

(上接C51版)

法定代表人:余磊
联系人:岑妹妹
电话:027-87617017
客服电话:95391/400-800-5000
网址:htp://www.ftfz.com
(30) 上海煜基基金销售有限公司
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(上海泰和经济发区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网址:www.jiufund.com.cn
(31) 海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
客服电话:400-808-1016
网址:www.fundhaijin.com
(32) 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
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(33) 中国平安人寿保险股份有限公司(仅代销A类)
注册地址:深圳市福田区福华三路星河发展中心办公9、10、11层
办公地址:深圳市福田区福华三路星河发展中心办公9、10、11层
法定代表人:丁新民
联系人:张雷
电话:021-20635631
传真:021-50475630
客服电话:95511 转1
网址:htp://life.pingan.com/
(34) 华融保险销售有限公司
注册地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通里财富广场B座13、14层
办公地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通里财富广场B座13、14层
法定代表人:路昊
联系人:郭勇强
电话:021-61058785
传真:021-61098515
客服电话:400-1181-188
网址:www.huaminisales.com
(35) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人:其实
联系人:潘世华
电话:021-54509998
传真:021-64585888
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(36) 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-20613999
传真:021-68599016
客服电话:400-970-0665
网址:www.ehowbuy.com
(37) 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
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(38) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号
办公地址:上海市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
法定代表人:肖雯
联系人:吴煜浩
电话:020-89629021
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
(39) 华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号邮政大厦230801
法定代表人:李工
联系人:范程
客服电话:95318
网址:www.hazq.com
(40) 民生基金销售有限公司(上海)有限公司
注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区(东座)16楼A31室
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
联系人:杨一新
电话:021-50206003
传真:021-50206001
客服电话:021-50206003
公司网站:htp://www.msfund.com
(41) 世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
邮政编码:518000
法定代表人:姜昧军
联系人:王雯
客服电话:4008-323-000
网址:www.csco.com.cn
(42) 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
法定代表人:王廷富
网址:www.52wtfund.com.cn
客服电话:400-821-0203
(43) 万和证券股份有限公司
注册地址:海口市南沙路49号通信广场2楼
办公地址:深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西
法定代表人:朱海理
联系人:郭东彤
电话:0755-82830333-115
(44) 中汇金牛(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号新华社三工作区5F
法定代表人:钱昊昊
联系人:徐英
电话:010-59336539
传真:010-59336500
客服电话:4008909998
网址:www.jink.com
(45) 业广证券股份有限公司
注册地址:南京市中华路50号
办公地址:南京市中华路50号
法定代表人:周剑秋
联系人:孙朝旺
电话:025-52278870
传真:025-52313068
客服电话:400-328-1288
网址:htp://www.ftol.com.cn/etrading
(二) 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:罗春凤
电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
联系人:张平
(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
联系人:陈颖华
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、陈颖华
(四) 审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
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
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
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:曹翠丽、陈怡
联系人:陈怡

四、基金的名称

平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

混合型发起式证券投资基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资

(一) 投资目标
本基金利用数量化投资模型指导投资组合的构建,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。(二) 投资范围
本基金的投资对象是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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货,以及法律法规和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。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%。本基金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,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

(三) 投资策略

本基金采用数量化投资策略建立投资组合,采用自上而下的资产配置和自下而上的个股选择相结合的方式,切实贯彻数量化的投资逻辑,以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。

本基金的投资策略包括两部分:一是通过自上而下的资产配置策略确定各类资产的风险配置比例,并对组合进行动态管理,进一步优化整个组合的风险收益参数;二是通过自下而上的上市公司基本面数据、交易所公开信息、资本市场市场数据、分析师预期数据,以及其他对股票选取有帮助的公开数据,构建数量化的多因子模型,选取具有投资价值的上市公司股票构成最终的股票投资组合。

1. 资产配置策略
本基金采用“自上而下”的资产配置方法,确定本基金资产在股票、债券及其他金融工具等类别资产间的分配比例。在具体的资产配置过程中,通过把握宏观经济增长的长期趋势、短期的经济周期波动以及政策导向,判断各类资产的风险程度和收益特征,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的比例,以达到控制风险、增加收益的目的。2. 量化多因子股票投资策略
本基金主要通过数量化投资组合,选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金利用长期积累并实时扩展的数据库,科学地考虑了大量的各类信息,并运用基金管理人自行开发的多因子模型框架,综合基本面因子、量化技术因子以及分析师预期因子优选股票,基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,结合收益与风险波动性,适时调整组合的持股组成以及个股的资金配置。模型主要包含但不限于以下四因子:

(1) 基本面因子:主要包括公司的基本面信息,主要包括净利润增长率和长期增长率,主营业务收入长期和短期增长情况,公司业绩增长超越市场预期幅度,公司最近重要新闻事件的发生,例如:新产品上市、新收购、新管理层上任等;个股流动性供应,包括:流通市值、解禁计划;

(2) 量价技术因子:通过研究分析个股二级市场价格和交易数据,挖掘股价的增长与反转模式,作为选股的依据;

(3) 分析师预期因子:包括分析师评级及其变化、上市公司年度净利润一致预期指标及其变化、分析师关注度及其变化等反映上市公司动态成长性指标;

3. 量化价值投资策略
本策略综合考虑股票的长期稳定增长性和和单期增长性,对处于成长阶段的上市公司收入增长、利润增长的稳定性和持续性进行评估,同时也对毛利率、净利润率、盈利质量指标进行跟踪,并考察分析师对该股的盈利预期。4. 事件驱动策略
该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究,分析事件对股价波动成的方向,以赚取超额收益。此外,该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性,实现套利收益。5. 债券投资策略
本基金将根据需要,适度进行债券投资。本基金在严格控制整体资产风险的基础上,根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点及因素的分判断确定整体框架,通过对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种的定价进行预测,进行以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标的投资。

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,根据宏观经济运行状况的分析与预判,灵活调整组合的久期。信用风险控制方面,对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市场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。

6. 权证投资策略
本基金在进行权证投资时,将通过对权证的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认股权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

基金管理人将充分考量证券的收益率、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

7. 股指期货投资策略
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考量股指期货的收益率、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特指风险下的流动性风险,如大额申购赎回等;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。8. 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平均久期和收益率曲线的影响,同时密切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。9. 国债期货投资策略
本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考量国债期货的收益率、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 and 头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上,将谨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变化,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。

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。

(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) 本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%;

(2) 本基金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交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3) 本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不得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上市公司发行的证券,不得超过该证券的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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15) 本基金投资股指期货或国债期货,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%;在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指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;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%;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%;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;基金在任何交易日日内交易(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%;

(16) 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%;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%;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;基金在任何交易日日内交易(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%;

(17) 本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(18) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(19) 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的30%;

(20) 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资产不符合前述规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(21) 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持一致;

(22) 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)、(20)、(21)项所规定的情形外,因证券、期货市场波动、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。法律法规或监管部门另有规定时,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。在上述期间内,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。

如果法律法规或监管部门对上述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,本基金投资不再受相关限制。

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) 承销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,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5) 向其基金管理人、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事项进行审查。

如法律、行政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。

五、业绩比较基准

中证500指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

选择该业绩比较基准,是基于以下因素:

1. 中证500指数和中证综合债指数知名度、透明;

2. 中证综合债指数具有较高的知名度和市场影响力;

3. 基于本基金的资产配置和投资比例限制,选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为本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时,本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,无需召开基金份额持有人大会。

六、风险收益特征
本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。七、基金管理人代表基金行使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基金独立行使所投资证券项下权利,保护基金份额持有人的利益。基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利时应遵守以下原则:

1. 不参与所投资公司的经营管理,不谋求对上市公司的控股;

2. 有利于基金财产的安全与增值,有利于保护基金份额持有人的合法权益;

八、投资组合报告

基金管理人、基金托管人及基金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责任。

基金托管人平安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、净值数据和投资组合报告内容,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2018年9月30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	10,747,089.78	64.21
2	其中:股票	10,747,089.78	64.21
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	4,800,000.00	28.68
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	963,097.57	5.75
11	其他资产	226,202.62	1.35
12	合计	16,736,389.97	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

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	-	-
B	采矿业	426,184.00	2.57
C	制造业	4,717,390.48	28.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	197,652.00	1.19
E	建筑业	515,722.40	3.11
F	批发和零售业	407,650.00	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	175,914.00	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	206,642.00	1.25
J	金融业	3,778,273.90	22.77
K	房地产业	314,859.00	1.90
L	租赁和商务服务业	6,802.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国民服务、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	-	-
S	综合	-	-
合计		10,747,089.78	64.76

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未有港股通股票投资组合

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	600519	贵州茅台	600	438,000.00	2.64
2	600036	招商银行	14,010	429,966.90	2.59
3	600030	中信证券	21,600	360,504.00	2.17
4	601336	新华保险	6,300	318,024.00	1.92
5	601166	兴业银行	18,900	301,455.00	1.82
6	601601	中国太保	8,400	298,284.00	1.80
7	000333	美的集团	6,400	257,920.00	1.55
8	000651	格力电器	6,400	257,280.00	1.55
9	002463	沪电股份	37,200	259,940.00	1.45
10	600016	民生银行	36,100	228,874.00	1.38

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资组合

1.5 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投资。

1.6 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。

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明细

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细

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

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

本组合投资的前十名证券之一招商银行于2018年2月12日被中国银保监会公开处罚,主要违法违规事实包括:(一)内控管理重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。中国银保监会处罚招商银行6570万元,没收违法所得3,024万元,罚没合计6573.024万元。本基金管理人对该公司进行了深入的分析和研究,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。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的规定。

本组合投资的前十名证券之一兴业银行于2018年4月19日被银保监会公开处罚,主要违法违规事实包括:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理重违反审慎经营规则,多设分支机构违规开展业务;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产贷款科目;(八)部分非现场监管统计数据与事实不符;(九)个别董事未经任职资格核准即履职;(十)变相批量转让个人贷款;(十一)向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行5870万元。本基金管理人对该公司进行了深入的分析和研究,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。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的规定。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体未被监管部门立案调查或在本报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.11.2

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票。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,381.53
2	应收证券清算款	205,986.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-3,464.76
5	应收申购款	299,555.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	226,202.62

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细</