

(上接C22版)

(4)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%;

(5)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%;
(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)本基金应投资于信用级别评级为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;

(13)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;

(14)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;

(15)本基金参与股指期货和国债期货交易,应当遵守下列要求:

1)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%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金在任何交易日内交易(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%;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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

2)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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30%;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

3)封闭期内,本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货和国债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100%;开放期内,本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货和国债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;

(16)因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;开仓卖出认购股票期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽股票期权的,应持有合约行权所需的足额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物;未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权乘数乘以合约乘数计算;基金投资股票期权应符合基金合同约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等)、投资目标和风险收益特征;

(17)本基金参与融资的,每个交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;

(18)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%,且其剩余期限不得超过本基金的剩余封闭运作期;

(19)本基金投资流通受限证券,基金管理人应根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,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;本款所指流通受限证券包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券;

(20)封闭期内,本基金的基金总资产不得超过基金净资产的200%;开放期内,本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的140%;

(21)开放期内,本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的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之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(22)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资 的开放式基金以及中国证监会认可的特殊投资组合除外)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;同一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,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(23)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方开展逆回购交易的,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;

(24)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(12)、(21)、(23)项外,因证券/期货市场波动、证券发行合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

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约定。上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人可在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

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)违反规定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,但是中国证监会另有规定的除外;
- (5)向其他基金管理人、基金托管人出资;
- (6)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;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应经基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人可在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

第九部分 基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率*20%+中债综合指数收益率*80%

选择该业绩比较基准,是基于以下因素:

- 1、沪深300指数和中债综合指数合理、透明;
- 2、沪深300指数和中债综合指数具有较高的知名度和市场影响力;
- 3、沪深300指数和中债综合指数有一定市场覆盖率,且不易被操纵;

4、沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数;

5、中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,为中国全市场债券指数,其以2001年12月31日为基期,基点为100点,并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,能较好地反映债券市场的整体收益;

6、基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的 risk 收益特征。

如果今后有法律法规发生变化,或者指数编制机构调整或停止上述指数的发布,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,或者市场中出现更具有代表性的业绩比较基准,或者更科学的业绩比较基准,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后,变更本基金的业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,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

本基金为混合型基金,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金,属于中等收益风险特征的基金。

第十一部分 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年03月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自2019年01月01日起至12月31日止。

§1 投资组合报告

1.1 期末基金资产组合情况			
金额单位:人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,629,173.95	11.11
	其中:股票	9,629,173.95	11.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	73,392,317.65	84.69
	其中:债券	73,392,317.65	84.69
	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	1,059,793.67	1.22
8	其他各项资产	2,582,538.66	2.98
9	合计	86,663,823.93	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合			
金额单位:人民币元			
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	-	-
C	制造业	4,966,834.95	8.09
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	615,048.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,797,840.00	2.93
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	921,200.00	1.50
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	1,328,251.00	2.16
S	综合	-	-
	合计	9,629,173.95	15.69

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合	
注:本基金本报告期末未有港股通投资股票。	
1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资	
明细	
金额单位:人民币元	

1	601166	兴业银行	90,800	1,797,840.00	2.93
2	600519	贵州茅台	1,100	1,301,300.00	2.12
3	603259	药明康德	10,000	921,200.00	1.50
4	000858	五粮液	5,500	731,555.00	1.19
5	300144	宋城演艺	22,500	695,475.00	1.13
6	300413	芒果超媒	18,100	632,776.00	1.03
7	600887	伊利股份	20,200	624,988.00	1.02
8	603939	益丰药房	8,400	615,048.00	1.00
9	000661	长春高新	1,000	447,000.00	0.73
10	000651	格力电器	5,700	373,806.00	0.61
11	000333	美的集团	5,700	332,025.00	0.54
12	300088	长信科技	30,000	308,100.00	0.50
13	000568	泸州老窖	3,400	294,712.00	0.48
14	300529	健帆生物	4,100	294,544.00	0.48
15	600872	中炬高新	6,577	258,804.95	0.42

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动				
1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明 细				
金额单位:人民币元				
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)

1	600872	中炬高新	2,454,031.00	3.07
2	600036	招商银行	1,637,518.00	2.05
3	601166	兴业银行	1,619,793.00	2.03
4	000651	格力电器	1,111,093.56	1.39
5	300144	宋城演艺	1,007,661.00	1.26
6	600519	贵州茅台	862,750.00	1.08
7	603259	药明康德	844,682.60	1.06
8	300498	温氏股份	811,728.00	1.02
9	603345	安井食品	809,597.00	1.01
10	600887	伊利股份	808,005.00	1.01
11	300088	长信科技	785,664.00	0.98
12	601009	南京银行	645,456.00	0.81
13	300413	芒果超媒	606,695.00	0.76
14	603939	益丰药房	602,821.00	0.75
15	600258	首旅酒店	504,162.00	0.63
16	000661	长春高新	444,599.00	0.56
17	000961	中南建设	410,508.00	0.51
18	000858	五粮液	409,800.00	0.51
19	002311	海大集团	406,595.00	0.51
20	002557	洽洽食品	364,263.00	0.46

注:本项“买入金额”按买入成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明			
细			
金额单位:人民币元			

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600872	中炬高新	2,774,822.32	3.48
2	600036	招商银行	1,756,121.00	2.20
3	603345	安井食品	1,112,786.00	1.39
4	000651	格力电器	974,010.00	1.22
5	601009	南京银行	795,311.00	1.00
6	300498	温氏股份	740,932.00	0.93
7	600258	首旅酒店	490,796.00	0.61
8	300088	长信科技	465,192.00	0.58
9	002311	海大集团	464,197.00	0.58
10	002557	洽洽食品	440,022.00	0.55
11	300144	宋城演艺	421,950.00	0.53
12	000961	中南建设	372,233.00	0.47
13	002127	南极电商	317,481.00	0.40
14	600297	广汇汽车	260,982.00	0.33
15	600887	伊利股份	239,771.00	0.30
16	603096	新经典	235,706.00	0.30
17	600867	通化东宝	232,530.00	0.29

注:本项“卖出金额”按卖出成交金额填列,不考虑相关交易费用。	
1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	
单位:人民币元	
买入股票成本(成交)总额	19,066,070.16
卖出股票收入(成交)总额	12,094,842.32

买入股票成本(成交)总额	19,066,070.16
卖出股票收入(成交)总额	12,094,842.32

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	434,640.00	0.71
	其中:政策性金融债	434,640.00	0.71
4	企业债券	65,583,000.00	106.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换(可交换)债	7,374,677.65	12.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	73,392,317.65	119.55

1.6 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			
金额单位:人民币元			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)

1	143751	18 华综 01	50,000	5,101,000.00	8.31
2	155389	19 南网 01	50,000	5,069,000.00	8.26
3	155595	19 美置 04	50,000	5,067,000.00	8.25
4	155222	19 兵装 03	50,000	5,067,000.00	8.25
5	155201	19 盛情 01	50,000	5,062,500.00	8.25

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

1.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未有贵金属投资。

1.9 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。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.12.2 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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,344.71
2	应收证券清算款	1,191,269.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,379,924.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,582,538.66

1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113020	桐昆转债	1,338,225.00	2.18
2	110052	贵广转债	819,770.00	1.34
3	123016	洲明转债	653,900.00	1.07
4	113520	百合转债	640,714.20	1.04
5	123021	万信转 2	600,150.00	0.98
6	128065	雅化转债	274,425.00	0.45
7	128061	启明转债	239,664.75	0.39
8	113522	旭升转债	57,224.00	0.09