

(上表 245 续)

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(人民币元)
1	应收利息	159.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收资产	5,596,792.17
5	应收申购款	1,184,230.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,031,192.26

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。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

6.投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四至五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

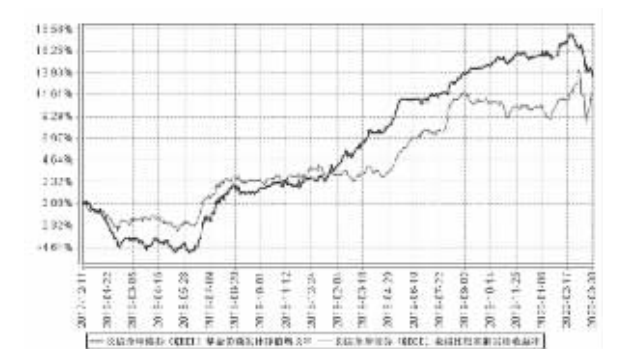
十三、基金的业绩

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。投资者有风险,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。

2020年1季度及历史期间同类基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率与基准差	业绩比较基准收益率(剔除费用)	业绩比较基准收益率(剔除费用)	①-③	②-④
2018年12月1日至2019年12月31日	2.68%	0.22%	3.64%	0.22%	-1.6%	0.0%
2019年	12.96%	0.18%	6.38%	0.20%	6.56%	-0.02%
2020年1月1日至2020年3月31日	-1.40%	0.30%	1.42%	0.44%	-2.52%	-0.14%

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.图示日期为2017年12月1日至2020年3月31日。
2.基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定。

十四、费用概览

(一)基金费用的种类

- 基金管理人的管理费;
 - 基金托管人的托管费(含境外托管人收取的费用);
 - 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费、税务顾问费和诉讼费;
 - 《基金合同》生效后与基金相关的公证费、律师费、诉讼费、仲裁费、税务顾问费和诉讼费;
 - 《基金合同》生效后与基金相关的审计费、律师费、诉讼费、仲裁费、税务顾问费和诉讼费;
 - 基金合同生效后与基金相关的信息披露费、购买或赎回证券产生的任何税收(指费、关税、印花税及预扣税(与之前各条有关的相关利息及费用));
 - 代表基金处理其他与基金投资活动有关费用的;
 - 基金的银行汇划费用、账户维护费或外汇兑换交易的相关费用;
 - 基金的销售推广费用;
 - 按照国家有关规定《基金合同》约定,可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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H = E × 1.0% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提,按月累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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、公休等,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

- B:为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,按月累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。
- 上述“(一)基金费用种类”中第3-10项费用,根据有关法规及相应协议约定,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。
3. 不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1.基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2.基金管理人处理和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3.《基金合同》生效前的相关费用;
4.其他根据相关法律法规及中国证监会有关规定不得列入基金费用的项目。
- (四)费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致,并履行适当程序后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等费率。基金托管费率须经基金份额持有人大会决议。
基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。
- (五)基金收益
本基金收益分配应遵循下列原则:
1.本基金收益分配应遵循相关法律法规及中国证监会有关规定,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。

通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户美元申购费率如下:

美元申购金额 M (含非费)	养老金客户申购费率
M < 20 万元	0.04%
20 万元 ≤ M < 50 万元	0.02%
50 万元 ≤ M < 100 万元	0.01%
M ≥ 100 万元	0.00%/笔

通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户人民币申购费率如下:

人民币申购金额 M (含非费)	养老金客户人民币申购费率
M < 20 万元	0.04%
20 万元 ≤ M < 50 万元	0.02%
50 万元 ≤ M < 100 万元	0.01%
M ≥ 100 万元	0.00%/笔

除养老金客户之外的其他投资者申购本基金的申购费率见下表:

人民币申购金额 M (含非费)	申购费率
M < 100 元	0.8%
100 元 ≤ M < 500 元	0.6%
500 元 ≤ M < 1,000 元	0.4%
M ≥ 1,000 元	0.2%

(上表 246 续)

四、基金的投资
本基金为人民币股票型证券投资基金,主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券和货币市场工具,权证、股指期货、国债期货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相关规定)。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%;债券、货币市场工具、银行存款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占基金资产的5%-100%。本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略
1.资产配置策略
本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源,基于本基金的投资目标及投资理念,从宏观和微观两个角度进行研究,并开展战略资产配置,之后通过战术资产配置再平衡基金投资组合,实现组合内各类资产的优化配置,并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。

2.股票投资策略
本基金将结合定性分析与定量分析,主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围,基于对上市公司的高质量评估分析,从风险因素分析和估值分析,筛选出基本面良好且成长性较好的股票进行投资,有效控制非系统性风险,实现组合的长期稳健增值。

3.债券投资策略
本基金在债券资产的投资过程中,将采用积极主动的投资策略,结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场利率中短期利率分析、供求变化等多种因素动态配置债券品种,在兼顾收益的同时,有效控制基金资产的流动性风险。在利率趋势上,本基金将综合运用短期利率、中期利率策略,利率预期策略等多种方法,结合债券的流动性、信用风险和多种因素,对个券进行积极的管理。

对于中小企业私募债券,本基金将重点关注发行人财务状况、个人增信措施等因素,以及对基金资产流动性的影响,在充分掌握信用风险、流动性风险的基础上,进行投资决策。

4.衍生品投资策略
本基金在股指期货投资中,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、交易活跃的近月合约,通过对证券市场和中长期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。基金管理人将充分挖掘股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险,对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,利用金融衍生品对冲风险,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险控制
本基金为人民币股票型基金,属于中等风险、中等收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人承诺本基金及基金托管人报告期内不存在虚假记载、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。

基金托管人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及中国证监会相关规定履行了基金托管人职责,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

十二、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:

(一)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	238,019,572.74	74.36
2	固定收益	238,019,572.74	74.36
3	货币资金	-	-
4	应收利息	13,021,425.90	4.06
5	应收股利	13,021,425.90	4.06
6	其他资产	-	-
7	其他负债	15,989,774.61	4.97
8	其他负债	5,961,900.69	1.82
9	合计	320,972,513.69	100.00

注:1.本基金本报告期末通过股指期货交易股指期货敞口。
2.本报告期末未通过国债期货交易股指期货敞口。
3.本报告期末未通过国债期货交易股指期货敞口。

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	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	214,086,498.58	68.98
D	电力、热力、燃气及生产服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,002,363.31	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	19,692,765.32	6.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	614,752.22	0.20
J	金融业	-	-
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	7,013,193.90	2.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、生物及健康产业	-	-
P	教育	-	-
Q	文化艺术和体育	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		238,019,572.74	74.37

(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

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	15,501	17,699,341.00	5.69
2	000866	五粮液	398,000	15,641,400.00	5.03
3	600521	华海药业	680,520	10,461,000.00	3.28
4	600887	伊利股份	511,200	15,284,420.00	4.90
5	000858	五粮液	120,336	13,383,260.00	4.16
6	600969	玲珑轮胎	182,800	13,475,090.00	4.30
7	02222	招商局港口	88,900	11,711,044.00	3.76
8	600399	金隅集团	404,300	11,381,040.00	3.58
9	000029	中航证券	46,853	10,969,288.00	3.52
10	000003	招商银行	208,800	10,574,320.00	3.41

(四)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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190206	19国债06	100,000	10,008,000.00	3.22
2	019707	19国债07	29,500	3,013,425.00	0.97

(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股指期货投资明细

序号	期货代码	期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1909	沪深300股指期货	100,000	10,008,000.00	3.22
2	IF1907	沪深300股指期货	29,500	3,013,425.00	0.97

(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

序号	证券代码	证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190206	19国债06	100,000	10,008,000.00	3.22
2	019707	19国债07	29,500	3,013,425.00	0.97

(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金融衍生品投资明细

序号	衍生品代码	衍生品名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1909	沪深300股指期货	100,000	10,008,000.00	3.22
2	IF1907	沪深300股指期货	29,500	3,013,425.00	0.97

本基金本报告期末未持有贵金属。
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细

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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

4.报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
5.报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
6.投资衍生品持仓的公允价值及公允价值变动情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
7.衍生品投资的投资策略、投资目的和投资品种
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

八、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险控制
本基金为人民币股票型基金,属于中等风险、中等收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

十一、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

十二、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

十三、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十四、基金的风险控制
本基金为人民币股票型基金,属于中等风险、中等收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

十五、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

十六、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十七、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

十八、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

十九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

二十、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

二十一、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

二十二、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

二十三、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

二十四、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

二十五、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

二十六、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

二十七、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

二十八、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以视本基金的投资目标和投资策略,本着对基金份额持有人利益最大化的原则,在与基金托管人协商一致的前提下,变更业绩比较基准,并报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

二十九、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
3.本期股指期货投资评价
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

三十、基金的投资组合报告
截至2020年3月31日,本基金投资组合资产配置情况如下:
1.本基金投资的前十名证券的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
(八)报告期末贵金属公允价值占基金资产净值比例前五名股权投资明细
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
1.报告期内本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2.报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细