

中债综合指数指数的选债券的信用类别全面,期限构成宽泛。选用上述业绩比较基准能够充分反映本基金的风险收益特征。

若未来市场发生变化导致上述业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,依据维护投资者合法权益的原则,经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的调整须经基金管理人和基金托管人协商一致,并及时在指定媒介上公告,且无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

[illegible]

项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
权益投资	16,119,248.72	65.19
其中：股票	16,119,248.72	65.19
债券投资	--	--
其中：基金	--	--
资产支持证券	--	--
贵金属投资	--	--
金融衍生品投资	--	--
买入返售金融资产	--	--
其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--
银行存款和结算备付金合计	8,515,394.88	34.44
其他资产	90,154.48	0.36
合计	24,725,318.09	100.00

行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
农、林、牧、渔业	-	-
采矿业	-	-
制造业	7,673,089.33	31.36
电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
建筑业	-	-
批发和零售业	20,149.04	0.08
交通运输、仓储和邮政业	-	-

住宿和餐饮业	--	--
信息传输、软件和信息技术服务业	3,585,960.00	14.66
金融业	--	--
房地产业	537,362.00	2.20
租赁和商务服务业	--	--
科学研究和技术服务业	687,724.00	2.81
水利、环境和公共设施管理业	2,006,397.00	8.20
居民服务、修理和其他服务业	--	--
教育	--	--
卫生和社会工作	783,543.00	3.20
文化、体育和娱乐业	825,139.36	3.37
综合	--	--

合计				68,119,267.3	68.08
按期末按行业分类的港股通投资股票投资组合					
报告期内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					
股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例	公允价值占基金资产净值比例
300815	芯来生物	17,600	2,006,872.00	2.20	2.20
300788	通济药业	53,100	1,970,070.00	2.19	2.19
300760	金域医学	6,500	1,701,650.00	1.88	1.88
688229	博腾股份	10,418	1,627,720.40	1.80	1.80
300166	东方雨虹	112,400	1,615,960.00	1.78	1.78
688036	泰格医药	35,178	1,566,707.18	1.72	1.72
300629	健盛生物	10,800	1,022,440.00	1.13	1.13
300144	宋城演艺	33,022	826,130.36	0.92	0.92
300069	光电股份	15,500	769,335.00	0.85	0.85
03882	金域医学	13,600	756,915.00	0.84	0.84

报告期末按券种品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金本报告期末未投资股指期货

金本报告期末未投资的股指期货交易情况说明

金本报告期间股指期货投资情况

金本报告期末未投资股指期货

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

金本报告期末未投资国债期货

金本报告期间国债期货交易情况

金本报告期末未投资国债期货

报告期末衍生品投资的投资品种和数量

报告期末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、处罚的情况

金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告披露日前12个月内受到过公开谴责、处罚的情况。

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选的股票库。

基金的持仓情况如下：

名称	金额(元)
存在保本基金	19,858,111
拟收证券申购款	-
拟收利息	-
拟收股利	1,622,139
拟收申购款	69,798,133
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	90,154,460

报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

由于四套五人原因，分之二之和与合计可能有尾差。

三、基金的投资

管理人依据恪守信、诚实信用和谨慎原则管理并运用基金财产，但不保证盈利，也不保证最低收益。基金的业绩证明并不代表其未来表现，投资者有在做出投资决策前请自行仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值增长率与同期业绩比较基准之差及基金收益分配率比较表

合同生效日至 2016 年 5 月 3 日	基金合同成立至基金份额净值增长率及收益分配与权益扣除基金的净值增长率
基金净值增长率	业绩比较基准

年份	基金资产净值增长率	上证综指增长率	沪深300指数增长率	创业板指数增长率	①-③	②-④
2010-2016.12.31	-10.20%	0.90%	2.42%	-12.62%	0.34%	-
2011-2017.12.31	16.37%	1.01%	12.10%	0.52%	4.27%	0.49%
2018-2019.12.31	-33.88%	1.38%	-21.00%	-10.78%	-12.82%	0.21%
2019-2020.12.31	35.98%	1.10%	27.71%	1.01%	8.18%	0.09%
2020-2020.03.31	10.56%	-1.42%	-6.32%	-15.96%	16.06%	0.03%
2020-2020.03.31	3.80%	1.26%	0.43%	0.93%	-4.63%	0.33%

注：基金合同成立时间以及基金净值统计的起始时间，并与同期业绩比较基准的历史走势对比图。

(2016年5月4日至2020年3月31日)

数据来源：国泰君安证券基金研究部

基金资产净值增长率
上证综指
沪深300
创业板

基金费用种类

基金管理人管理费；

基金托管人托管费；

基金合同生效前与基金相关的信息披露费用；

基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

基金份额持有人大会费用（包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费）

基金的证券交易费用；

基金的银行汇划费用；

基金的开户费用、账户维护费用；

基金管理人及基金托管人按照《基金合同》约定,在基金资产中列支的其他费用。
基金管理人有权根据基金运作情况,在法律法规范围内按照公开的市场价格确定,并和基金托管人协商一致后,对基金费用进行调整。
基金费用支付方式:计提和按日支付的方式
基金管理人管理费
基金管理人管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费率的计算方法如后:
 $R = 1.5\%$ = 当天费率
每日应计提的基金管理人费
前一日基金资产净值
管理费按日计提,累计计算至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人出具划款指令,基金托管人复核无误后,于次月月初 3 个工作日内从基金财产中支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。
基金托管人托管费
基金托管人托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费率的计算方法如后:
 $R = 0.25\%$ = 当天费率
每日应计提的基金托管费
前一日基金资产净值
托管费按日计提,累计计算至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人出具划款指令,基金托管人复核无误后于次月月初 3 个工作日内从基金财产中支付给基金管理人。
“基金费用列支”是指本《基金合同》第 3-8 条约定,根据有关规定及协议约定应,按支出列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
不列入基金费用
费用不列入基金费用
基金管理人及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
基金管理人及基金托管人及与基金运作无关于的事项发生的费用;
基金管理人及基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
基金合同生效前的相关费用;
其他根据法律法规及中国证监会的有关规定应予列入的费用。

[illegible]
