

B250 信息披露 Disclosure

(上接B251版)

- 2) 以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的依据;
- 3) 国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2. 投资管理程序

1) 投资基础研究

对于债券投资,分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断,开展标的指数跟踪、成份债券筛选成份债券等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,为本基金投资管理提供决策依据。

2) 资产配置会议

本基金管理人定期召开资产配置会议,讨论基金的资产组合,形成资产配置建议。

3) 构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下,审议并确定基金资产配置方案,并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下,根据本基金的资产配置要求,参考资产配置会议、投研会议讨论结果,制定基金的抽样复制计划和具体个券投资组合,在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。

4) 交易执行

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。

5) 投资组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况,监察稽核部对基金投资进行日常监督,风险管理部负责内部的风险业绩和风险评估。基金经理根据标的指数的每日变动情况,结合成份债券等的基本面、流动性、基金申购赎回的现金流量等情况,以及基金投资绩效评估结果等,对基金投资组合进行动态监控和调整优化,密切跟踪标的指数。

九、业绩比较基准

中证兴业中高等级信用债指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%

由于本基金投资标的指数为中证兴业中高等级信用债指数,且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%,因此本基金将业绩比较基准定为中证兴业中高等级信用债指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

若基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更,基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准。若业绩比较基准和标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案,并在指定媒介上公告。若业绩比较基准、标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名、指数编制方案调整等),无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人调整业绩比较基准应取得基金托管人同意后,报中国证监会备案,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介

上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型指数基金,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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。基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,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取自本基金2019年4季度报告,所载数据截至至2019年12月31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	--	--
	其中:股票	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	9,683,942.21400	97.47
	其中:国债	9,683,942.21400	97.47
	资产支持证券	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
	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	47,276,515.98	0.48
8	其他资产	203,744,386.89	2.05
9	合计	9,934,963,128.77	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

3.1 报告期末指数投资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

本基金本报告期末未持有股票。

3.2积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,171,909,000.00	15.11
	其中:政策性金融债	663,673,000.00	8.56
4	企业债券	3,851,128,314.00	49.67
5	企业短期融资券	654,086,800.00	8.30
6	中期票据	3,706,818,100.00	47.80
7	可转换债(可交换债)	--	--
8	资产支持证券	--	--
9	其他	--	--
10	合计	9,683,942,214.00	124.89

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

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	1800002	18国债(零)半	3,850,000	406,068,000.00	5.25
2	143463	18国开01	3,600,000	368,388,000.00	4.75
3	190206	19国债06	2,800,000	280,416,000.00	3.36
4	101800667	18晋交债	1,900,000	202,597,000.00	2.61
5	1700416	17晋交新债01	1,900,000	200,678,000.00	2.59

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包含股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金投资范围不包含国债期货。

10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	93,038.91
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	203,426,650.97
5	应收申购款	224,700.01
6	其他应收款	--
7	其他	--
8	合计	203,744,386.89

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持有可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2019年12月31日。

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。

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。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	--	--
	其中:股票	--	--
2	基金投资	240,080,550.80	2.42
3	固定收益投资	10,014,000.00	0.10
	其中:国债	10,014,000.00	0.10
4	资产支持证券	--	--
5	贵金属投资	--	--
6	金融衍生品投资	--	--
7	买入返售金融资产	--	--
8	银行存款和结算备付金合计	391,469,778.00	3.94
9	其他资产	203,534,507.96	2.06
10	合计	9,934,963,128.77	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	10,014,000.00	0.10
	其中:政策性金融债	10,014,000.00	0.10
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)	--	--
8	资产支持证券	--	--
9	其他	--	--
10	合计	10,014,000.00	0.10

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

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	180011	18国债11	100,000	10,014,000.00	0.10

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金投资范围不包括股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金投资范围不包括国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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,本基金未持有股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,288.14
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	30,030.01
4	应收利息	70,662.20
5	应收申购款	306,531.21
6	其他应收款	--
7	其他	--
8	合计	311,481.56

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持有可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比

较基准收益率比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
自基金合同生效日至2019年11月04日(2019年11月04日至2019年12月31日)	0.20%	0.05%	-1.03%	0.10%	2.13%	-0.05%
2017年1月1日至2017年12月31日	2.40%	0.05%	3.47%	0.05%	0.03%	0.00%
2018年1月1日至2018年12月31日	7.54%	0.07%	6.85%	0.05%	0.69%	0.02%
2019年1月1日至2019年12月31日	5.02%	0.05%	6.79%	0.05%	-1.77%	0.00%
自基金合同生效日起至2019年12月31日	15.89%	0.06%	13.55%	0.06%	2.34%	0.00%

注:基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、基金的费用与税收

(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、基金的标的指数许可使用费;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
- 6、基金份额持有人大会费用;
- 7、基金的证券交易费用;
- 8、基金的银行汇划费用;
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用;
- 10、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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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,经基金管理人及基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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、公休日等,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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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,经基金管理人及基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3. 指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。在通常情况下,指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.015%年费率计提。具体计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的指数许可使用费,E为前一日的

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2019年12月31日,下述数据未经审计。

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。

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。

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
自基金合同生效日至2019年12月31日	2.75%	0.16%	3.8%	0.54%	-0.74%	-0.38%

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
自基金合同生效日至2019年12月31日	2.00%	0.17%	3.8%	0.54%	-0.09%	-