

(上接B277版)

(2) 投资决策程序  
 基金管理人内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业及证券发行人等分析报告,为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。  
 基金管理人投资决策委员会定期和不定定期召开会议,根据本基金投资目标和市场的判断决定本计划的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。  
 在既定的投资目标与原则下,根据分析师基本面研究成果以及定量投资模型,由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

独立的交易执行:本基金管理人通过严格的交易制度和吹哨的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。  
 动态的组合管理:基金经理跟踪证券市场和证券发行人年的发展变化,结合本基金的现金流量情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态的调整,使之不断得到优化。

基金管理人风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控,并授权风险控制小组进行日常跟踪,出具风险评估报告。基金管理人监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

**九、基金业绩比较基准**  
 本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中债综合财富指数收益率×70%。  
 沪深300指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国市场中市值覆盖率最高、代表性最强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券,综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子,每日计算债券市场整体表现,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。  
 如果相关法律法规发生变化,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,经基金管理人与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

**十、基金的风险收益特征**  
 本基金为混合型债券投资证券投资基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票型基金。

**十一、基金投资组合报告**  
 基金管理人的董事会及董事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。  
 本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
 本报告投资组合数据截至2020年6月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	26,546,990.36	24.80
	其中:股票	26,546,990.36	24.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	78,173,488.18	73.03
	其中:债券	78,173,488.18	73.03
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	1,685,022.98	1.57
8	其他资产	642,829.42	0.60
9	合计	107,047,930.84	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	9,857,669.63	11.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,068,280.00	3.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	4,145,307.57	4.67
J	金融业	6,299,201.16	7.02
K	房地产业	3,236,132.00	3.64
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	医药、健康和现代服务业	-	-
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	26,546,990.36	29.80

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	002340	广电运通	59,200	4,133,210.00	4.65
2	000022	万科A	123,800	3,236,132.00	3.64
3	600090	长江电力	162,000	3,068,280.00	3.45
4	002541	鸿路钢构	99,000	2,894,760.00	3.26
5	600036	招商银行	74,791	2,521,952.52	2.84
6	300053	乐普医疗	51,200	1,869,824.00	2.11
7	000551	格力电器	30,700	1,736,099.00	1.96
8	600990	海尔智家	93,700	1,638,490.00	1.87
9	000001	平安银行	96,200	1,231,360.00	1.39
10	600838	浦发股份	66,200	1,130,536.00	1.30

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,971,101.50	57.39
	其中:政策性金融债	50,971,101.50	57.39
4	企业债券	5,060,500.00	5.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,087,200.00	4.60
7	可转换(可交换)债券	3,328,686.68	3.78
8	同业存单	9,726,000.00	10.95
9	其他	-	-
10	合计	78,173,488.18	88.01

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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190207	19国开07	400,000	40,468,000.00	45.56
2	180204	18国开04	100,000	10,562,000.00	11.82
3	111912111	19北京银行CD111	100,000	9,726,000.00	10.95
4	112007	19国开01	50,000	5,060,500.00	5.70
5	10180149	18中电国际MTN001	40,000	4,087,200.00	4.60

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  
 无。  
 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  
 无。  
 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  
 无。  
 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
 无。  
 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
 无。  
 11. 投资组合报告附注

(1) 声明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。

(a) 2020年2月3日,中国银保监会深圳监管局发布行政处罚信息公开表(深银保监罚决字(2020)17号),平安银行股份有限公司因汽车消费信贷和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失、“双录”管理审慎性不足、理财销售人员销售话术不当等11条违法违规事实,依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条,于2020年1月20日被处以罚款720万元。 本基金投资于“平安银行(000001)”的决策程序说明:基于对平安银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“平安银行”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(b) 报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无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。

(2) 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,361.35
2	应收证券清算款	25,452.74
3	应收利息	-
4	应收股利	613,015.33
5	应收中票利息	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	642,829.42

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

特此公告。

易方达基金管理有限公司  
 2020年8月29日

## 易方达国企改革指数分级证券投资 基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《易方达国企改革指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于基金不定期份额折算的相关规定,当易方达国企改革指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之B类基金份额(易方达国企改革B类份额,场内代码:502006)的基金份额净值大于1.5000元时,本基金将进行不定期份额折算。  
 截至2020年8月28日收市后,易方达国企改革B类份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值,提请投资者密切关注关注易方达国企改革B类基金份额净值的波动情况。  
 针对不定期份额折算可能带来的风险,基金管理人特别提示如下:  
 1、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》,本基金将在2020年底前完成规范整改,请投资者关注相关风险提示以及基金管理人届时发布的相关公告。  
 2、相较于易方达国企改革A类份额,本基金易方达国企改革A类份额(场内简称:国企改革A;场内代码:502003)为预期风险、收益相对较低的子份额。在因易方达国企改革A类份额的基金份额净值大于1.5000元而触发基金合同约定的不定期份额折算情形时,基金份额折算基准日折算前易方达国企改革A类份额超出1,000.00元部分将折算为易方达国企改革A类份额,即不定期份额折算前易方达国企改革A类份额超出1,000.00元部分将折算为易方达国企改革A类份额,即不定期份额折算前的易方达国企改革A类基金份额持有者在不定期份额折算后将持有易方达国企改革A类基金份额和易方达国企改革B类份额,因此,原易方达国企改革A类基金份额持有人所持持有基金份额的风险收益特征将发生一定的变化,由持有单一、较低的低风险收益特征份额变为同时持有较低低风险收益特征份额与较高高风险收益特征份额的情况。  
 3、相较于易方达国企改革A类份额,本基金易方达国企改革B类份额(场内简称:国企改革B;

星光农机股份有限公司  
 董 事 会  
 2020年8月29日

证券代码:603789 证券简称:星光农机 公告编号:2020-026

## 星光农机股份有限公司关于会计计提资产减值准备的公告

公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。  
 星光农机股份有限公司(以下简称“公司”)于2020年8月28日召开的第三届董事会第二十次会议和第三届监事会第十三次会议,审议通过了《关于计提资产减值准备的议案》,现将相关情况公告如下:

一、计提减值准备概述  
 根据《企业会计准则》以及公司财务管理制度的相关规定要求,为真实、准确的反映公司截至2020年6月30日的财务状况、资产价值及经营成果,基于谨慎性原则,公司依据相关政策要求,对公司的存货进行了全面检查和跌价测试。经测试,拟对公司截至2020年6月30日合并报表范围内的相关存货计提相应的跌价准备。  
 二、计提减值准备的具体情况说明  
 据公司的存货跌价准备计提的会计政策:存货采用成本与可变现净值孰低计量,按照单个存货成本高于可变现净值的差额计提存货跌价准备。今年上半年受疫情影响,企业2020年1-6月份整机的销售平均单价较2019年整机的销售平均单价下降明显,因此公司整机库存计提的存货跌价准备金额较大,对应增加了资产减值损失1,944.12万元。  
 本次计提上述资产减值准备1,944.12万元计入公司2020年1-6月损益,减少公司2020年1-6月净利润1,651.52万元,相应减少所有者权益1,651.52万元。公司本次计提的资产减值准备未

星光农机股份有限公司  
 董 事 会  
 2020年8月29日

证券代码:300094 证券简称:国联水产 公告编号:2020-102

## 湛江国联水产开发股份有限公司2020年半年度报告披露提示性公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
 尊敬的投资者:湛江国联水产开发股份有限公司《2020年半年度报告》及《2020年半年度报告摘要》已于2020年8月29日在中国证券监督管理委员会指定的创业板信息披露网站(巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn)上披露,敬请查阅。  
 特此公告。

湛江国联水产开发股份有限公司  
 董 事 会  
 2020年8月28日

证券代码:300006 证券简称:莱美药业 公告编号:2020-113

## 重庆莱美药业股份有限公司2020年半年度报告披露提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
 重庆莱美药业股份有限公司2020年半年度报告及摘要于2020年8月29日在中国证监会指定的创业板信息披露网站巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上披露,请投资者注意查阅。  
 特此公告。

重庆莱美药业股份有限公司  
 董 事 会  
 2020年8月28日

### 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	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112011	光大转债	2,483,086.20	2.80
2	132018	G3转债01	1,969,540.00	2.23
3	128048	张行转债	1,563,623.10	1.76
4	118033	苏银转债	959,635.20	1.08
5	120054	江南转债	867,972.00	0.98
6	132017	19南钢转债	205,232.00	0.23
7	113028	环债转债	60,613.00	0.07
8	118029	明润转债	43,498.00	0.05
9	110065	港汽转债	13,711.10	0.02
10	123029	英科转债	7,996.50	0.01

### 十二、基金业绩

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,投资有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。  
 (一) 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
2017年7月14日基金合同生效日至2017年12月31日	2.12%	0.14%	2.88%	0.21%	-0.76%	-0.07%
2018年	1.47%	0.18%	-2.71%	0.49%	4.17%	-0.26%
2019年	3.79%	0.23%	13.65%	0.36%	-9.85%	-0.13%
2020年1月1日至2020年6月30日	3.29%	0.42%	2.45%	0.43%	0.84%	-0.01%

(二) 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变动的比较

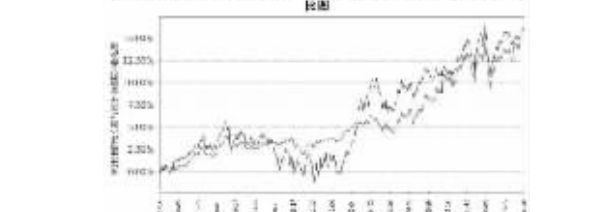


图:嘉实新添泽定期混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2017年7月14日至2020年6月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二)(二)投资范围和(四)投资限制)的有关规定。

### 十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用  
 1. 基金费用的种类  
 (1) 基金管理人的管理费;  
 (2) 基金托管人的托管费;  
 (3) 基金的销售服务费;  
 (4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;  
 (5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼或仲裁费;  
 (6) 基金份额持有人大会费用;  
 (7) 基金的证券、期货交易费用;  
 (8) 基金的银行汇划费用;  
 (9) 基金的开户费用、账户维护费用;  
 (10) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。  
 2. 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0.60%年费率计提,管理费的计算方法如下:  

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$
 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  
 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。  
 (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0.15%的年费率计提,托管费的计算方法如下:  

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$
 H为每日应计提的基金托管费  
 E为前一日的基金资产净值  
 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。  
 (3) 基金的销售服务费  
 本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率计提,计算方法如下:  

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$
 H为每日应计提的销售服务费  
 E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中划出,经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述“1、基金费用的种类中第(4)-(10)项费用”,根据有关法规及相应协议规定,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。  
 (二) 与基金销售有关的费用  
 1、本基金不收取认购费用。  
 本基金对基金份额收取赎回费,在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。  
 2、本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。本基金基金份额,对持续持有期少于30日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

本基金基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限(年)	赎回费率
7天<T<=30天	1.50%
30天<T<=1年	0.50%
T>1年	0%

基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。

3. 转换费用  
 本基金转换费用由转出基金赎回费用和基金申购补差费用构成:  
 (1) 通过代销机构办理基金转换业务(“前端转前端”)模式  
 转出基金有赎回费用的,收取该基金的赎回费用,从低申购费用基金向高申购费用基金转换时,每次收取申购补差费用;从高申购费用基金向低申购费用基金转换时,不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。  
 (2) 通过直销(直销柜台及网上直销)办理基金转换业务(“前端转后端”)模式  
 转出基金有赎回费用的,收取该基金的赎回费用,从0申购费用基金向非0申购费用基金转换时,每次按照非0申购费用基金申购费用收取申购补差费用,非0申购费用基金互转时,不收取申购补差费用。

通过网上直销办理转换业务的,转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

(3) 通过网上直销系统办理基金转换业务(“后端转后端”)模式  
 (a) 若转出基金有赎回费,则收取转出基金的赎回费;  
 (b) 若转出基金无赎回费,则不收取转换费用。

(4) 基金转换份额的计算  
 基金转换采取未知价法,以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下:  
 转出基金份额=转出份额×转出基金当日基金份额净值  
 转出基金赎回费用=转出基金金额×转出基金赎回费率  
 转出基金申购费用=(转出基金金额-转出基金赎回费用)×转出基金申购费率=(1+转出基金申购费率)×转出基金申购费用-(转出基金金额-转出基金赎回费用)×转出基金申购费率=(1+转入基金申购费率)×转入基金申购费用-(转入基金金额-转入基金赎回费用)×转入基金申购费率=(1+转入基金申购费率)×转入基金申购费用-转入基金申购费用

净转入金额=转出基金金额-转换费用  
 转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值  
 转出基金有赎回费用的,收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的约定。

注:嘉实稳健、嘉实债券、嘉实新兴产业、嘉实快线货币、嘉实新消费股票、嘉实智能汽车股票、嘉实新趋势混合、嘉实祥瑞纯债债券、嘉实纯债债券、嘉实增长混合、嘉实中华纯债债券、嘉实致盈债券、嘉实中短债债券、嘉实中债债券、嘉实汇中中短债债券、嘉实汇中中短债债券、嘉实安心货币、嘉实超短债债券、嘉实价值优势混合、嘉实信用债券、嘉实信用债券、嘉实安心货币A、嘉实安心货币、嘉实纯债债券、嘉实纯债债券、嘉实货币B、嘉实中短期企业债指数(LOF)、嘉实中短期企业债指数(LOF)、嘉实中短期企业债指数(LOF)、嘉实中短期企业债指数(LOF)、嘉实中短期企业债指数(LOF)暂停申购和转入业务,具体请见嘉实基金网站刊载的相关公告,定期开放类基金在封闭期内无法转换。

4. 基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5. 基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。  
 (三) 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的有关规定不得列入基金费用的项目。

### (四) 基金税收

本基金支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格,具体税率适用中国税务主管机关的规定。  
 本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家法律法规、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对《基金合同》进行了更新,主要更新内容如下: