```
(上接 C110 版)
   注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
   法定代表人:霍达
   联系人:黄婵君
   联系电话:0755-82960167
   客服电话:95565;400-8888-111
   传真:0755-82943636
   网址: www.newone.com.ci
   (36)中信证券股份有限公司
  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)北座办公地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
   法定代表人:张佑君
   联系人:郑慧
  联系电话:010-60838888
客服电话:95548
   网址: www.cs.ecitic.com
   (37)中国银河证券股份有限公司
   注册地址:北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层
   办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
   法定代表人:陈共炎
   联系人:辛国政
   客服电话:400-8888-888/95551
   传真:010-83574807
   网址: www.chinastock.com.ci
  (38)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼
办公地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼
   法定代表人:李梅
   联系人:李玉婷
   联系电话:021-33388229
   客服电话: 95523 或 4008895523
传真: 021-33388224
  网址:www.swhysc.com
(39)长江证券股份有限公司
   注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
   法定代表人:尤习贵
   联系人:奚博宇
   联系电话:021-68751860
客服电话:95579 或 4008-888-999
   传真:027-85481900
   网址:www.95579.com
  (40)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
   办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
   法定代表人:黄炎勋
   客服电话:400-800-1001
网址:www.essence.com.cn
  (41)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 号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
   联系人:张煜
   电话:023-63786633
   客服电话:95355、400-8096-096
   传真:023-63786212
   网址:www.swsc.com.cr
  网班: www.wsc.com.cn
(42)渤海证券股份有限公司
注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址: 天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人: 王春峰
   电话:022-28451922
   客服电话:4006515988
   网址:www.ewww.com.cn
  (43)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址.青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)
  办公地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层
法定代表人:姜晓林
   联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
   客服电话:95548
传真:0532-85022605
   网址:sd.citics.com
   (44)信达证券股份有限公司
  注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
   法定代表人:张志刚
   联系人:尹旭航
   联系电话:010-63081493
   客服电话:95321
   网址: www.cindasc.com
   (45)长城证券股份有限公司
   注册地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
   办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人: 丁益
  联系人:金夏
联系电话:0755 -83516289
   客服电话:400-6666-888
   传真:0755-83515567
   网址:www.cgws.com
   (46)光大证券股份有限公司
   注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号
   办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号
  法定代表人:薛峰
联系人:何耀、李芳芳
   联系电话: 021-22169999
客服电话: 95525
   传真:021-22169134
   网址:www.ebscn.com
  (47)南京证券股份有限公司
注册地址:南京市玄武区大钟亭8号
   办公地址:南京市江东中路 389 号
   法定代表人:步国旬
    ご服由话・95386
   网址:www.njzq.cn
  (48)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼
   办公地址:上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼
法定代表人:李俊杰
   客服电话: 4008-918-918
网址: www.962518.com
   (49)大同证券股份有限公司
   注册地址:大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层
   办公地址:山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A座 12、13 层
   联系人. 薛津
   传真:0351-7219891
   (50)平安证券股份有限公司
   注册地址:深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25
   办公地址:深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25
层
   法定代表人:何之江
   客服电话:95511-8
   传真:0755-82400862
   网址:www.stock.pingan.com
  (51)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:钱俊文
  电话:021-20333333
传真:021-50498825
   客服电话:95531;400-8888-588
   网址:www.longone.com.cn
(52)恒泰证券股份有限公司
   注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合
   办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合
   法定代表人:庞介民
   联系人:熊丽
   电话:0471-3953168
   传真:0471-3979545
   客服电话:956088
   (53)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20
楼 2005 室
   办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20
楼 2005 室
   法定代表人:韩志谦
   联系人:王怀春
   联系电话: 0991-2307105
传真:010-88085195
   客服电话:4008000562
   网址:www.hysec.com
  (54)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 20518 号
  办公地址:山东省济南市经七路 86 号证券大厦
法定代表人:李玮
   联系人:许曼华
   联系电话:021-20315117
   客服电话:95538
传真:0531-68889752
   网址:www.zts.com.cn
(55)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
   法定代表人: 俞洋
   办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
   联系人:杨莉娟
   业务联系电话:021-54967552
   传真电话:021-54967293
   客服电话: 4001099918
```

(56)粤开证券股份有限公司

注册地址:惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四

```
办公地址:深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层
   法定代表人:严亦斌
   联系人:彭莲
联系电话:0755-83331195
   客户服务电话:95564
公司网址:http://www.ykzq.com
   (57)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
   联系人:刘婧漪、贾鹏
    包话:028-86690057、028-86690058
   客服申话⋅95310
    司网址:www.gjzq.com.cn
   (58)天风证券股份有限公司
   注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
   办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼
   联系人: 岑妹妹
   电话:027-87617017
   客服电话:95391/400-800-5000
   网址: http://www.tfzq.com
(59)第一创业证券股份有限公司
   注册地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼
办公地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼
   法定代表人:刘学民
   联系人:毛诗莉
   电话:0755-23838750
   传真:0755-25838701
   客服电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn
   (60)中国银行股份有限公司
住所:北京市复兴门内大街1号
   办公地址:北京市复兴门内大街 1 号
法定代表人:刘连舸
   联系人:吴颖媛
联系电话:010-66596317
   客服电话:95566
   网址:www.boc.cn
   (61)平安银行股份有限公司
   注册地址:广东省深圳市福田区益田路 5023 号办公地址:广东省深圳市福田区益田路 5023 号
   法定代表人:谢永林
   联系人:赵杨
联系电话:0755-22166574
   客服电话:95511-3
   传真:021-50979507
  网址:http://bank.pingan.com
(62)平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路 5023 号
办公地址:广东省深圳市福田区益田路 5023 号
   法定代表人:谢永林
   联系人:赵杨
联系电话:0755-22166574
   客服电话:95511-3
传真:021-50979507
   网址: http://bank.pingan.com
(63)中信证券华南股份有限公司
   注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
   法定代表人:胡伏云
   联系人:陈靖
   联系电话:020-88836999
   客户服务电话:95396
   传真:020-88836984
   网址:www.gzs.com.cn
(64)江苏汇林保大基金销售有限公司
   注册地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道 47号
   办公地址:江苏省南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005
   电话:025-66046166转837
   传真:025-56663409
   联系人:孙平
   客户服务热线:025-66046166
   网址: www.huilinbd.com
   (65)浦领基金销售有限公司
   注册地址:北京市朝阳区望京东园四区 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
   电话:010-59497361
   传真:010-64788016
   联系人:李艳
   客户服务热线:4000125899
   网址:www.zscffund.com
二、基金登记机构
   平安基金管理有限公司
   注册地址:深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
   办公地址:深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 法定代表人:罗春风
   电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
   三、律师事务所和经办律师
  一、注列于分別中型公別年期
律师事务所:上海市通力律师事务所
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:021-3135 8666
   传真:021-3135 8600
   经办律师:黎明、陈颖华
   联系人:陈颖华
   四、会计师事务所和经办注册会计师
   会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普诵合伙)
   住所:上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
   法定代表人:李丹
   联系电话:(021)2323 8888
   传真电话:(021)2323 8800
   经办注册会计师:郭素宏、邓昭君
   联系人:邓昭君
第四部分 基金的名称
平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金
第五部分 基金的类型 混合型证券投资基金
第六部分 基金的运作方式
   契约型开放式
第七部分 基金的投资
     、投资目标
   本基金在严格控制风险的前提下,通过股票与债券等资产的合理配置、充分利
```

办公地址:上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

用研究投资优势,力争实现基金资产的长期稳健增值二、投资范围

当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

1、大类资产配置策略

(1)行业配置策略

(2)个股精洗策略

上市公司的基本情况进行分析

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他

本基並的投資范围包括国內依法及打工市的股票(包括中小板、即业收及其他中国证监会允许基金投资的股票)、內地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券资产(包括国债、央行票据、金

融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债、中小企业私募

债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存

款、同业存单、货币市场工具、现金等,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的相关规定。

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

本基金股票资产占基金资产的比例为0-95%,投资于港股通标的股票的比例占 本基金股票资产占基金资产的比例为 0-95%, 投资于港股迪标的股票的比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适

本基金通过定量、定性相结合的方法分析宏观经济、财政及货币政策、市场情绪、行业周期、资金供需情况等因素综合分析以及对资本市场发展趋势的判断,在评价未来一段时间各类的预期风险收益率、相关性的基础上,据此合理制定和调整

股票。债券等各类资产的比例。此外、本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。

略为核心,深入考察企业基本面并作出合理预期,同时将该预期与其市场交易价格中隐含的预期相比较,从概率角度与投资资本回报角度分析企业潜在的超市场预

(1)行业配直束略本基金将在符合经济发展规律的、有友好政策环境的、符合经济结构发展趋势及背景的行业中,从概率理论角度出发、力求基金资产在行业配置层面上做到分散化投资,以保持风险均衡,避免在某些行业上过度的风险暴露。同时从行业板块发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、行业发展空间、技术发展前景及其发展趋

势等多角度,在全面研究基础上对各个行业进行合理取舍,对行业配置不断进行调

本基金在进行个股筛选时,主要通过定量与定性相结合的角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具备成长潜力和估值优势的优质上市公司。 首先,使用定性分析的方法,从技术能力、市场前景以及公司治理结构等方面对

且在技术上具有一定护城河的公司。 2)在市场前景方面,需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度

以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势等,并结合产业链及价值链的角度,挖掘有长期发展潜力的公司。

系等方面进行评价,公司治理能力的优劣对公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。

其次、使用定量分析的方法、通过财务和运营数据对企业价值进行评估。本基金主要从行业景气度、盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。 (3)港股通投资标的股票投资策略

过对行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面选择有估值优势与投资价值的标的股票。

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,通

债券投资策略方面,本基金在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采

1)在技术能力方面,选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并

3)在公司治理结构方面,将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体

期的可能性,判断企业在估值方面的优势,以此作为投资价值的主要衡量标准。

本基金将采取"自上而下"和"自下而上"相结合的精选策略,以"估值优势"策

用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境 为析方面,结合对宏观经济,市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配 置和调整,确定不同类属资产的最优权重。 在微观市场定价分析方面,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具 体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资 本基金对权证的投资基于对标的证券和组合收益进行分析,并从权证标的证券 基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行深入研究,以推进资产增值为原则,加强风险管理控制。 5、衍生品投资策略 1)股指期货投资策略 本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。投资原则为有于基金资产增值, 控制下跌风险实现保值和锁定收益。 本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判 斯和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结后股票 投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投 基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期 货对中系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额中购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 基金管理人在进行股指期货投资前将建立衍生品投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。
2)国债期货投资策略 2)国债期货投资策略 本基金参与国债期货的投资应符合基金合同规定的投资策略和投资目标。本基金以套期保值为目的,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资于国债期货合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极改善组合的风险收益特征。本基金通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考虑国债期货的收益性,流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组合的久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略,期货合约选择和头寸选择策略,展期策略、保证金管理策略、流动性经平理策略、第 性管理策略等。 本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上,将审慎地获取相应的超额收 益,通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加,以及国债期货与债券 的多空比例调整,获取组合的稳定收益。 基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确保 研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关岗位 责。此外,基金管理人建立国债期货交易决策部门或小组,并授权特定的管理人员 **负责国债期货的投资审批事项。** 今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金 将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。 6.中小企业私募债券投资策略 本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企 业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投 基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决 策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。 风险等各种风险。 7、资产支持证券投资策略 本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动。研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券收益率的影响。在严格控制信用风险暴露程度的前提关注流动性变化对标的证券收益率的影响。在严格控制信用风险暴露程度的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

8、证券公司短期公司债券投资策略 本基金可根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行

1.3至日限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1)股票资产占基金资产的比例范围为 0-95%,投资于港股通标的股票的比例

(2)每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,

(2)每个交易日日终在扣除国價期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;(3)本基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算),其市值不超过基金资产净值的 10%;(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算),不超过该证券的 10%;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)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%;本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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(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人权证的总金额,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

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%;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交易,应当符合下列投资限制:
1)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

2) 本基金在任何交易日日终。持有的平入股指期货。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(2

3)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

(20) 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 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

(21)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

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

(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%;

筛选,并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外,由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差,本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公

司债券进行流动性分析和监测,尽量选择流动性相对较好的品种进行投资,保证本

四、投资限制

1、组合限制

占股票资产的 0-50%:

本基金是混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型 基金、低于原型基金、本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 七、基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利的原则及方法 基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使所投资证券项下得权利, 中基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使所投资证券项下权利时

1、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资公司的经营管理;

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持

3、有利于基金财产的安全与增值; 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟

取任何不正当利益。 八、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

签查自任人的量并云及量并依证年的自闭载员行行行证验的Linx、医疗任际企 直大遗漏,并对其内容的真实性、推确性和完整性牵担个别及连带责任 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截至 2020 年 3 月 31 日,本财务数据未经审计。 1.1 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	4,912,307.70	28.24
	其中:股票	4,912,307.70	28.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,990,800.00	22.95
	其中:债券	3,990,800.00	22.95
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	=	=
7	银行存款和结算备付金合计	8,442,610.65	48.54
8	其他资产	46,615.15	0.27
9	合计	17,392,333.50	100.00

代码 5基金资产净值比 行业类别 公允价值(元) A 农、林、牧、渔业 B 采矿业 C 制造业 615,321.8 3.61 电力、热力、燃气及水生产和供应 D E建筑业 批发和零售业 19,147.3 G 交通运输、仓储和邮政业 H 住宿和餐饮业 言息传输、软件和信息技术服务』 134,011. 0.79 金融业 4,126,274.0 24.23 K 房地产业 租赁和商务服务业 科学研究和技术服务业 17,552.9 Ν 水利、环境和公共设施管理业 居民服务、修理和其他服务业 О P 教育 Q 卫生和社会工作 文化、体育和娱乐业 R S 4,912,307.

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持有港股通股票。

1.3 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

	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	601658	邮储银行	796,578	4,126,274.04	24.23
	2	688101	三达膜	13,483	242,154.68	1.42
	3	688108	赛诺医疗	9,304	142,537.28	0.84
	4	688089	嘉必优	4,769	141,400.85	0.83
	5	688118	普元信息	4,028	134,011.56	0.79
	6	688021	奥福环保	2,940	89,229.00	0.52
	7	603353	和顺石油	689	19,147.31	0.11
	8	300825	阿尔特	1,642	17,552.98	0.10
_	1.4 报	告期末按债	券品种分类的	的债券投资组·	合	

3) 本基金任任何交易日日终, 持有的实出股捐期赁合约价值不停超过基金持有	1.	4 报告期末按债券品种分类的债券		
的股票总市值的 20%; 4)本基金所持有的股票市值和买人、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;	序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
5)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	1	国家债券	2,986,800.00	17.54
超过上一交易日基金资产净值的 20%; (16)本基金参与国债期货交易,应当符合下列投资限制;	2	央行票据	-	-
1)本基金在任何交易日日终,持有的买人国债期货合约价值,不得超过基金资	3	金融债券	1,004,000.00	5.89
产净值的 15%; 2)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		其中:政策性金融债	1,004,000.00	5.89
的债券总市值的30%;	4	企业债券	-	1
3)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%;	5	企业短期融资券	-	1
4)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买人、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	6	中期票据	=	-
约定;	7	可转债(可交换债)	-	-
(17) 本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过该基金资产净值的 10%:	8	同业存单	=	-
(18)基金总资产不得超过基金净资产的140%;	9	其他	-	-
(19)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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	10	合计	3,990,800.00	23.43
致使本基金不符合上述比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的 投资;	1. 细	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。	5.名债券投资明

細					
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	019547	16 国债 19	30,000	2,986,800.00	17.54
2	018061	进出 1911	10,000	1,004,000.00	5.89
1.6	报告期末按公司	· 价值占其全	资产净值比	例大小排序的前十多	2.资产支持证

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 1.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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权证投资明

本基金本报告期末未持有权证。 1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细本基金本报告期末无股指期货投资。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期无股指期货投资

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有国债期货投资。

1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资 1.11 投资组合报告附注

1.11.1 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 银保监会于2019年7月3日做出[2019]11号处罚决定,由于中国邮政储蓄银行(以下简称"公司"):(一)未按监管要求对代理营业机构进行考核;(二)劳务派遣 工违规担任综合柜员;(三)员工信息管理不到位;(四)未按规定开展审计工作。根据相关规定对公司罚款 140 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力暂不会造成重大不利

银保监会于 2020年3月7日做出银保监罚决字[2020]2号处罚决定,由于中国 邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称"公司"):一、违反审慎经营规则(一)可回溯制度执行不到位;(二)制度落实文件制定滞后;(三)可回溯视频未传递给保险公司 制度从1个到位;(二)制度洛头义针制定商归;(三)州回阙代颁末传速岩床险公司或缺失;(四)质检不合格业务占比较高。二,聚编投保人,即银行销售人员介绍保险产品时对产品分红描述不准确。根据相关规定对公司罚款 80 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。实们对该证券的投资严格执行内部投资决策

影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度

层顶能刀暂不会追放患犬不利豪啊。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。 本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。 1.11.2 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基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股

(下转 C112 版)

	法律法规以监官部门取用以调整上处限制,如迫用丁净基金,基金官
i	当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。
	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
	(1)承销证券;

(21)法律注规及中国证监会规定的利基金台向约定的其他投资限制。除上述第(2)、(12)、(19)、(20)项外,因证券,期货市场波动、上市公司合并、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有关约定。期间,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调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行法、程度后,则证其企构签之工两位并发明制或以调整与创加变为独

行适:

活动:

(2)违反规定向他人贷款或提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资; (4)买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5)向基金管理人、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、符合中国证监会的规定、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。重大关联交易应提交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

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

工、业项LV基础 本基金业绩比较基准: 沪深 300 指数收益率×60%+ 恒生综合指数收益率× 15%+中证全债指数收益率×25% 采用该比较基准主要基于如下考虑: 1,作为专业指数提供商提供的指数,中证指数有限公司提供的中证系列指数体

系具有一定的优势和市场影响力。 2、在中证系列指数中,沪深 300 指数的市场代表性比较强,适合作为本基金股票投资的比较基准;而中证全债指数能够较好的反映债券市场的综合变动情况,适 合作为本基金债券投资的比较基准。 3、恒生指数由恒生指数服务有限公司编制,其成分股包括市值最大及成交最活

跃并在香港联合交易所主板上市的公司。恒生指数一直被广泛引用为反映香港股 票市场表现的重要指标。

若未来法律法规发生变化,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基准的指数或本业绩比 较基准停止发布,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托

管人协商一致并履行适当程序后,适当调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开

六、风险收益特征