各项资产	1,129,273.92	0.15
8	合计	764,734,411.90	100.00

2. 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、业	19,398,038.68	2.58
B	采矿业	10,489,444.00	1.40
C	制造业	562,081,494.64	73.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	13,716,171.31	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	信息传输、软件和信息技术服务业	26,543,627.39	3.47
I	金融业	4,126,274.04	0.54
K	房地产业	5,209,073.00	0.69
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	14,697,069.99	1.95
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	--	--
S	综合	--	--
合计		656,272,092.94	87.16

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	000661	长春高新	90,419	49,549,612.00	6.59
2	300014	亿纬锂能	723,277	42,610,726.67	5.67
3	002079	盐湖股份	685,831	28,256,793.98	3.70
4	000576	新希望	795,143	24,079,574.49	3.20
5	600031	三一重工	1,379,827	23,197,101.30	3.18
6	300709	宁德时代	192,981	23,232,982.59	3.09
7	603889	奥普创新	89,362	21,424,077.52	2.88
8	300752	卓创信息	49,046	20,897,866.00	2.79
9	002556	三七互娱	627,193	20,810,723.38	2.77
10	000980	顺鑫农业	319,148	19,592,495.72	2.61

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	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
4	其中:政策性金融债	--	--
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转换债(可交换债)	499.29	0.00
8	国债存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	499.29	0.00

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明细

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	128928	鹏博转债	4	499.29	0.00

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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
 本基金本报告期末未持有贵金属。
 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。
 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 本基金本报告期末未持有股指期货。
 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 本基金本报告期末未持有国债期货。
 11. 投资组合报告附注
 1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。
 2) 报告期内本基金投资的前十名股票没有存在基金合同规定的备选股票库。
 3) 其他各项资产构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	364,777.26
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	26,671.11
5	应收申购款	738,626.46
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	1,129,273.92

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128928	鹏博转债	499.29	0.00

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明:
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
 6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分
 因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。
 七、基金的业绩
 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。

期间	净值增长率①	净值增长率基准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
2012/11/28-2012/12/31	5.30%	0.50%	14.74%	1.31%	-9.44%	-0.81%
2013/01/01-2013/12/31	40.17%	15.3%	-6.09%	1.18%	46.26%	0.35%
2014/01/01-2014/12/31	27.03%	1.29%	44.57%	1.03%	-17.54%	0.26%
2015/01/01-2015/12/31	61.28%	3.15%	5.66%	2.11%	56.62%	1.07%
2016/01/01-2016/12/31	-29.87%	1.9%	-9.89%	1.39%	-30.95%	0.79%
2017/01/01-2017/12/31	39.80%	1.24%	16.61%	1.44%	38.29%	0.78%
2018/01/01-2018/12/31	-32.28%	1.85%	-20.67%	0.74%	-11.61%	0.44%
2019/01/01-2019/12/31	61.25%	1.27%	31.21%	1.06%	29.94%	0.21%
2020/01/01-2020/03/31	5.73%	2.56%	-8.17%	1.69%	13.90%	0.89%

八、费用概览
 (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,但法律法规、中国证监会另有规定的除外;
 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
 5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的证券交易费用;
 7. 基金的银行汇划费用;
 8. 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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
 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
 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
 上述“一、基金费用的种类中第3—7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、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
 2. 基金管理人和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