

(上) C113 基金

5号楼 3701-3717 办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层 法人:施华 联系人:程博浩 电话:0755-83155216 传真:010-56437000 网址:www.foundesc.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:李洪涛 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

C114 基金

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:王浩 联系人:王浩 电话:0755-83461832 传真:010-59582468 网址:www.cincof.com

第十一部分 基金的投资报告摘要

本基金管理人董春云及基金经理王浩在报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

本基金管理人中国银行股份有限公司根据本合同约定,于 2020 年 1 月 10 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,保证基金信息不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 9 月 30 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

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

(2) 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

4. 报告期末按品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券:

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. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有衍生品。

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

12. 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没有被监管部门立案调查,且报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

13. 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

14. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

15. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

16. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

17. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

18. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

19. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

20. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。

21. 基金募集情况

本基金于 2019 年 9 月 30 日募集成立,截至 2019 年 9 月 30 日,基金规模已达到 10 亿元。

22. 基金合同生效以来基金资产净值及基金份额变动情况

本基金合同生效以来,基金资产净值和基金份额均呈现稳步增长态势。

23. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

24. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

25. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

26. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

27. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

28. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

29. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。

30. 基金募集情况

本基金于 2019 年 9 月 30 日募集成立,截至 2019 年 9 月 30 日,基金规模已达到 10 亿元。

31. 基金合同生效以来基金资产净值及基金份额变动情况

本基金合同生效以来,基金资产净值和基金份额均呈现稳步增长态势。

32. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

33. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

34. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

35. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

36. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

37. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

38. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。

39. 基金募集情况

本基金于 2019 年 9 月 30 日募集成立,截至 2019 年 9 月 30 日,基金规模已达到 10 亿元。

40. 基金合同生效以来基金资产净值及基金份额变动情况

本基金合同生效以来,基金资产净值和基金份额均呈现稳步增长态势。

41. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

42. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

43. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

44. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

45. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

46. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

47. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。

48. 基金募集情况

本基金于 2019 年 9 月 30 日募集成立,截至 2019 年 9 月 30 日,基金规模已达到 10 亿元。

49. 基金合同生效以来基金资产净值及基金份额变动情况

本基金合同生效以来,基金资产净值和基金份额均呈现稳步增长态势。

50. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

51. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

52. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

53. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

54. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

55. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

56. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。

57. 基金募集情况

本基金于 2019 年 9 月 30 日募集成立,截至 2019 年 9 月 30 日,基金规模已达到 10 亿元。

58. 基金合同生效以来基金资产净值及基金份额变动情况

本基金合同生效以来,基金资产净值和基金份额均呈现稳步增长态势。

59. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

60. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

61. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

62. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

63. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

64. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

65. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。

66. 基金募集情况

本基金于 2019 年 9 月 30 日募集成立,截至 2019 年 9 月 30 日,基金规模已达到 10 亿元。

67. 基金合同生效以来基金资产净值及基金份额变动情况

本基金合同生效以来,基金资产净值和基金份额均呈现稳步增长态势。

68. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

69. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

70. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

71. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

72. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

73. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

74. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。

75. 基金募集情况

本基金于 2019 年 9 月 30 日募集成立,截至 2019 年 9 月 30 日,基金规模已达到 10 亿元。

76. 基金合同生效以来基金资产净值及基金份额变动情况

本基金合同生效以来,基金资产净值和基金份额均呈现稳步增长态势。

77. 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%

78. 基金业绩评价

本基金自 2019 年 9 月 30 日成立以来,业绩表现良好,超额收益明显。

79. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构

基金管理人:广发基金管理有限公司;基金托管人:广发证券股份有限公司;基金销售机构:广发证券股份有限公司;基金注册登记机构:广发基金管理有限公司;基金审计机构:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)

80. 基金投资策略

本基金为主动管理型股票基金,采用自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置和个股选择。

81. 基金风险控制

本基金建立了完善的风险管理体系,通过多层次、全流程的风险控制,确保基金资产的安全。

82. 基金费用

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提。

83. 基金分红

本基金收益分配方式为现金分红,每季度末最后一个交易日进行分红。