

(上接A23版)

45	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:95368 网址:www.hlzq.com
46	平安证券 股份有限公司	注册地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层 办公地址:深圳市福田区益田路5033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
47	东海证券 股份有限公司	注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层 办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法定代表人:赵俊 客服电话:400-666-8888 网址:www.longone.com.cn
48	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:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号 法定代表人:赵洪波 客服电话:400-666-2288 网址:www.jhzq.com.cn
49	广州证券 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楼、20楼 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路6号广州国际金融中心5楼 法定代表人:刘东 客服电话:95336 网址:www.gzs.com.cn
50	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
51	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:95355、400-809-6096 网址:www.swsc.com.cn
52	国都证券 股份有限公司	注册地址:北京市东城区东直门内大街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内大街3号国华投资大厦9层10层 客服电话:400-818-8118 网址:www.guodu.com
53	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198号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 法定代表人:章宏韬 客服电话:95318 网址:www.hazq.com
54	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:95323 网址:www.cfsc.com.cn
55	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.gjqz.com.cn
56	华西证券 股份有限公司	注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人:杨炯洋 客服电话:95584 网址:www.hx168.com.cn
57	宏信证券 有限责任公司	注册地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼 办公地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼 法定代表人:吴玉明 客服电话:4008-366-366 网址:www.hxszq.com
58	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1301-1305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:张磊 客服电话:400-990-8826 网址:www.citics.com
59	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
60	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
61	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5幢5层590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
62	深圳众禄 基金股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼B01 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼B01 法定代表人:薛峰 客服电话:4006-788-887 网址:www.zlfund.cn及www.jimw.com
63	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:张跃伟 客服电话:400-820-2899 网址:www.ericfund.com
64	北京展恒 基金销售有限公司	注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址:北京市朝阳区安苑路11号邮电新闻大厦6层 法定代表人:闫振杰 客服电话:0510-9688988 网址:www.myfund.com
65	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
66	江苏金百 临投资咨询股份有限公司	注册地址:无锡市滨湖区锡溪路99号 办公地址:无锡市滨湖区锡溪路锦泽路科教软件园三期9号 法定代表人:费晓燕 客服电话:0510-9688988 网址:www.jspl.com
67	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

68	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.zscifund.com
69	上海万得 基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 办公地址:上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层 法定代表人:李兴春 客服电话:95733 网址:www.iwdfund.com.cn
70	鼎信汇金(北京) 投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区太阳园3号楼5层521室 办公地址:北京市海淀区太阳园3号楼5层521室 法定代表人:齐凌峰 客服电话:400-158-5050 网址:www.9ifund.com
71	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号锦昌大厦一层观诚财富杭州 法定代表人:徐黎云 客服电话:400-068-0058 网址:www.jincheng-fund.com
72	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63层6312-15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
73	宜信普泽(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
74	一路财富(北京) 基金销售股份有限公司	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
75	北京财顺 基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号 办公地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号 法定代表人:罗细安 客服电话:4001019091 公司网站:www.zcvc.com.cn
76	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2773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.66lantai.com
77	汇付基金 销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元 办公地址:上海市徐汇区宜山路700号普大软件园C5幢 法定代表人:金佶 客服电话:021-34013999 网址:www.hotitj.cn
78	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:4008219031 网址:www.lufunds.com
79	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龙园3号 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号 法定代表人:李春光 客服电话:4000411001 网址:www.taichengcaifu.com
80	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
81	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B座裙楼二层 法定代表人:魏福峰 客服电话:400-618-0707 网址:www.hongdianfund.com
82	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号院1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号院1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
83	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号富都大厦A座7层 法定代表人:洪弘 客服电话:400-166-1188 网址:8rj.com.cn
84	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602-115室 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦 法定代表人:陈维武 客服电话:4006-433-389 网址:www.vstonewealth.com
85	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.com
86	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.com
87	北京新弘 安石基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区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:北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座 法定代表人:赵世宏 客服电话:010-62757369 网址:www.xinai.com
88	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
89	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:95177 网址:www.snjijin.com
90	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号11层1108 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层 法定代表人:王志刚 客服电话:400-619-9059 网址:www.hcjin.com

91	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9层 法定代表人:李修峰 客服电话:010-59013895 网址:www.wanjiawealth.com
92	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:梁蓉 客服电话:400-6262-818 网址:www.5irich.com
93	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:叶倩 客服电话:400-066-8586 网址:www.igesafe.com
94	北京肯特 瑞基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区显龙山路19号1幢4层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:95118 网址:www.fundjct.com
95	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22207 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:钟斐斐 客服电话:4001598288 网址:danjuanapp.com
96	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大厦中心30层3001室 法定代表人:周斌 客服电话:4008980618 网址:www.chtwm.com
97	上海华夏 财富投资管理有限公司	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:毛淮平 客服电话:400-817-5666 网址:www.amcfuture.com
98	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:沈丹义 客服电话:4001019301 网址:www.tonghuafund.com
99	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:4006-802-123 网址:www.zhixin-inv.com
100	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16号号楼6楼603 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16号6楼603 法定代表人:王璇 客服电话:4000-555-671 网址:www.hgcpcb.com
101	腾安基金 销售(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:tengxianxin.com
102	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5层 法定代表人:钱昊晏 客服电话:4008909998 网址:www.jnlc.com
103	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:北京市海淀地上地信息路甲9号壹力大厦 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南路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  
经办律师:黎明、丁媛  
联系人: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号星展银行大厦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:许康玮、魏佳亮  
第四部分 基金名称  
国泰健康股票型证券投资基金  
第五部分 基金类型和存续期限  
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  
本基金主要投资于大健康主题股票,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、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大健康主题证券资产占非现金基金资产的比例不低于80%;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,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,基金管理人将在履行适当程序后,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  
中国人口基数大,本身蕴含巨大的健康需求。一方面,随着经济发展、中产及富裕阶层的崛起,以财富换取健康的观念不断深化,人们日益注重健康及生活品质。另一方面,人口日益老龄化,多数慢性病发病率随着年龄上升而迅速提高,国家推行“预防-治疗-康复”三位一体健康服务体系。在此特定背景下,涵盖疾病预防、医疗、康复、养老的大健康产业产业链及相关上市公司面临巨大的发展机遇。

本基金在投资运作中,淡化大类资产配置,侧重在大健康主题各子行业灵活配置,并在行业内精选个股,以期实现基金资产的保值增值。

1.股票投资策略  
(1)大健康主题的界定  
本基金通过对大健康主题相关子行业的精选以及对行业内相关资产的深入分析,挖掘该类型资产的投资价值。  
大健康主题是指经济系统中提供预防、诊断、治疗和康复等与健康相关商品和服务领域的总称,通常包括医药生产制造、医药销售流通、医疗服务、健康保健服务、健康保险、健康食品、健康家居、休闲健身、环保防疫及养老服务等领域。  
未来随着经济增长及产业转型的进一步发展,大健康主题的外延可能将不断扩大,本基金将根据实际情况对大健康主题的界定方法进行调整。  
(2)大健康主题各子行业配置策略  
大健康主题涉及的子行业广泛,本基金将从子行业的成长性和空间、景气度、估值水平等多个维度来对大健康主题各子行业进行研究分析,实现投资组合在大健康主题各子行业之间的灵活、合理、高效配置。  
(3)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券种选择方法构建债券投资组合,配置能够提供稳定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、交易活跃的股指期货合约。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,降低股票组合的系统性风险。  
4.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。  
5.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。  
6.权证投资策略  
权证为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  
中证健康产业指数收益率×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。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	340,879,172.65	92.56
	其中:股票	340,879,172.65	92.56
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	27,141,824.82	7.37
7	其他各项资产	273,110.45	0.07
8	合计	368,294,107.92	100.00

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	25,071,891.40	6.90
C	制造业	240,400,606.35	66.19
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	75,310,094.60	20.74
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	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
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	-	-
O	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	340,879,172.65	93.86

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	000661	长春高新	104,328	35,262,864.00	9.71
2	002563	森马服饰	3,203,300	35,068,498.00	9.66
3	603883	老百姓	596,495	34,883,027.60	9.60
4	603605	珀莱雅	504,475	33,386,155.50	9.19
5	300326	凯利泰	3,576,678	32,368,935.90	8.91
6	002019	亿帆医药	2,464,208	30,186,548.00	8.31
7	002683	宏川水泥	2,122,706	24,835,660.20	6.84
8	002831	裕同科技	1,141,445	21,881,500.65	6.03
9	603939	益丰药房	293,300	20,528,067.00	5.65
10	603233	大参林	442,400	19,899,000.00	5.48

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持有债券。

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持有债券。  
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序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  
(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投资。  
(2)本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期末未持有股指期货。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 and 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量股指期货的收益性、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。  
10.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。  
11.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	127,717.72
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	6,829.82
5	应收申购款	138,562.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	273,110.45

(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(%)	受限情况说明
1	002563	森马服饰	8,488,000.00	2.34	大宗交易

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

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。投资者有风险,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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2016年2月3日至2016年12月31日	25.30%	1.03%	14.61%	1.08%	10.69%	-0.05%
2017年度	23.54%	1.04%	2.83%	0.66%	20.71%	0.38%
2018年度	-23.45%	1.73%	-27.80%	1.13%	4.35%	0.60%
2019年上半年	31.56%	1.67%	14.83%	1.37%	16.73%	0.30%
2016年2月3日至2019年6月30日	65.90%	1.38%	-2.30%	1.04%	68.20%	0.34%

注:2016年2月3日为基金合同生效日。  
第十二部分 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:  
 $H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$   
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  
基金管理费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的数据,自动在月初个工作日内,按照指定的账户路径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:  
 $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$   
H为每日应计提的基金托管费  
E为前一日的基金资产净值  
基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的数据,自动在月初个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。  
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。  
基金管理人人和基金托管人可根据基金运作情况调低基金管理费率 and 基金托管费率,无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。  
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