

大成添利宝货币市场基金更新招募说明书摘要

(上接 97 页)
68.北京诚信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区丰盛胡同 8 号 2 楼 106 室-67
办公地址:北京市朝阳区四惠盛世龙园西园 10 号
法定代表人:杨炳峰
联系人:吴鹏
电话:18701388515
传真:010-67767615
客服电话:400-680-2123
网址:www.zhixin-inv.com
69.上海得万投资顾问有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 11 室
办公地址:上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼
法定代表人:王廷贵
联系人:姜吉凤
联系电话:021-51327185
传真:021-50710161
客服电话:400-821-0203
70.上海聚基资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特路 277 号 3 层 310 室
办公地址:上海市长宁区福北路 518 号 8 楼 3 层
邮编:200336
法定代表人:燕斌
联系人:兰敏
电话:021-52022963
传真:021-52075270
客服电话:400-166-6788
网址:www.66zichan.com
71.泰达财富基金销售有限公司(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场 3 号
法定代表人:林森
联系人:张强
电话:0411-88991212
传真:0411-84396536
客服电话:400-6411-999
网址:www.taichaiwealth.com
72.上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆阳路 618 号 a1002 室
法定代表人:王翔
联系人:姜伊
客服电话:400-820-1569
网址:www.jiuyufund.com.cn
73.上海邦信财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路 765 号 002-115 室
法定代表人:陈维杰
联系人:蔡佳
电话:021-63333213
传真:021-63332523
网址:www.vstonewealth.com
74.上海中正达广基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙大道 2816 号 302 室
办公地址:上海市徐汇区龙大道 2816 号 3 楼
法定代表人:黄欣
公司电话:021-33768132
客服电话:400-6767-523
网址:http://www.zhongzhengfund.com
75.北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙楼 4 层 222 单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙楼 4 层 222 单元
法定代表人:胡伟
传真:010-65961887
电话:010-65961887
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
76.武汉市创赢基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 栋 23 层 1 号、4 号
法定代表人:董捷
联系人:杨帆
电话:027-87006033/87006009
网址:www.wuycfund.com
77.上海基煜基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
法定代表人:王芷光
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
联系人:李博宇
客服电话:40082219021
网址:www.jiuyufund.com
78.珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号 106 室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
联系人:张捷
网站:www.yingmi.cn
客服电话:020-89620066
79.和耕传承基金销售有限公司
注册地址:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503 房间
办公地址:北京市朝阳区福仙路 6 号院互联网金融产业园 3 座 B 座
法定代表人:王智
客服电话:4000-666-671
网址:http://www.hggcp.com
80.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路航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89489070
传真:0755-21674952
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
81.北京肯瑞瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2903-06
办公地址:北京市海淀区经济技术开发区科园十一街 18 号院京东集团总部
法定代表人:王昆
电话:0518-400 098 8111
企业商务:400 081 8916
传 真:010-8919566
网址:fund.jd.com
82.深圳市金子基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层
办公地址:深圳市福田区香蜜湖街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼
法定代表人:喻声军
联系人:刘智勇
电话:0755-29330513
传真:0755-29392030
客服电话:400-9002-888
网址:https://www.jz.com.cn
83.北京蛋蛋基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 2122507
法定代表人:闫岩
联系人:袁永娟
电话:010-61946888
传真:010-61949099
网址:https://danfund.jd.com
84.上海华夏夏煜投资管理咨询有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路 667 号 1 幢 2 楼 268 室
法定代表人:毛维平
办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B8 层
客服热线:400-817-7666
公司网站:www.amortortune.com
C. 注册登记机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层
办公地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 33 层
法定代表人:刘尚军
电话:0755-83182388
传真:0755-83182629
联系人:黄勇平
(三)律师事务所和经办注册会计师
名称:北京市中银律师事务所
地址:北京市西城区丰盛胡同 2 号中银大厦 30 层 F 财富中心写字楼 A 座 40 层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层

负责人:王琦
电话:0755-22163333
传真:0755-22163330
经办律师:沈晓刚,刘文义
联系人:冯文
(五)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号展业银行大厦 6 楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中国 11 楼
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:薛竟,俞伟敏
电话:021-22228888
传真:021-22228900
联系人:俞伟敏
基金名称:大成添利宝货币市场基金
五、基金的类型
基金类别:货币市场基金
六、基金的投资方式
基金运作方式:契约开放式
七、基金的投资目标
在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。
八、基金的投资方向
本基金的投资范围包括:
1. 现金;
2. 期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;
3. 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;
4. 中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。
法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其它货币市场工具,在不改变基金投资目标、投资策

略、不改变基金风险收益特征的前提下,本基金可参与其他货币市场工具的投资,不需召开持有人大会。其比例限制按照相关法律法规和行业监管规定执行。
九、基金的投资策略
1. 利率趋势评估策略
通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。
2. 类属配置策略
本基金管理人将在评估各种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。
3. 组合平均剩余期限配置策略
本基金管理人将对未来短期利率走势的研判,结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。当预期短期利率上升时,降低组合久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期短期利率下降时,提高组合久期,以获得资本增值或锁定较高的利率水平。
4. 银行协议存款投资策略
银行协议存款和大额存单是本基金的主要投资对象。在确保安全性和流动性的前提下,通过不同商业银行和不同存款期限的选择,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行协议存款和大规模单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。通过对宏观经济、宏观经济、市场资金面等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限。

五、流动性管理策略
在日常的投资管理过程中,本基金将会密切关注申购与赎回资金变化情况,季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。
(四)投资限制
1. 本基金不得投资于以下金融工具:
(1) 股票、权证;
(2) 可转债、可交换债券;
(3) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券,已进入最后一个利率调整期的除外;
(4) 信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具;
(5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。
法律法规或监管部门取消上述限制,本基金不受上述规定的限制或以调整后

为准,但需提前公告。
2. 组合限制
(1) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天,平均剩余存续期不得超过 240 天;除基金管理

人以其自有资金投资的以外,当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天,平均剩余存续期不得超过 120 天,投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日到期内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%;除基金管理人的其他基金持有者一家机构发行的证券,不得超过该证券的 10%;
(2) 本基金持有同一机构发行的证券,不得超过该证券的 10%;
(3) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家机构发行的证券,不得超过该证券的 10%;
(4) 本基金持有同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%,国债、中央银行票据、政策性金融债券除外;
(5) 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 10%,因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人

之外的因素致使基金不符合前款所规定的比例限制的,基金管理人不得主动调整流动性受限资产的投资;
(6) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%,其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。货币市场基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的资产银行存单发行与银行存单的,应当经基金管理人董事会审议批准,相关交易应当事先征得基金托管人的同意,并作为重大事项履行信息披露义务。
(7) 本基金投资有固定期限银行存款的比例,不得超过基金资产净值的 30%,但投资于有存款期限,根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制;
(8) 本基金投资于具有基金托管人资格的唯一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例不得超过 20%,投资于不具有基金托管人资格的唯一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例不得超过 10%。
(9) 基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一原始权益人的银行存单及其发行的存单与债券,不得超过该原始权益人最近一个季度末净资产的 10%;
(10) 本基金持有保持流动性受限资产的市值合计不得超过以下比例限制:

1. 现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得超过 5%;
2. 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日到期内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%;
3. 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%;
4. 除现金类资产外,连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形,现金占基金资产净值的比例不得超过 20%。

(11) 本基金投资于资产支持证券的比例限制:
1. 本基金投资于有担保的资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;中国证监会规定的特殊品种除外;
2. 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%;
3. 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) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得投资于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级,持有资产支持证券的信用评级不得下调,不再符合投资标准,本基金在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(13) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;
(14) 本基金在全国银行间同业拆借市场最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期。
(15) 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(质押品的剩余期限不受法律法规规定的限制);
(16) 法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的,从其规定。
除上述第(5)项、第(10)项第 1) 条、第(14)项外,因市场波动、基金规模变动、基金份额管理人

之外的因素致使投资组合不符合上述约定的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,以达到合规,但不因中国证监会规定的新增情形除外。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。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。
法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。
3. 禁止行为
(1) 承销证券;
(2) 向他人贷款或提供担保;
(3) 从事内幕交易、操纵证券交易价格;或提供担保;
(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。
法律法规和监管部门取消上述禁止性规定的,在适用于本基金的情况下,则本基金投资不再受相关限制。

十、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:银行活期存款利率(税后)
本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资目标、投资目标和流动性特征,本基金选取银行活期存款利率作为本基金的业绩比较基准。
如法律法规或监管机构以后发布货币市场基金业绩比较基准不再适用,或有其他代表性更强、更科学客观的或者更适用于市场普遍接受的业绩比较基准适用与本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额

持有人合法权益的原则,经与基金托管人协商一致,无需召开基金份额持有人大会,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整并及时公告,并在更新的招募说明书中列示。
十一、基金的风险收益特征
本基金业绩比较基准为:银行活期存款利率(税后)
本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资目标、投资目标和流动性特征,本基金选取银行活期存款利率作为本基金的业绩比较基准。
如法律法规或监管机构以后发布货币市场基金业绩比较基准不再适用,或有其他代表性更强、更科学客观的或者更适用于市场普遍接受的业绩比较基准适用与本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,经与基金托管人协商一致,无需召开基金份额持有人大会,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整并及时公告,并在更新的招募说明书中列示。

十二、基金的投资组合报告
基金管理人及基金托管人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责任。
基金托管人兴业银行根据基金合同规定,于 2019 年 2 月 13 日复核了本报告中的财务资料、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、误导性陈述或重大遗漏。
本投资组合报告所载数据取自本基金 2019 年第 4 季度报告,截至 2019 年 12 月 31 日。(财务数据未经审计)

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	10,106,328,138.36	37.15
	其中:债券	10,106,328,138.36	37.15
	资产支持证券	-	-
2	买入金融资产	1,092,720,190.08	4.02
	其中:买入回购金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	16,703,389,188.26	57.73
4	其他资产	301,268,760.22	1.11
5	合计	27,207,646,276.64	100.00

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	4.12
	其中:报告期内债券回购融资余额最大余额	-
2	报告期内债券正回购融入资金余额	-
	其中:报告期内债券正回购融入资金余额最大余额	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例均为报告期内每个交易日融资金额占资产净值的简单平均值。
债券正回购资金余额超过基金资产净值的 20%的说明
本报告报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。
3. 期末基金资产构成比例
(1) 投资组合比例及投资限制基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	98
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	83

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明
无

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	5.91	11.24
	其中:剩余存续期超过 307 天的浮动利率债券	-	-
2	30天至 60 天	26.41	-
	其中:剩余存续期超过 307 天的浮动利率债券	-	-
3	60天至 90 天	46.51	-
	其中:剩余存续期超过 307 天的浮动利率债券	-	-
4	90天至 120 天	10.43	-
	其中:剩余存续期超过 307 天的浮动利率债券	-	-
5	120天至 397 天(含)	18.83	-
	其中:剩余存续期超过 307 天的浮动利率债券	-	-
6	397天以上	13.09	11.24

4. 报告期末投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明
本报告期末,本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。
5. 报告期末投资组合品种分布的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	239,400,816.08	0.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,197,173,136.68	4.30
	其中:政策性金融债券	1,197,173,136.68	4.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	900,064,473.64	4.01
6	中期票据	-	-
7	证券公司债	7,689,499,712.00	31.46
8	资产支持证券	-	-
9	合计	10,106,328,138.36	41.26
10	报告期内存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

6. 报告期末未按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1118142960	18江苏银行 CD260	5,000,000	497,735,793.81	2.04
2	1118149862	18招商银行 CD611	5,000,000	497,665,328.59	2.04
3	160239	16附息 06	4,440,000	444,121,728.28	1.82
4	111816300	18上海银行 CD260	4,000,000	388,199,724.24	1.63
5	111813168	18招商银行 CD168	4,000,000	388,198,856.78	1.63
6	190904	19双创 04	3,200,000	320,286,400.00	1.36
7	111821356	18招商银行 CD356	3,000,000	296,514,757.11	1.22
8	111814290	18江苏银行 CD289	3,000,000	296,511,216.34	1.22
9	111821356	18招商银行 CD356	3,000,000	288,497,234.60	1.22
10	111821359	18招商银行 CD359	3,000,000	288,461,466.43	1.22

7. "影子银行"与摊余成本法估值偏离的基金资产估值偏离
无
8. 报告期末未计入估值调整项下的前十大非金融资产投资明细
本基金本报告期末未持有非金融资产投资。
9. 投资组合报告附注
(1) 基金计价方法说明
本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入的溢价与折价,在剩余存续期内按实际利率法每日计提摊销。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。

(2) 本基金投资的前十名证券的发行主体未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、处罚的情况
1. 本基金投资的前十名证券之一 渤海银行 CD356(111821356.18)的发行主体渤海银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因理财及自营投资资金违规用于发放土地款等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字〔2018〕119 号)。本基金认为,对渤海银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。
2. 本基金投资的前十名证券之一 18 渤海银行 CD359(111821359.18)的发行主体渤海银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因理财及自营投资资金违规用于发放土地款等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字〔2018〕119 号)。本基金认为,对渤海银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

(3) 其他证券估值偏离的基金资产估值偏离
无
10. 基金资产组合报告附注
(1) 基金资产组合报告
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况
1. 报告期末基金资产组合情况
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

2. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

3. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

4. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

5. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

6. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

7. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

8. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

9. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

10. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

11. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

12. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

13. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

14. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

15. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

16. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

17. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

18. 基金资产组合报告附注
截至 2019 年 12 月 31 日,基金资产组合如下:
报告期末基金资产组合情况

(一) 基金合同生效以来(2014 年 7 月 28 日基金合同生效以来)完整会计年度的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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
2014.07.28-2014.12.31	2.0048%	0.0277%	0.1565%	0.0000%	1.8483%	0.0277%
2015.01.01-2015.12.31	3.6506%	0.0066%	0.3500%	0.0000%	3.1006%	0.0066%
2016.01.01-2016.12.31	2.8626%	0.0022%	0.3500%	0.0000%	2.5026%	0.0022%
2017.01.01-2017.12.31	3.9178%	0.0077%	0.3500%	0.0000%	3.5678%	0.0077%
2018.01.01-2018.12.31	3.5890%	0.0017%	101.5656%	0.0001%	-97.9766%	0.0016%
2014.07.28-2018.12.31	16.5882%	0.0048%	1.5565%	0.0000%	15.0317%	0.0048%

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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
2014.07.28-2014.12.31	2.1146%	0.0277%	0.1565%	0.0000%	1.9581%	0.0277%
2015.01.01-2015.12.31	3.6899%	0.0066%	0.3500%	0.0000%	3.3399%	0.0066%
2016.01.01-2016.12.31	2.9205%	0.0022%	0.3500%	0.0000%	2.5705%	0.0022%
2017.01.01-2017.12.31	4.1718%	0.0086%	0.3500%	0.0000%	3.8218%	0.0086%
2018.01.01-2018.12.31	3.6181%	0.0017%	101.5656%	0.0001%	-97.9475%	0.0016%
2014.07.28-2018.12.31	17.9474%	0.0048%	1.5565%	0.0000%	16.3909%	0.0048%

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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
2014.07.28-2014.12.31	2.0634%	0.0277%	0.1565%	0.0000%	1.9029%	0.0277%
2015.01.01-2015.12.31	3.6564%	0.0066%	0.3500%	0.0000%	3.2564%	0.0066%
2016.01.01-2016.12.31	2.7556%	0.0022%	0.3500%	0.0000%	2.4056%	0.0022%
2017.01.01-2017.12.31	4.0269%	0.0095%	0.3500%	0.0000%	3.6769%	0.0095%
2018.01.01-2018.12.31	3.6734%	0.0017%	101.5656%	0.0001%	-97.8921%	0.0016%
2014.07.28-2018.12.31	17.1211%	0.0048%	1.5565%	0.0000%	15.5646%	0