

(上接 C101 版)

网址: kenterui.jd.com  
(46)中金金牛(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:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人:钱昊旻  
客服电话:4008-909-998  
网址:www.jnlc.com  
(47)奕丰基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)  
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室  
法定代表人:TEO WEE HOWE  
客服电话:400-684-0500  
网址:www.ifastps.com.cn  
(48)北京百度百盈基金销售有限公司  
注册地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101  
办公地址:北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼  
法定代表人:葛新  
客户服务热线:95055  
公司网站:www.baiyingfund.com  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并在基金管理人网站公示。

二、基金登记机构:  
上投摩根基金管理有限公司(同上)  
三、律师事务所与经办律师:  
名称:上海源泰律师事务所  
注册地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼  
负责人:廖海  
联系电话:021-5115 0298  
传真:021-5115 0398  
经办律师:廖海、刘佳  
四、审计基金财产的会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹  
联系电话:(021) 23238888  
传真:(021) 23238800  
联系人:沈兆杰  
经办注册会计师:薛竟、沈兆杰  
四、基金概况  
基金名称:上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金  
基金类型:契约型开放式  
五、基金份额的申购、赎回和转换  
1. 基金申购费  
申购费用=(申购金额×申购费率)/(1+申购费率)  
净申购金额=申购金额-申购费用  
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值  
申购费率如下表所示:

申购金额区间	费率
人民币100方以下	1.5%
300方以上(含),1,500方以下	0.50%
人民币500方以上(含)	1.0%
人民币500方以上(含)	每笔人民币1,000元

2. 基金赎回费  
本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,  
赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值  
赎回费用=赎回总额×赎回费率  
赎回金额=赎回总额-赎回费用  
赎回费率如下表所示:

持有期限	费率
7日以内	1.50%
7日以上(含),30日以内	0.75%
30日以上(含),一年以内	0.50%
一年以上(含),两年以内	0.25%
两年以上(含),三年以内	0.20%
三年以上(含)	0%

3. 基金转换费  
基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构

六、基金的投资  
一、投资目标  
在严格的风险控制的前提下,采用定性与定量的分析,自下而上精选个股,力争实现基金资产的长期增值。

二、投资范围  
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股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。  
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序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的保证金后,保持现金或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、存出保证金及应收申购款等。

三、投资策略  
1. 资产配置策略  
本基金将综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析,重点关注包括GDP增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势,结合股票、债券等各类资产风险收益特征,确定合适的资产配置比例。本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化,适度调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例,动态优化投资组合。

2. 股票投资策略  
本基金将主要通过运用主题轮动策略与行业轮动策略,结合“自下而上”精选个股,充分挖掘并把握市场中潜在的投资机会,力争把握经济发展与转型中的投资机会。

(1)主题轮动策略  
由于投资主题具有动态、前瞻、跨行业或跨地区等特征,本基金将通过挖掘宏观经济中政策性、结构性等发展趋势进行前瞻性的研究与分析,挖掘并灵活投资于集中代表整个市场阶段发展趋势的上市公司。首先,本基金将从经济体制改革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发,分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素,从而发掘经济发展过程中的投资主题。其次,通过对投资主题的全面分析和评估,明确所对应的主题行业与主题板块。最后,考虑到经济发展呈现多元化趋势发展特征,而投资主题可能会随着社会和经济的发展而有所变化。本基金将通过紧跟跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化,不断地挖掘和研究新的投资主题,并对投资方向做出适时调整,力争准确把握新旧投资热点的转换时机。

(2)行业轮动策略  
本基金对行业配置权重的确定或调整将从以下几个方面考虑:  
1)行业基本面比较。行业比较包括两个层面,行业生命周期和行业景气。行业生命周期由行业自身发展规律决定,主要受产业链、行业竞争结构等因素的影响;行业景气受宏观经济环境影响而表现不同,主要分析指标包括收入、利润、价格、产量、产能利用率、销量及增速等。  
2)行业市场估值比较。估值体现市场预期,行业间估值排序、行业自身估值水平都影响行业在市场的表现。因此,对行业估值进行分析并把握相应投资机会是行之有效的手段,具体指标包括行业间估值比较、行业估值水平、行业的盈利调整等。  
(3)个股精选策略  
本基金将通过系统和深入的基本面研究,采用“自下而上”的方法,运用定量与定性相结合的方法优选个股。

1)定量分析  
从以下几个方面对个股进行定量分析:  
盈利能力指标:盈利能力是指企业获取利润的能力,利润是经营者经营业绩和管理效能的集中体现。企业的盈利能力指标是基金管理人投资运作过程中重点关注的因素。本基金选取净资产收益率(ROE)、

总资产报酬率(ROA)、主营业务收入同比增长率、主营业务利润同比增长率等盈利分析指标作为衡量标准。

估值指标:企业的估值水平在一定程度上反应了其未来成长性以及当前投资的安全性。估值合理将是本基金选股的一个重要条件。本基金将根据各行业的不同特点,采用市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈率相对盈利增长比例(PEG)等估值指标,并参考国际估值分析方法,结合国内市场特征对入选的上市公司股票进行综合评估入选,选取估值合理的个股。

2)定性分析  
从以下几个方面对个股进行定性分析:  
行业发展前景及地位:公司所在行业发展趋势良好,具有良好的行业成长性;公司在行业中处于领先地位,或者在生产、技术、市场等一个或多个方面具有行业内领先地位,并在短时间内难以被行业内的其他竞争对手超越,在未来的发展中,其在行业或者细分行业中的地位预期会有较大的上升。  
治理结构:公司治理结构良好,管理规范,已建立起市场化经营机制、决策效率高,对市场变化反应灵敏并内控有力。主要考核指标:财务信息质量、所有权结构、独立董事制度、信息披露制度等等。  
营运状况:公司营运状况良好,股东和管理层结构稳定;各项财务指标状况良好;公司具有清晰的发展战略等。  
核心竞争力:公司主营业务可持续发展能力强,在行业中处于领先地位,具备核心竞争力,比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特的市场形象、较高的品牌认知度等。

风险因素考察:公司在技术、营销、内部控制等方面不存在较大风险,同时公司具备与规模扩张匹配的较强的管理能力。  
3. 固定收益类投资策略  
对于固定收益类资产的选择,本基金将以价值分析为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,自上而下进行组合构建,自下而上进行个股选择。  
在组合构建上,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,对收益率曲线进行预测,对投资组合进行久期管理和信用管理,并定期对类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。  
在个券选择上,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,对目标个券进行信用评级,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。具体策略有:

(1)利率预期策略:本基金首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场环境的变化趋势,重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成合理预期。

(2)估值策略:建立不同品种的收益率曲线预测模型,并利用这些模型进行估值,确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值的券种。

(3)久期管理:本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化评估为核心,通过久期管理,合理配置投资品种。

4. 可转换债券投资策略  
可转换债券(含交易分离可转债)兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征,在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析,投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券,获取稳健的投资回报。

5. 中小企业私募债投资策略  
本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,其中,投资决策流程和风险控制制度需经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。本基金对中小企业私募债的投资主要自上而下判断景气周期和自下而上精选标的两个角度出发,结合信用分析和信用评估进行,同时通过有纪律的风险监控实现对投资组合风险的有效管理。

6. 股指期货投资策略  
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对冲证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

7. 股票期权投资策略  
本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股指期货定价模型,选择估值合理的期权合约。  
基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

8. 资产支持证券投资策略  
本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素,主要从资产信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估,在严格控制风险的情况下,确定资产合理配置比例,在保证资产安全性的前提下,以期获得长期稳定收益。

四、投资限制  
1. 组合限制  
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0%-95%;  
(2)本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;  
(3)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%;  
(4)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%;  
(5)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%;  
(6)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%;  
(7)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%;  
(8)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%;  
(9)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%;  
(10)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%;

(11)本基金有投资于信用评级为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;  
(12)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公开发行股票公司本次发行股票的总量;

(13)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;  
(14)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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以外的因素致使基金不符合前款规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(15)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%;  
(16)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资产净值的20%;  
(17)本基金管理人按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;  
(18)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)占基金资产的0%-95%;  
(19)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%;

(20)本基金因未平仓的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%;

(21)本基金开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

(22)本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(23)本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约及股票期权合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金在开始进行股指期货投资之前,应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商;

(24)本基金持有的全部中小企业私募债券,其市值不超过基金资产净值的10%;本基金持有一家企业发行的中小企业私募债,不得超过该债券的10%;

(25)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(26)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,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;

(27)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该公司可流通股票的15%;

(28)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,不得超过该公司可流通股票的30%;

(29)法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。  
因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资不符合上述规定投资比例的,除上述第(11)、(14)、(23)、(26)项外,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。

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,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。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,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,不需要经基金份额持有人大会审议。

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,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;  
(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,遵循持有人利益优先原则,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事项进行审查。

如法律法规或监管部门以后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。

五、业绩比较基准  
中证800指数收益率\*60%+中债总指数收益率\*40%  
中证800指数综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况,其成份股由中证500和沪深300成份股共同构成,较好的反映了市场上不同规模特征股票的整体表现,适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,或者证券市场出现更具有代表性的业绩比较基准,或者更科学的复合指数权重比例,本基金将根据实际情况在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更应履行适当的程序,报中国证监会备案,并予以公告,无需召开基金份额持有人大会审议。

六、风险收益特征  
本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险收益水平的基金产品。  
根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》,基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级,风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征,但由于风险等级分类标准的变化,本基金的风险等级可能会相应变化,具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法  
1. 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,保护基金份额持有人的利益;

2. 有利于基金资产的安全与增值;  
3. 不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;  
4. 不得从事关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系第三人牟取任何不当利益。

八、基金的投资组合报告  
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	25,103,593.62	84.57
	其中:股票	25,103,593.62	84.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,133,670.43	13.93
7	其他各项资产	445,251.38	1.50
8	合计	29,682,515.43	100.00

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	216,531.00	0.75
B	采矿业	1,083,735.00	3.73
C	制造业	17,509,776.11	60.32
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	353,143.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,312,463.42	7.97
J	金融业	1,778,192.07	6.14
K	房地产业	968,366.02	3.33
L	租赁和商务服务业	446,687.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	434,700.00	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	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,103,593.62	86.47

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	688363	华熙生物	5,482.00	810,787.80	2.79
2	002475	立讯精密	14,980.00	769,223.00	2.65
3	000661	长春高新	1,741.00	775,857.30	2.61
4	002555	三友联众	16,079.00	752,497.20	2.59
5	000858	五粮液	4,300.00	735,816.00	2.53
6	601799	星宇股份	5,600.00	711,200.00	2.45
7	300014	亿纬锂能	14,827.00	709,471.95	2.44
8	300122	智飞生物	7,000.00	701,050.00	2.41
9	300599	东方財富	33,992.00	686,638.40	2.37
10	600988	赤峰黄金	57,400.00	683,060.00	2.35

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

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	688363	华熙生物	5,482.00	810,787.80	2.79
2	002475	立讯精密	14,980.00	769,223.00	2.65
3	000661	长春高新	1,741.00	775,857.30	2.61
4	002555	三友联众	16,079.00	752,497.20	2.59
5	000858	五粮液	4,300.00	735,816.00	2.53
6	601799	星宇股份	5,600.00	711,200.00	2.45
7	300014	亿纬锂能	14,827.00	709,471.95	2.44
8	300122	智飞生物	7,000.00	701,050.00	2.41
9	300599	东方財富	33,992.00	686,638.40	2.37
10	600988	赤峰黄金	57,400.00	683,060.00	2.35

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。  
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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)				-	
股指期货投资本期收益(元)				59,493.15	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-	

本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注  
11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,583.82
2	应收证券清算款	413,541.08
3	应收股利	-
4	应收利息	518.75
5	应收申购款	10,607.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	445,251.38

11.3 其他资产构成

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处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
因四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计数据可能存在尾差。

七、基金的费用  
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。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年6月16日-2016/12/31	-2.80%	0.76%	3.14%	0.48%	-5.94%	0.28%
2017/1/1-2017/12/31	-1.23%	0.80%	7.39%	0.39%	-8.62%	0.41%
2018/1/1-2018/12/31	-25.10%	1.54%	-13.96%	0.80%	-11.14%	0.74%
2019/1/1-2019/12/31	33.24%	1.27%	20.66%	0.75%	12.58%	0.52%
2020/1/1-2020/6/30	21.29%	1.70%	2.70%	0.91%	18.59%	0.79%

八、基金的费用  
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,但法律法规、中国证监会另有规定的除外;

4.《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼费 and 仲裁费;  
5. 基金份额持有人大会费用;  
6. 基金的证券交易费用;  
7. 基金的银行汇划费用;  
8. 证券账户开户费用、账户维护费用;  
9. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,应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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:  
H=E×1.5%÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5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、休息日或不可抗力等,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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  
H=E×0.25%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5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、休息日或不可抗力等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3-8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。