

# 投资组合报告

## 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	22,889,858.49	77.14
	其中：股票	22,889,858.49	77.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,719,353.32	22.65
8	其他资产	62,447.89	0.21
9	合计	29,671,659.70	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、渔业	753,289.00	2.55
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,923,386.43	50.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,143,320.16	3.87
E	建筑业	2,233,970.20	7.56
F	批发和零售业	1,986,044.00	6.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,849,848.70	6.26
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	-	-
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	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,889,858.49	77.48

### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

注：本基金投资范围未包括港股通投资股票，无相关投资政策。

### 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	600284	浦东建设	290,126	2,233,970.20	7.56
2	002918	蒙娜丽莎	140,979	1,650,864.09	5.59
3	002531	天顺风能	252,098	1,522,671.92	5.15
4	002139	拓邦股份	221,221	1,283,081.80	4.34
5	600267	海正药业	125,440	1,254,400.00	4.25
6	300274	阳光电源	131,516	1,229,674.60	4.16
7	002876	三利谱	43,078	1,147,597.92	3.88
8	600995	文山电力	142,204	1,143,320.16	3.87
9	600976	健民集团	67,600	1,114,724.00	3.77
10	300118	东方日升	101,225	1,030,470.50	3.49

### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	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）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金报告期内未参与股指期货投资。

#### 1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

### 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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

### 1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	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）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

### 1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

## 1.11 投资组合报告附注

### 1.11.1 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、处罚的情形。

本报告编制日前一年以内，本基金持有的“东方日升”的发行主体东方日升新能源股份有限公司于 2019 年 3 月 21 日收到中国证券监督管理委员会宁波证监局《关于对东方日升新能源股份有限公司采取责令改正措施的决定》。2018 年 12 月 20 日，公司披露《东方日升新能源股份有限公司关于支付现金购买江苏九九久科技有限公司 12.76%股权暨关联交易的公告》；公告披露，“九九久的经营情况较上年度大幅好转，前三季度实现净利润 1.0 亿元”；本次交易以北京华信众合资产评估有限公司出具的《评估报告》（华信众合评报字（2018）第 1102 号）的评估结果作为定价依据。经查，江苏九九久科技有限公司（以下简称九九久）1-11 月份经营业绩未达到上述《评估报告》中的预测值，同时九九久 2018 年度存在多次停、限产的情况并对经营业绩产生不利影响；上述情况均未在公告中予以披露。公司的上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条的相关规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九的相关规定，宁波证监局对公司采取责令改正的行政监管措施。本基金持有的“海正药业”的发行主体浙江海正药业股份有限公司于 2018 年 11 月 29 日收到上海证券交易所出具的纪律处分决定书《关于对浙江海正药业股份有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定》（〔2018〕67 号），公司因“未经决策擅自修改重要子公司合资合同的重要条款，且未及时披露”、“未按规定披露重大日常经营合同相关内容”和“隐瞒影响处置收益确认的回购权等合资合同重要条款”等违法违规行为，上海证券交易所对公司予以通报批评并记入上市公司诚信档案的纪律处分。

本基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

### 1.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于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	59,794.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,653.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,447.89

### 1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

### 1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。