#### (上接 B145 版) 联系人:张萌 联系电话:18600730680

联系电话:18000/30080 客服电话:400-6997-719 网址: www.xiquefund.com 82.中证金牛(北京)投资咨询有限公司 住所:北京市市全白东管头1号2号楼2-45室 办公地址:北京市西域区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层 头台位表:1 640目第

客服电话:4008-909-998

客服电话:4008—909—908 例址:www.jnlc.com 83. 玄元保險代理有限公司 住所:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室 法定代表人,马水道 联系人,产业博 电话:137—5252—8013 客服电话:400—080—8208 网址:www.lcaimofang.cn 84. 和耕传承基金销售有限公司 住所:河南自贺试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼5楼503 办公地址:河南自贺试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼5楼

法定代表人.温丽燕 联系人.胡静华 联系人.胡静华 联系电话:18638787099 客服电话:4000555671 网址:www.hgccpb.com 85.大秦金石基金销售有限公司 住所:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室 办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼 接至人·秦颜海

联系人:朱海涛 联系电话:021-20324158 传真:021-20324199

传真。021-20324199 客服电话:000-928-2266 网址:www.dtfunds.com 86. 泰诚财富基金销售(大连)有限公司 住所:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号 联系人:徐江

电话:18840800358 客服电话:400-0411-001 网批:www.hapiyoujijin.com 注:为绑护投资者利益,本公司已暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司、 大泰金石基金销售有限公司办理本公司旅下基金的认购,申购。定期定额投资及 转换等业务,已通过泰诚财富基金销售有限 公司购买本公司基金的投资者,当前持有基金份额的赎回业务看不受影响。

1985天平次司金金亚加及百年,目前行有金亚比 (三)登记机构 名称:东方基金管理股份有限公司 住所:北京市西城区辖什坊街28号1-4层 办公地址:北京市西城区辖什坊街28号3层 法定代表人:诸向释 联系人:肖向释

电话:010-66273671 传真:010-66578680 电话。1010-66578680
网址,www.orient-fund.com或www.df5888.com
(四)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
名称:上海市最城中路68号时代金融中心19楼
负责人。和卫锋
联系人、黎明
电话。021-31358666
传真。021-31358666
传真。021-31358666
传真。021-31358666
传真。101-31358666

六、基金投资目标和投资方向

一)投资目标 :严控风险的前提下,结合灵活的资产配置和多种投资策略,充分把握市场 力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

机会,力争获得超越业绩比较基准的投资凹版。
(二)投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的
股票(包括中小板,创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)(债券(含中小
企业私募债券,证券公司短期公司债券),货而市场工具,权证、资产支持证券以
及法律注期或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会
相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在
租关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资,他品种,基金管理人在
银行适当程序后,可以将其纳人投资范围。
基金的投资组合比例为、股票资产占基金资产的比例为%%,投资于权证
比例不超过基金资产净值的3%、本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不
得超过本基金资产净值的10%、本基金每个交易日日终在和除股指期货合约需缴
纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金
资产净值的3%、其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
七、基金的投资策略

亿.基本的权负束的 本基金通过对类别资产的灵活配置,调整不同时期内基金的整体风险与收益 并结合多种投资策略精选具有较高投资价值的股票和债券,获得基金的长

水平,并结合多种投資乘略有选具有较高投資价值的股票和喷穿,获得基金的长期稳定增值。
1、类别资产的配置上,本基金结合宏观经济因素,市场估值因素,政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平,进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动宏调整。
(1)宏观经济因素。主要分析对证券市场的基本面产生普遍影响的宏观经济指标。包括:GDP增长率、工业增加值、CPL,PPD水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、机1.极近极其增加量等;
(2)市场估值因素。包含纵向比较股票市场的整体估值水平、横向比较股票、债券之间的相对收益水平、上市公司盈利水平及其盈利预期,市场资金供求关系变化等;
(3)政策因素,研究与证券市场紧密相关的各种宏观调控政策,包括产业发展政策,区域发展政策,货币政策、财政政策,房地产调路政策等;
(4)市场情绪因素,包含新开户数、股票换手率、市场成交量、开放式基金股票持仓比例变化等。

综合上述因素的分析结果,本基金给出股票、债券和货币市场工具等资产的

配直比例开头可近行调整。 2.股票投资策略 本基金灵活运用多种投资策略,多维度分析股票的投资价值,充分挖掘市场

本基金观古运用多种投资策略,多维度分析股票的投资价值,充分挖掘市场中潜在的投资机会,实现基金的投资目标。 (1)行业配置策略 重点行业资产配置。本基金通过对国家宏观经济运行,产业结构调整,行业自 身生命周期,对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展 的根本性因素进行分析,从行业对上述因素变化的敏感程度和受益程度人手,筛 选处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重 点行业资产进行配置。

远处于稳定的平长别及胰自穿和预别此个稳定的平长别友限自穿的行业作为量 点行业资产进行配置。 本基金通过对经济运行周期,行业竞争态势以及国家产业政策调整等影响行业级 期运行情况的因素进行分析和研究,筛选具有短期重点发展趋势的行业资产进行 配置,并依据上述因素的短期变化对行业配置权重进行动态调整。

①价值投资策略 价值投资策略是通过寻找价值被低估的股票进行投资,以谋求估值反转带来 的收益。通过运用多项指标如PE、PB、EV/EBITDA等进行相对估值。通过与国内同 行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较,找出

行业县 公司记值水平以及国外问行业公司相对的值水平等进门门值比较、找出价值被相对依估的公司。
②趋势投资策略
公司的参营业绩成长和公司投资价值的提升具有连续性和延展性,这决定了公司股票价格的长期趋势。同时,在股票市场上。由于受到当期各种外部因素的影响,股票价格的长期趋势。同时,在股票市场上。由于受到当期各种外部因素的影响,股票价格。及具有中、短期趋势。中期趋势表现为股价相对长期趋势的估值偏离相位值的是是,由于市场反应不足或反应过度,股票价格的涨跌往往表现出一定的惯性。因起,可通过基本面分析,行分金融分析事件分析。利用股价中、短期趋势的动态特征,进行股票的买人和卖出操作,从而提高单只股票的投资收益。
④主题投资策略
在我国经济分发融进合种。学分结构的调整和优化是一个长周期和多层次的过程。未基金通过对国内经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势研究、对影响经济发展过程中,经济结构的调整和优化是一个长周期和多层次的过程。本基金通过对国内经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势研究、对影中经济发展过程中,经济结构的调整和优化是一个长周期和多层次的过程。本基金递过对国内经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势研究、对影中经济发展进程中和阶段性生期投资机会,精选出与符合投资主题的行业和具有核心竞争力的上市公司,为争获取市场超额做在、实现基金资产的长期稳定增值。
④成长投资策略
本基金地将关注成长型上市公司,重点关注中小市值股票(包括中小企业板和创业板股票)中具有替在高成长性和稳健盈利模式的上市公司,在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上,本基金将适度最高成长精选股票的风险水平,对公司特质分析等基本面定性分析的基础上、采用时间序列分析和截面数据分析评价上市公司的盈利能力及其变化路径和公司盈利能力在产业内乃至整个市场所处的目对位置,评估风格、精选投资标的。
3、债券符及资策略
(1)人期调整的基础上,本基金将延长所持有的债券经合的人期值,从到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平平降低时,本基金将延长所持有的债券组合的人期值,从市可以在市场利率实际下降时获得债务价格上所产生的资本和得。反之、当初期市场总体利率水平下降时,增缩短组合人期,以避免债券价格下降带来的资本损失,表得较高的再投资收益。
(2)期限的基金的基础上,本基金将通过对债券市场收益率和水平上升时,则增加度的基础上,本基金将延行债券市场收益率的上升时,则增短组备合人期,以避免债券价格下降带来的资本损失,表得较高的再投资收益。

(2)期限结构策略 在目标久期确定的基础上,本基金将通过对债券市场收益率曲线形状变化的

在目标/人期确定的基础上、本基金将通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期,调整组合的期限结构策略,适当的采取于净策略。哑铃策略、挑式策略等、在短期、中期、长期债券向进行配置,以从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。当预期收益率曲线变平时,采取哑铃策略、当预期收益率曲线变平时,采取哑铃策略,当预期收益率曲线变平时,采取破铃策略,当预期收益率曲线交重平行移动时,采取梯形策略。(3)美属资产配置策略 根据资产的发行主体、风险来源,收益率水平,市场流动性等因素,本基金将市场主要细分分一般债券。合国债,央行票据。政策性金融债券),信用债券(含公司债券。企业债券、丰政策性金融债券、短期融资券、地方政府债券、资产支持证券等),附权债券等。一个子市场。在大类资产配置的基础上、本基金将通过对国内外安观经济状况。市场利率走势,市场资金供求状况。信用风险状况等因素进行综合分析,在目标八期控制及期限结构配置基础上,采取积极投资策略,确定类属资产的最优配置比例。

所、在目标人期控制及期限结构配置基础上、采取积极技资策略、确定类属资产的最优配置比例。
①一般情券投资策略
在目标人期控制及期限结构配置基础上、对于国债、中央银行票据、政策性金融信本起生实通过跨市场套和等策略获取套利收益。同时,由于国债及央行票据具有良好的流动性、能够为基金的流动性提供支持。
②信用债券投资策略
(古居於人期控制及期限结构配置基础上、对于国债、中央银行票据、政策性金融信本基金主要通过的市场套和等策略获取套利收益。同时,由于国债及央行票据具有良好的流动性、能够为基金的流动性提供支持。
②信用债券投资策略
(信用评估策略:信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司观金流分析、公司资产负债分析、公司观金流分析、公司资产负债分析、公司观金流分析、公司资产负债分析、公司观金流分析、公司运管弯步分析等调查研究分析主约的定即合理的信用利差水平,对信用债券进行独立、客观的价值评估。
回购策略、回购放大策略的实验图表有两个,其一是利差,即回应资金成本与债券收益率和关键的的直接条件。其一是利差,即回应外金成金。在收金,成本利得,所持债券的净价在放大操作期间出现上涨、则可以获取价至效金。在收益率由线接通或预期利率下行的市场情况、在的范流动性风险的基础上,适当运用回购放大策略,可以为基金持有人争取更多的收益。《路收债券投资金。在收益率由线接通或预期利率下行的市场情况、在的范流动性风险的基础上,适当运用回购放大策略,可以为基金持有人争取更多的收益。《郑收债券投资金。在经济价模型等优估值工具评定其投资价值。重视对可转换债券的投资价值。对对对处,是不是不可以及资度整本数据。运用规以调整利度(OAS)模型的并依疑问或值售资料以资价值,作为此类债券的债券的投资价值,作为此类债券投资的主要依据。

的目別收益。 5、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把 市场交易机会参取极策略、在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用 究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得 物质

研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行按贷,以期获得长期稳定收益。 6、中小企业私募债券投资策略 在控制信用风险的基础上,本基金对中小企业私募债投资,主要通过期限和品种的分散投资控制流动性风险。以买人持有到期为主要策略,审慎投资。 针对内嵌转般选择权的中小企业私募债,本基金通过深人的基本面分析及定性定量研究,自下而上精选个债,在控制风险的前提下,谋求内嵌转股权潜在的增 程度长

强收益。 基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制订严格的投资 基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制订严格的投资 决策流程、风险控制制度和信用风险,流动性风险处置预案,并经董事会批准,以 防范信用风险,流动性风险等各种风险。 7、证券公司短期公司债券投资策略 本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等 调查研究,分析证券公司短期公司债券的连约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立。客观的价值评估。 基金投资证券公司短期公司债券。基金管理人将根据审慎原则,制定严格的 投资决策流程、风险控制制度,并经董事会批准,以防范信用风险,流动性风险等 各种风险。

\* 8.0.14 例以及汉柬哈 本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采 用流动性好,交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究, 结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多

行套期保值操作 本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中债总指数收益率×

带责任。 基金托管人根据本基金合同规定,已复核了本投资组合报告中的财务指标、 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 者重大遗漏。 本投资组合报告所载数据截至2020年3月31日(财务数据未经审计)。

序号	项目	金額 (元)	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	86,133,914.13	35.4
	其中:股票	86,133,914.13	35.4
2	基金投资	-	
3	固定收益投资	120,976,059.00	49.7:
	其中:债券	120,976,059.00	49.7
	资产支持证券	-	
4	贵金属投资	-	
5	金融衍生品投资	-	
6	买人返售金融资产	-	
	其中: 买断式回购的买人返 金融资产	告 _	
7	银行存款和结算备付金合计	33,779,381.63	13.8
8	其他资产	2,288,859.65	0.9
9	合计	243,178,214.41	100.0
2、打	<b>设告期末按行业分类的股</b>	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	-	
В	采矿业	20,539,000.00	8.5
C	制造业	13,502,895.50	5.5
D	电力、热力、燃气及水生产 和供应业	11,550,207.78	4.7
E	建筑业	-	
F	批发和零售业	867,547.31	0.3
G	交通运输、仓储和邮政业	6,605,235.60	2.7
Н	住宿和餐饮业	1,076,000.00	0.4
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	162,020.16	0.0
J	金融业	27,110,900.00	11.2
K	房地产业	3,334,500.00	1.3
L	租赁和商务服务业	-	
M	科学研究和技术服务业	149,607.78	0.0
N	水利、环境和公共设施管理 业	1,236,000.00	0.5
0	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	86,133,914.13	35.6

序号	股票代码	股票名称	数量 (数)	公允的值(元)		值比例(%)	
1	601398	工商银行	2,770,000	14,265,500.00		5.91	
2	600028	中国石化	2,700,000	11,961,000.00		4.96	
3	601088	中国神华	400,000	400,000 6,496,000.00		2.69	
4	601816	京沪高铁	906,536	5,3	303,235.60	2.20	
5	601166	兴业银行	300,000	4,	773,000.00	1.98	
6	600674	川投能源	450,000	4,	140,000.00	1.72	
7	600900	长江电力	200,000	3,458,000.00		1.43	
8	000002	万 科A	130,000	3,334,500.00		1.38	
9	601336	新华保险	80,000	3,184,000.00		1.32	
10	600519	贵州茅台	2,000	2,222,000.00		0.92	
4、报	告期末按债	券品种分割	类的债券投资组	l合			
序号	债券品种		公允价值	公允价值 (元)		产净值比例(%)	
1	国家债券		1	10,018,000.00		4.15	
2	央行票据			-		-	
3	金融债券		6	61,424,459.00		25.45	
	其中:政策性金	金融债	5	53,582,059.00		22.20	
4	企业债券		3	39,557,600.00		16.39	
5	企业短期融资	券		-		-	
6	中期票据			-		-	

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的

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(%)
1	018008	国开1802	150,000	15,702,000.00	6.50
2	136253	16中油03	140,000	14,092,400.00	5.84
3	018007	国开1801	135,000	13,601,250.00	5.63
4	108604	国开1805	120,000	12,258,000.00	5.08
5	108602	国开1704	120,100	12,020,809.00	4.98
	Let Ale Her de Lebe A	1 /2 // /+- 14+	+ 1 2/20 -20-20 1	+11.121   116-2-26-26	1 /4 //w ->r -L-L+-

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 × 50:00:00 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 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

""本基金本报告期末未持有贵金属。 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

本基金本报告期末未持有权证。
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
11.投资组合报告附注。
(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明
本基金所持有的工商银行(601398),其浙江分行等多个分支机构被中国银行业监督管理委员会浙江监管局等地方监管机构处以多起罚款。主要违法违规事实涉及信贷违规,销售违规等。以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。本基金所持有的处业银行(601166),其昆明分行等多个分支机构被中国银行业监督管理委员会云南监管局等地方监管机构处以多起罚款。主要违法违规事实涉及信贷违规,销售违规等。以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。本基金所持有的新华保险(601336),其北京分公司等多个分支机构被中国保险业监管理委员会工实监管局等地方监管机构处以多起罚款。主要违法违规事实涉及销售误导等。以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。本基金决策依据及投资程序:
以于第项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。本基金决策依据及投资程序:
以所究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究、形成有关的各类报告、为本基金的投资管理提供决策依据。
②投资决策委员会定期召开会议、讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。
③基金经理根据投资决策委员会的决议。参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金经设计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控

和。本基金投资工商银行主要基于以下原因:公司是国内四大国有银行之一,业务结构稳健,PB估值便宜且股息率高,具备配置价值。本基金投资兴业银行主要基于以下原因:公司是国内重要股份制银行之一,业务特点鲜明,PB估值便宜且股息率高,具备配置价值。

驱为疗点料明,P的白鼠便且且放息率尚,具命配百价值。 本基金投资新华保险主要基于以下原因、公司估值处于历史低位,后续有望 在规模和价值并重的战略调整下,依靠做大做强销售队伍,推动新单保费和价值 情感更观虑步修复。 除上述情况外, 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在 被监管部门立案调查,或在报告编制目而一年内受到公开谴责,处罚的情况。 (2)本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库

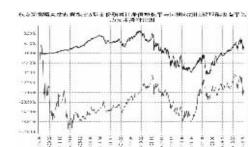
2 应收证券清算款 2,165,006.99 45,810.20 7 待摊费用

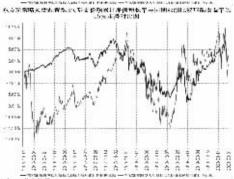
2.288.859.65 (4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细本基金本报告期末未持有可转换债券。 (5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 股票名称 股票代码

十一、基金的业绩 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应仔细阅读本基金的招募说明书。 1.基金的净值表现 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 左方新等账是还是智源令A

	71/77/09/1	NEMDY	(HILLEIN)	- 11		
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 收益率 标准差	1)-3)	2-4
2015.05.26-2015.12.31	1.54%	0.04%	-17.82%	1.95%	19.36%	-1.91%
2016.01.01-2016.12.31	3.15%	0.10%	-8.07%	0.98%	11.22%	-0.88%
2017.01.01-2017.12.31	0.37%	0.25%	13.42%	0.45%	-13.05%	-0.20%
2018.01.01-2018.12.31	-12.20%	0.68%	-16.59%	0.93%	4.39%	-0.25%
2019.01.01-2019.12.31	12.04%	0.53%	24.99%	0.86%	-12.95%	-0.33%
2020.01.01-2020.03.31	-1.12%	0.60%	-6.16%	1.34%	5.04%	-0.74%
	东方新	策略灵	活配置混	合C		
		NAT CHAIL	M 11 641 1 4	业绩比		

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 收益率 标准差	①-③	2-4
2015.11.13-2015.12.31	1.52%	0.16%	-0.52%	1.12%	2.04%	-0.96%
2016.01.01-2016.12.31	2.68%	0.10%	-8.07%	0.98%	10.75%	-0.88%
2017.01.01-2017.12.31	0.79%	0.25%	13.42%	0.45%	-12.63%	-0.20%
2018.01.01-2018.12.31	-10.04%	0.68%	-16.59%	0.93%	6.55%	-0.25%
2019.01.01-2019.12.31	11.83%	0.53%	24.99%	0.86%	-13.16%	-0.33%
2020.01.01-2020.03.31	-1.19%	0.60%	-6.16%	1.34%	4.97%	-0.74%
2、本基金累计净值增	长率与业	<b>绩比较</b>	基准收益率	<b>率的历史</b>	走势对比	图





十二、费用概览

2.基金打官人明允官款; 3.C类基金份额的销售服务费; 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费、律师费和诉讼费; 6.基金的额待有人大会费用; 7.基金的证券,期货交易费用; 8.基金的银行汇划费用; 9.基金的账户开户费用,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。 (二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。 (三)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 本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的 计量方法加元

各项费用。 上述"一、基金费用的种类中第4至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人当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。 (四)不列人基金费用的项目 下列费用不列人基金费用。 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

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人基金费用的项

(五)基金税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执

十三、对招募说明书更新部分的说明 十三、对招募说明书更新部分的说明 本招款说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销 售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基 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 及其他有关规定以及《东方新策略克活查管置拾仓型证券投资基金基合同》及 及其他有关注律法期的要求、结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了 再充工型的交加、

.主要内容如下: (一)本公司改制为股份有限公司,名称变更为"东方基金管理股份有限公

[二]。
(二)在"第三部分基金管理人"部分,更新了基金管理人的相关内容。上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录东方基金管理股份有限公司网站www.orient-fund.com。

#### 证券代码:601066 证券简称:中信建投 公告编号:临2020-098号

# 中信建投证券股份有限公司 部分首次公开发行A股股票限售股上市流通公告

本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。 重要内容提示

▲ 木次限售股上市流通数量为150 624 815股 ● 本次限售股上市流通日期为2020年9月1日

、本次限售股上市类型 的批复》ௌ监许可 2018 828号 )批准,中信建投 以下简称"公司")向社会公众首次公开发行人民币普通股 (A股)400,000,000 股,每股发行价格为人民币5.42元。公司首次公开发行的人民币普通股于2018年 6月20日在上海证券交易所上市,股票简称 中信建投",股票代码601066.SH。首 欠公开发行完成后,公司股本变更为7,646,385,238股,其中5,985,361,476股 为限售股,占公司总股本的78.28%。根据《上海证券交易所股票上市规则》相关 规定,上述5,985,361,476股限售股中,上海商言投资中心(有限合伙)似下简称"上海商言")所持有的150,624,815股限售股的锁定期根据公司A股股票上市 之日起满12个月及持股日起满48个月孰长原则确定,据此,上述股份将于2020

、本次限售股形成后至今公司股本及限售股股东变化情况

自2018年6月20日公司首次公开发行A股股票以来,公司未发生因利润分 配、公积金转增等导致股本数量变化的情况。公司首次公开发行完成后,公司总 股本变更为7,646,385,238股,其中5,985,361,476股为限售股,占公司总股本 的78.28%。其中,中信证券股份有限公司和世纪金源投资集团有限公司所持有 的合计464,375,185股限售股已于2019年6月20日起上市流通。西藏腾云投资管 理有限公司所持有的300,000,000股限售股已于2020年7月20日起上市流通。本 次解除限售前,公司限售股为5,220,986,291股,占公司总股本的68.29%。本次 申请解除限售的上海商言所持有的150,624,815股限售股的锁定期根据公司A 股上市之日起满12个月及持股日起满48个月孰长原则确定,上述股份将于2020

三、本次限售股上市流通的有关承诺及承诺履行情况

年9月1日起上市流通。

(一)本次限售股上市流通的有关承诺 在公司首次公开发行A股股票前,上海商言所持股份的流通限制和自愿锁 定股份的承诺如下:

上海商言承诺自持股日起48个月内不转让所持公司股份。自公司A股股票 在证券交易所上市交易之日起12个月内,不转让或者委托他人管理其在公司首次公开发行A股股票前已持有的股份,也不由公司回购该部分股份;承诺将严格 遵守《公司法》、《征券法》、证券交易所《投票上市规则》、中国证监会审慎性监管 的相关要求及《证券公司行政许可审核工作指引第10号——证券公司增资扩股 和股权变更》等法律法规及政策规定,根据孰长原则确定持股期限;上述法律法 规及政策规定未来发生变化的,其承诺将严格按照变化后的要求确定持股期

(二)有关承诺履行情况 截至公告日,上海商言严格履行了其做出的上述承诺,不存在相关承诺未 履行从而影响本次限售股上市流通的情况。

四、中介机构核查意见 持续督导机构长城证券股份有限公司和中国银河证券股份有限公司经核

公司本次限售股份上市流通申请的股份数量、上市流通时间符合《公司 法》、《证券法》、《证券发行上市保荐业务管理办法》、《上海证券交易所股票上市 规则》及《上海证券交易所上市公司持续督导工作指引》等相关法律法规的要 经中国证券监督管理委员会《关于核准中信建投证券股份有限公司首次公 求,公司限售股份持有人严格履行了发行前所做出的承诺。公司关于本次限售 息披露真实、准确、完整。持续督导机构对公司本次限售股

上市流通申请无异议。 五、本次限售股上市流通情况

(一)本次限售股上市流通数量为150,624,815股 仁)本次限售股上市流通日期为2020年9月1日

$\subseteq$	三 )股份解除限售及	<b>と上市流通具体</b>	は情况		
序号	股东名称	持有限售股 数量 (股)	持有限售股占 公司总股本比例 %)	本次上市 流通数量 段)	剰余限售股 数量 (投)
1	北京国有资本经营管理中 心	2,684,309,017	35.11	0	2,684,309,017
2	中央汇金投资有限责任公 司	2,386,052,459	31.21	0	2,386,052,459
3	上海商言投资中心 有限	150 624 815	1.07	150 624 815	0

5,220,986,291 150,624,815 68.29 5,070,361,476 本次申请解除股份限售的股东实际减持股份时除需遵守首次公开发行时 做出的减持相关承诺外,还需遵守《公司法》、《正券法》、《上海证券交易所股票 上市规则》、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《上海证券交易所 上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等相关规定。 木/水椒/冬周佳职/4/1上市法通前后职术亦动结构事

4	60 3Rd	本次上市前		变动数(股)	本次上市后	
类型		数量(股)	比例	受為(致) (以)	数量 段)	比例
	国家持股	2,386,052,459	31.21%	0	2,386,052,459	31.21%
有限售条件	国有法人持股	2,684,309,017	35.11%	0	2,684,309,017	35.11%
股份	其他内资持股	150,624,815	1.97%	-150,624,815	0	0
	有限售条件的 流通股份合计	5,220,986,291	68.29%	-150,624,815	5,070,361,476	66.32%
	A股	1,164,375,185	15.22%	+150,624,815	1,315,000,000	17.19%
无限售条件	H股	1,261,023,762	16.49%	0	1,261,023,762	16.49%
的流通股份	无限售条件的 流通股份合计	2,425,398,947	31.71%	+150,624,815	2,576,023,762	33.68%
股份	分总额	7,646,385,238	100.00%	0	7,646,385,238	100.00%

注:上表尾差系由四舍五人造成。

特此公告。

七、上网公告附件 长城证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司《关于中信建投证券 股份有限公司首次公开发行A股股票限售股份上市流通的核查意见》

> 中信建投证券股份有限公司 2020年8月24日

### 诺安基金管理有限公司关于诺安研究精选股票 增加昆仑银行为代销机构并开通定投、转换业务的公告

根据诺安基金管理有限公司《以下简称 本公司")与昆仑银行股份有限公司《八下简称 昆仑银行")签署的基金销售代理协议,自2020年8月25日起,本公 司新增昆仑银行为旗下部分基金的代销机构。具体适用基金如下:

自2020年8月25日起,投资者可在昆仑银行办理上述基金的开户、申购、赎

回等业务,进行相关信息查询并享受相应的售后服务。具体办理程序请遵循代

销机构的规定。 本公司将同时在昆仑银行开通上述基金的定投、转换业务,具体如下:

基金名称

1、基金定投业务 自2020年8月25日起,投资者可在昆仑银行办理本公司上述基金的定投业

目前,投资者在昆仑银行申请办理基金定投业务,每期最低申购金额为人 民币200元 含)。如有变动,请以昆仑银行规定为准。

基金定投业务的申购费率同正常申购费率。

自2020年8月25日起,投资者可在昆仑银行办理本公司上述基金与本公司

本公司已刊登的各基金办理转换业务的相关公告。

1、投资者在昆仑银行办理相关业务应遵循昆仑银行的具体规定。

2、本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责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预示其未来表现。基 金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。投资者投资 于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、托管协议、招募说明书等文件及

3、本公告的有关内容在法律法规允许范围内由本公司负责解释。 投资者可以通讨以下途径咨询有关情况:

客户服务电话:95379

网址:www.klb.cn 2.诺安基金管理有限公司 客户服务电话:400-888-8998

二〇二〇年八月二十五日

#### 证券代码:000732 证券简称:泰禾集团 泰禾集团股份有限公司

## 关于 "18泰禾02"未按期兑付本息的公告 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。 1、受地产整体环境下行、新冠肺炎疫情等叠加因素的影响,公司现有项目 的去化率短期内有所下降,销售预期存在波动,同时由于公司自身债务规模庞大、融资成本高企、债务集中到付等问题使得公司短期流动性出现困难,公司未

能完成公司债券 18泰禾02"本息的兑付。 资合同及相关文件项下的债务交叉违约,如在协议约定的补救期内未消除,可 能引发债权人要求提前偿还债务

3、公司存在大额已到期未归还借款、根据公司《020年半年度报告》所述、

截至2020年8月15日,公司已到期未归还借款金额为349亿元,尚未支付的利息 为43.32亿元。公司因子公司未履行还款义务而被列为被执行人,相关事项可能 导致公司持续经营能力存在重大不确定性,提醒广大投资者注意风险。 4、2020年7月30日,公司控股股东泰禾投资、公司实际控制人黄其森先生与 海南万益签署了《股份转让框架协议》,泰禾投资拟将其持有公司的19.9%股份

转让给海南万益,公司认为该股份转让事项将有助于推动公司目前进行的债务

重组工作,但最终能否达成取决于相关先决条件能否满足,存在不确定性,敬请 大投资者注意投资风险(详见公司2020-067号公告)。 泰禾集团股份有限公司 以下简称 公司"2018年非公开发行公司债券 第二期)以下简称 18泰禾02"或 本期债券",债券代码:114373 )应于2021年9月 19日进行到期兑付,因公司存在债务违约事项,本期债券2020年第一次债券持有人会议表决通过了关于加速清偿的议案,根据表决结果,18泰禾02"加速到

期至2020年8月24日进行本息的兑付,相关事宜具体情况如下:

、本期债券的基本情况 1、发行人,泰禾集团股份有限公司 2、债券名称:泰禾集团股份有限公司2018年非公开发行公司债券 第二期)

3、债券简称:18泰禾02 4、债券代码:114373 5、发行规模, 人民币15亿元

择权 8、兑付日:2021年9月19日

6、债券期限:3年,第2年末附发行人调整票面利率选择权和投资者回售选

9、实际到期兑付日:2020年8月24日 根据本期债券2020年第一次持有人会 义表决结果,加速到期至2020年8月24日进行兑付)

10、本息应兑付金额:人民币16.125亿元 、兑付情况及后续工作安排

受地产整体环境下行、新冠肺炎疫情等叠加因素的影响,公司现有项目的 去化率短期内有所下降、销售预期存在波动,同时由于公司自身债务规模庞大、融资成本高企、债务集中到付等问题使得公司短期流动性出现困难,公司未能 完成公司债券 18泰禾02"本息的兑付。 仁)后续工作安排

含当日 起不再接受认购申请。

1、与持有人保持沟通,积极协商解决办法。 公司将积极与持有人沟通,了解持有人诉求,协商解决办法。公司将按照 傣禾集团股份有限公司2018年非公开发行公司债券(第二期)募集说明书》、 傣禾集团股份有限公司2018年非公开发行公司债券之债券持有人会议规则》 等相关规定适时召集债券持有人会议,以期尽快达成债权人认可的解决方案、 维护持有人利益

公司的后续债务重组方案需要得到债权人的参与和支持,因此公司鼓励债 5公司、主承销商进行联系,形成有效沟通机制,本期债券各方主体联系方 式详见下文"仨)本期债券各方主体联系方式"。

新疆前海联合淳主纯债87个月定期开放债券型证券投资基金 以下简称

疆前海联合淳丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、新疆前

海联合淳丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》和 舒疆前海联合淳丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》等文件的相关规定,本基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司经与本基金托管

、上海浦东发展银行股份有限公司协商一致,决定提前结束本基金的募集。募

集截止日由原定的2020年11月16日提前至2020年8月24日,即自2020年8月25日

金已于2020年8月17日开始募集,原定募集截止日为2020年11月16日。

2、综合各方意见,尽快形成解决方案。

为积极稳妥化解公司债务风险,公司已聘请专业机构开展债务重组工作,协助公司组织、协调债权人沟通意见和诉求,并就缓解短期债务偿还压力、优化资本结构提供专业意见。公司将综合各方意见形成全面债务重组解决方案,实 现公司长远价值,以最大程度保证债权人的利益。 3、通过优化股权结构,推动债务重组工作进程。 2020年7月30日,公司控股股东泰禾投资集团有限公司 以下简称 泰禾投 )、公司实际控制人黄其森先生与海南万益管理服务有限公司(以下行

南万益")签署了《股份转让框架协议》,泰禾投资拟将其持有公司的19.9%股份

转让给海南万益 详见公司2020-067号公告)。海南万益为万科企业股份有限公司 以下简称 万科",股票代码:000002.SZ)的全资子公司,截至2019年12月31

日,万科总资产为17,299.29亿元,归母净资产为1,880.58亿元,万科2019年度营 业收入为3,678.94亿元,归母净利润为388.72亿元。 公司控股股东此次股份转让框架协议中设置了股份转让的先决条件:需要公司制定债务重组方案并与债权人达成一致,债务重组方案能支持公司恢复正 常经营,能支持公司可持续经营,并且该债务重组方案的上述作用能得到泰利

投资和海南万益的一致认可。 公司认为,公司控股股东此次股份转让框架协议的签署,将有助于推动公司目前进行的债务重组工作,盘活存量资产,维持正常经营,同时有助于优化公 司股权结构,帮助公司不断完善公司治理,从而帮助实现公司长远价值,维护公

1、发行人:泰禾集团股份有限公司

4、按照要求,持续做好信息披露。 公司将按照相关要求,履行后续信息披露义务,持续披露进展情况。 仨)本期债券各方主体联系方式

联系人,陈佳旭 联系电话:010-85175560-5784 2、主承销商:中国国际金融股份有限公司

联系人:张俊杰 联系电话:010-65051166-7702 3、托管机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 联系电话:0755-21899325

1、公司债券未能按期兑付事项,可能带来公司及公司子公司签署的相关融 资合同及相关文件项下的债务交叉违约,如在协议约定的补救期内未消除,可 能引发债权人要求提前偿还债务 2、公司存在大额已到期未归还借款,根据公司《020年半年度报告》所述 截至2020年8月15日,公司已到期未归还借款金额为349亿元,尚未支付的利息

为43.32亿元。公司因子公司未履行还款义务而被列为被执行人,相关事项可能 导致公司持续经营能力存在重大不确定性,提醒广大投资者注意风险 3、2020年7月30日,公司控股股东泰禾投资、公司实际控制人黄其森先生与海南万益签署了《股份转让框架协议》、泰禾投资拟将其持有公司的19.9%股份转让给海南万益,公司认为该股份转让事项将有助于推动公司目前进行的债务

重组工作,但最终能否达成取决于相关先决条件能否满足,存在不确定性,敬请 广大投资者注意投资风险(详见公司2020-067号公告)。 4、公司将根据相关工作的进展情况按规定履行信息披露义务。公司指定的 信息披露媒体为《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮 资讯网 (www.cninfo.com.cn),公司所有信息均以在上述指定媒体刊登的信息为 准,敬请广大投资者注意投资风险。

> 泰禾集团股份有限公司 二〇二〇年八月二十五日

### 关于新疆前海联合淳丰纯债87个月定期开放债券型 证券投资基金提前结束募集的公告

特此公告。

投资者欲了解本基金的详细情况,敬请阅读2020年8月14日刊登在指定机 露媒介上的 新疆前海联合淳丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金招募 "本基金")经中国证监会2019年9月5日证监许可 (2019)1636号文准予注册,并 说明书》、新疆前海联合淳丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金基金份 2020 年 8 月 7 日证监许可 2020 1725 号文准予变更注册后募集。本基 额发售公告》和《新疆前海联合淳丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金 根据统计,截至2020年8月24日本基金募集的基金份额总额、募集金额和认购户数均已达到基金合同生效的备案条件。为更好地保护投资者利益,根据《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》、《新 投资者可拨打本基金管理人的客户服务电话400-640-0099或登录本基金

管理人网站www.qhlhfund.com了解相关情况。

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基 金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风 险。投资者投资于上述基金前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》

新疆前海联合基金管理有限公司 二〇二〇年八月二十五日

旗下已在昆仑银行代销且已开通转换的基金之间的转换业务 基金转换业务的规则、费用及计算方法请参见各基金最新的招募说明书及

相关公告,如实填写或更新个人信息并核对自身的风险承受能力,选择与自己 风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金产品。

1 昆仑银行股份有限公司

网址:www.lionfund.com.cn

诺安基金管理有限公司