

证券代码: 603530 证券简称: 神马电力 公告编号: 2020-026
江苏神马电力股份有限公司 2019 年年度权益分派实施公告

本次利润分配方案以方案实施前的公司总股本 400,044,490 股为基数, 每股派发现金红利 0.22 元(含税), 共计派发现金红利 88,009,787.80 元。

股份类别	股权登记日	最后交易日	除权(息)日	现金红利发放日
A 股	2020/6/8	-	2020/6/9	2020/6/9

四、分配实施办法
1. 实施办法
无限售条件流通股的红利委托中国结算上海分公司通过其资金清算系统向股权登记日上海证券交易所有效收市后登记在册并在上海证券交易所有关会员单位办理指定交易的股东派发。已办理指定交易的投资者可于红利发放日在其指定的证券营业网点领取现金红利, 未办理指定交易的股东红利暂由中国结算上海分公司保管, 待办理指定交易后再进行派发。
2. 自行发放对象
上海神马电力控股有限公司、陈小琴两名股东由公司自行派发。
3. 扣税说明
(1) 对于持有公司无限售条件流通股 A 股股票的个人股东及证券投资基金, 根据《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2012]85 号) 及《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》

(财税[2015]101 号) 的有关规定, 个人(包括证券投资基金)从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税, 本次实际派发的现金红利为每股人民币 0.22 元; 对于持股期限在 1 年以内(含 1 年)的, 公司暂不扣缴个人所得税, 本次实际派发的现金红利为每股人民币 0.22 元, 待个人(包括证券投资基金)转让股票时, 中国结算上海分公司根据其持股期限计算实际应纳税额, 由证券公司等股份托管机构从个人、证券投资基金的资金账户中扣收并划付至中国结算上海分公司, 中国结算上海分公司于次月 5 个工作日内划付公司, 公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳。
实际税负为: 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额, 实际税负为 20%; 持股期限在 1 个月以上 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额, 实际税负为 10%; 持股期限超过 1 年的, 其股息红利所得暂免征收个人所得税。
(2) 对于持有公司有限售条件流通股 A 股股票的个人股东及证券投资基金, 根据《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2012]85 号) 有关规定, 解禁后取得的股息红利, 按该规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息红利继续暂减按 50% 计入应纳税所得额, 适用 20% 的税率计征个人所得税, 即公司按照 10% 的税率代扣代缴所得税, 税后每股实际派发现金红利为人民币 0.198 元。
(3) 对于持有本公司 A 股股票的合格境外机构投资者(QFII) 股东, 公司将根据《关于中国居民企业向 QFII 支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的

通知》(国税函[2009]47 号) 的规定, 按照 10% 的税率统一代扣代缴企业所得税, 实际税后每股派发现金红利为人民币 0.198 元。如相关股东认为其取得的股息红利收入需要享受任何税收协定(安排) 待遇的, 可按照规定在取得股息红利后自行向主管税务机关提出申请。
(4) 对于通过沪港通投资持有公司股份的香港市场投资者(包括企业和个人), 根据《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税[2014]81 号) 有关规定, 其股息红利将由本公司通过中国结算上海分公司按股票名义持有人(香港中央结算有限公司) 账户以人民币派发, 按 10% 的税率代扣所得税, 实际派发现金红利为每股人民币 0.198 元。
(5) 对于其他机构投资者和法人股东, 公司将不代扣代缴企业所得税, 其股息红利所得税由其按税法规定自行申报缴纳, 实际派发现金红利为每股人民币 0.22 元(含税)。

五、有关查询办法
关于本次权益分派实施问题如有疑问, 请按如下联系方式咨询:
联系地址: 证券部
联系电话: 0513-80575299
特此公告。
江苏神马电力股份有限公司
董事会
2020 年 6 月 2 日

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏, 并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

重要内容提示:
A 股每股现金红利 0.22 元
相关日期

股份类别	股权登记日	最后交易日	除权(息)日	现金红利发放日
A 股	2020/6/8	-	2020/6/9	2020/6/9

差异化分红送转: 否
一、通过分配方案的股东大会届次和日期
本次利润分配方案经公司 2020 年 5 月 19 日的 2019 年年度股东大会审议通过。

二、分配方案
1. 发放年度: 2019 年年度
2. 分配对象
截至股权登记日下午上海证券交易所有效收市, 在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司(以下简称“中国结算上海分公司”) 登记在册的本公司全体股东。
3. 分配方案:

(上接 C126 页)

法人代表: 申健
联系人: 尹黎明
客服电话: 021-20219997(PC)、021-20219990(手机)
公司网站: www.gw.com.cn

(56) 北京新浪金石基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室
办公地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室、海淀北二街 10 号泰鹏大厦 12 层
法人代表: 张琪
联系人: 付文红
客服电话: 010-62675369
公司网站: www.xincai.com

(57) 北京辉腾汇富基金销售有限公司
注册地址: 北京市东城区建国门内大街 18 号 15 层办公楼一座 1502 室
办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 室
法人代表: 李振
联系人: 魏尧
客服电话: 400-829-1218
公司网站: www.lhtfund.com

(58) 永安财富(北京) 资本管理有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层
法人代表: 杨健
联系人: 李海燕
客服电话: 400-673-7010
公司网站: www.jianfortune.com

(59) 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: 上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼
法人代表: 王廷富
联系人: 姜吉灵
客服电话: 400-799-1888
公司网站: www.520fund.com.cn

(60) 上海联泰基金销售有限公司
注册地址: 中国 上海 一自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址: 上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼 3 层
法人代表: 燕志
联系人: 凌秋池
客服电话: 400-118-1188
公司网站: www.66zchan.com

(61) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 上海崇明经济发展区
办公地址: 上海市杨浦区昆山路 518 号 A1002 室
法人代表: 王翔
联系人: 蓝杰
客服电话: 400-820-5369
公司网站: www.jiyufund.com.cn

(62) 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: 上海市黄浦区延安路 1 号凯石大厦 4 楼
法人代表: 陈健武
联系人: 李晓明
客服电话: 400-643-3389
公司网站: www.vstonewealth.com

(63) 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
法人代表: 鲍东华
联系人: 傅宇宇
客服电话: 400-821-9031
公司网站: www.lufund.com

(64) 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 B1201-1203
法人代表: 肖雯
联系人: 黄敏娥
客服电话: 020-89920966
公司网站: www.yingmi.cn

(65) 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: 北京市宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层
法人代表: 彭延年
联系人: 陈珍珍
客服电话: 400-890-9998
公司网站: www.jnlc.com

(66) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15
办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层
法人代表: 江卉
联系人: 徐佰宇
客服电话: 400-098-8511(个人)、400-088-8816(企业)
公司网站: www.kenterid.com

(67) 大连网金基金销售有限公司
注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室
法人代表: 贾伟东
联系人: 贾伟刚
客服电话: 400-089-9100
公司网站: www.yibajin.com

(68) 深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
办公地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
法人代表: 赖任军
联系人: 刘昕睿
客服电话: 400-930-2888
公司网站: www.jfzq.com

(69) 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
办公地址: 北京市朝阳区望京 SOHO T2 B 座 2507
法人代表: 钟斐斐
联系人: 戚晓强
客服电话: 400-159-9288
公司网站: danjuanapp.com

(70) 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
法人代表: 李一梅
联系人: 仲秋月
客服电话: 400-817-5666
公司网站: www.amcfund.com

(三) 其他
基金管理人可根据有关法律法规的要求, 增加或调整本基金销售机构, 并在基金管理人网站公示。

二、基金登记机构
名称: 富国基金管理有限公司
住所: 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层
法定代表人: 裴长江
成立日期: 1999 年 4 月 13 日
电话: (021) 20361818
传真: (021) 20361616

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: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人: 俞卫锋
电话: (021) 31358666
传真: (021) 31358600
联系人: 孙晋
经办律师: 黎明、孙晋

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
注册地址: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东楼东扩层 A 座 16 层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
法定代表人: 葛明
联系电话: 021-22288888
传真: 021-22280000
联系人: 徐艳
经办注册会计师: 徐艳、蒋燕华

第四部分 基金名称
富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金

第五部分 基金类型
债券型

第六部分 投资目标
本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上, 通过积极主动的投资管理, 力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。

第七部分 基金投资方向

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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、债券质押及买断式回购、协议存款、通知存款、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分等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固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不直接对二级市场买入股票、权证等权益类资产, 也不参与一级市场的新股申购或增发新股, 可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。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: 投资于债券的比例不低于基金资产的 80%, 在每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制, 但在开放前本基金持有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。

第八部分 基金投资策略
1. 封闭期投资策略
(1) 固定收益品种的资产配置策略
1) 平均久期配置
本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收入、价格指数和汇率等) 和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等) 进行分析, 预测未来的利率趋势, 判断债券市场对上述变量和政策反应, 并据此对债券组合的平均久期进行调整, 提高债券组合的总体投资收益。
2) 类属资产配置策略
在整体资产配置策略的指导下, 根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素, 采取积极投资策略, 定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整, 确定类属资产的最优权重。
3) 明细资产配置策略
在明细资产配置上, 首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合; 其次, 根据个别债券的收益率与剩余期限的配比, 对照基金的收益要求决定是否纳入组合; 最后, 根据个别债券的流动性指标决定投资总量。
(2) 固定收益品种的投资策略
本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪, 采用久期控制下的主动性投资策略, 主要包括: 久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段; 对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测, 相机而动, 积极调整。
1) 久期控制是根据对宏观经济形势、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期, 有效的控制整体资产风险。本基金在久期控制上遵循组合久期与封闭期的期限适当匹配的原则。
2) 期限结构配置是在确定组合久期后, 针对收益率曲线形状确定合理的组合期限结构, 包括采用集中策略、两端策略和梯型策略等。在长期、中期和短期债券间进行动态调整, 从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。
3) 信用风险控制是管理人充分利用现有行业与公司研究力量, 根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估, 以此作为品种选择的基本依据。信用产品投资是本基金的重要特点之一。
本基金认为, 信用债市场运行的中樞既取决于基准利率的变动, 也取决于发行人的整体信用状况。监管层的相关政策指导、信用债投资群体的投资理念及其行为等变化决定了信用债收益率的变动方向, 整个市场资金面的松紧程度以及信用债的供求情况等左右市场的短期波动。
基金管理人将自上而下通过宏观经济形势、基准利率走势、资金面状况、行业以及个股信用状况的研判, 积极主动地发现充分覆盖风险的, 甚至在覆盖之余还存在超额收益的投资品种, 同时通过行业及个股信用等级跟踪、久期控制等方式有效控制系统性信用风险, 同时风险以及流动性风险, 以求得投资组合高赢利性、安全性的中长期有效组合。
同一信用产品在相同市场状态下往往会有不同的表现, 针对不同的表现, 管理人将采取不同的操作方式: 如果信用债二级市场利率高于管理人判断的正常区间, 管理人将在该信用债上市时就可寻找适当的时机卖出实现利润; 如果二级市场利率处于管理人判断的正常区间, 管理人将持有待一段时间后再行卖出, 获取较长时间内的骑乘收益和持有期间的票息收益。本基金信用债投资在操作上主要以博取骑乘和票息收益为主, 这种以时间换空间的操作方式决定了本基金管理人在具体操作上必须在获取收益和防范信用风险之间取得平衡。
4) 跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性, 构建和调整债券组合, 进行跨市场套利, 实现跨市场套利。
5) 相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断, 选择合适的交易时机, 增持相对低估、价格将上升的债券, 减持相对高估、价格将下降的债券。
6) 本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面, 根据宏观经济运行情况的分析和预判, 灵活调整组合的久期。信用风险控制方面, 对单个券信用资质进行详尽的分析, 对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量, 尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面, 要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模, 在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。
(3) 回购套利策略
回购套利策略是本基金重要的操作策略之一, 把信用产品投资和回购交易结合起来, 管理人根据信用产品的特征, 在信用风险和流动性风险可控的前提下, 或者通过回购融资来博取超额收益, 或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。
2. 开放期投资策略
开放期间, 本基金为保持较高的组合流动性, 方便投资人安排投资, 在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下, 将主要投资于高流动性的投资品种, 防范流动性风险, 满足开放期流动性的需求。
第九部分 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+ 25%。
本基金是定期开放债券型基金产品, 封闭期为一年, 以一年期银行定期存款税后利率+1.25% 作为本基金的业绩比较基准, 能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征, 合理地衡量比较本基金的业绩表现。
如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时, 本基金可以在基金托管人同意, 报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告, 而无需召开基金份额持有人大会。
第十部分 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金, 属于证券投资基金中的较低风险品种, 其预期风险与预期收益高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金。

第十一部分 投资组合报告
一、报告期末基金投资组合情况

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	固定收益投资	2,180,637,993.20	96.29
	其中: 债券	2,180,637,993.20	96.29
	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	31,211,092.17	1.38
7	其他资产	52,737,602.14	2.33
8	合计	2,264,586,687.51	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合
注: 本基金本报告期末未持有境内股票资产。
三、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
注: 本基金本报告期末未持有股票资产。
四、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	173,398,236.00	12.60
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,390,124,257.20	101.05
5	企业短期融资券	120,428,000.00	8.75
6	中期票据	487,010,500.00	35.40
7	可转换(可交换)债	-	-
8	同业存单	9,677,000.00	0.70
9	其他	-	-
10	合计	2,180,637,993.20	158.51

五、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	143416	17 中信 G3	800,000.00	80,680,000.00	5.86
2	136031	15 常发投	700,000.00	70,371,000.00	5.12
3	136523	16 广新 03	600,000.00	59,598,000.00	4.33
4	143109	18 国信债	500,000.00	50,610,000.00	3.68
5	136855	16 光控 03	500,000.00	50,188,000.00	3.65

六、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
注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。
七、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
注: 本基金本报告期末未持有贵金属投资。
八、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
注: 本基金本报告期末未持有权证。
九、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(一) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资公允价值变动(元)	-

注: 本基金本报告期末未投资股指期货。
(二) 申明本基金投资的股指期货合约
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资股指期货。
十、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(一) 本期国债期货投资情况
本基金根据基金合同的约定, 不允许投资国债期货。
(二) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资公允价值变动(元)	-

注: 本基金本报告期末未投资国债期货。
(三) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
十一、投资组合报告附注
(一) 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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
本基金本报告编制日前一年内, 未受到公开的“13 魏桥 02”的发行主体魏桥纺织股份有限公司(以下简称“公司”) 由于违反《香港联合交易所有限公司证券上市规则》, 未就若干关联交易遵守披露及股东批准规定, 以及延迟财务报告等违规事实, 香港联合交易所有限公司于 2019 年 5 月 17 日对公司进行谴责。
基金管理人将密切跟踪相关进展, 遵循价值投资理念进行投资决策。
本基金持有的其余 9 名证券的发行主体本期未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。
(二) 申明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本基金本报告期末未持有股票资产。
(三) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,260.95
2	应收证券清算款	3,364,104.33
3	应收利息	-
4	应收股息	49,351,236.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,737,602.14

(四) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(五) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注: 本基金本报告期末未持有股票。
(六) 投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因, 投资组合报告市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。
第十二部分 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, 投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、本基金历史各时间段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
2014-07-25-2014-12-31	3.10%	0.13%	1.84%	0.01%	1.26%	0.12%
2015-01-01-2015-12-31	8.52%	0.10%	3.37%	0.01%	5.15%	0.09%
2016-01-01-2016-12-31	2.23%	0.10%	2.76%	0.01%	-0.53%	0.09%
2017-01-01-2017-12-31	2.62%	0.06%	2.75%	0.01%	-0.13%	0.05%
2018-01-01-2018-12-31	7.22%	0.10%	2.75%	0.01%	4.47%	0.09%
2019-01-01-2019-06-30	2.81%	0.06%	1.36%	0.01%	1.45%	0.05%
2014-07-25-2019-06-30	29.39%	0.09%	14.82%	0.01%	14.57%	0.08%

二、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注: 1. 截止日期为 2019 年 6 月 30 日。
2. 本基金于 2014 年 7 月 25 日成立, 建仓期 6 个月, 从 2014 年 7 月 25 日起至 2015 年 1 月 24 日, 建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。
第十三部分 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;
4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所和诉讼费;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金的交易费用;
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
本基金收取浮动年管理费, 即本基金管理费的适用费率(m) 是根据业绩考核周

期内的基金份额净值增长率(R) 的大小来决定的。
注: 本基金本报告期未持有资产支持证券。
七、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
注: 本基金本报告期末未持有贵金属投资。
八、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
注: 本基金本报告期末未持有权证。
九、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(一) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

序号	条件	管理费费率(m)
1	R ≤ (+1.25%)	0%
2	(+1.25%) < R ≤ (+2.25%)	Min(0.4%, @)
3	(+2.25%) < R ≤ (+4.25%)	Min(0.7%, 0.4%+@)
4	R > (+4.25%)	Min(1.0%, 0.7%+@)

其中,
(1) R 的计算方法如下:
@ NAV1 为第 N 个开放期第一日的未扣除管理费的基金份额净值;
NAV0 为第 N-1 个开放期最后一日的基金份额净值