

# 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	24,560,387.74	81.12
	其中：股票	24,560,387.74	81.12
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	5,353,902.07	17.68
8	其他资产	361,375.73	1.19
9	合计	30,275,665.54	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,347,542.78	61.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,566,879.96	11.88
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,056,460.00	3.52
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	403,655.00	1.34
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	1,185,850.00	3.95
S	综合	-	-
	合计	24,560,387.74	81.81

### 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：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	002407	多氟多	131,187	1,553,254.08	5.17
2	002594	比亚迪	28,190	1,429,796.80	4.76
3	601985	中国核电	248,553	1,381,954.68	4.60
4	300568	星源材质	57,000	1,313,850.00	4.38
5	002701	奥瑞金	257,200	1,201,124.00	4.00
6	300037	新宙邦	53,100	1,106,604.00	3.69
7	600733	北汽蓝谷	131,644	1,087,379.44	3.62
8	600886	国投电力	121,742	945,935.34	3.15
9	000591	太阳能	244,135	800,762.80	2.67
10	002074	国轩高科	60,216	789,431.76	2.63

### 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。

### 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。

### 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。

### 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：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 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：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货，无相关投资评价。

## 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“太阳能”的发行主体中节能太阳能股份有限公司于 2018 年 8 月 10 日收到中国证券监督管理委员会重庆监管局出具的行政监管措施决定书《关于对中节能太阳能股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，公司因“利用募集资金购买理财产品未及时披露”、“募集资金置换相关募投项目先期投入不及时”和“子公司镇江公司收入确认时点不恰当，年末应付账款及存货未进行暂估”等违法违规行为，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定，重庆监管局对公司予以警示，提醒公司切实加强募集资金管理和使用，严格按照企业会计准则规范财务核算工作，依法合规履行信息披露义务。公司于 2019 年 5 月 15 日收到中国证券监督管理委员会重庆证监局《关于对中节能太阳能股份有限公司的监管关注函》（渝证监函〔2019〕89 号），公司因“子公司违规对外担保”和“应收账款余额较大且增长较快”等违法违规行为，重庆监管局对公司提出“切实加强对子公司的管控”、“对违规担保事项发表书面意见”和“按季度向我局报送应收账款余额分析表”的监管要求。

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末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。

**1.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,882.67
2	应收证券清算款	148,194.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,253.47
5	应收申购款	198,045.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	361,375.73

**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。