(上接B157版)

75、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
网址:www.haojiyoujijin.com
76、北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
联系人:侯芳芳
电话:010-61840688
客服电话:400-159-9288
网址: danjuanapp.com
77、中民财富基金销售(上海)有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层
法定代表人:弭洪军
联系人:黄鹏
电话:18521506916
客服电话:400-876-5716
网址: www.cmiwm.com
78、南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道1号
法定代表人:王锋
联系人:张云飞
电话:13016933367
客服电话:025-66996699
网站:www.snjijin.com
79、西藏东方财富证券股份有限公司
住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼
办公地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼
法定代表人:陈宏
联系人:付佳
电话:17717379005
客服电话:95357
网站: www.18.cn
80、江苏汇林保大基金销售有限公司
住所:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
办公地址:南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室
法定代表人:吴言林
联系人:孙平
电话:13564999938
客服电话:025-66046166
网站: www.huilinbd.com
81、深圳前海财厚基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址: 广东省深圳市南山区高新南十道 深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室
法定代表人:杨艳平
联系人:莫婉
电话:13923830997
客服电话:400-1286-800
网站: www.caiho.cn
82、喜鹊财富基金销售有限公司
住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
法定代表人:陈皓
联系人:张萌
电话:18600730680
客服电话:400-6997-719
网站: www.xiquefund.com
83、中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊旻
联系人:沈晨
电话:010-59336544
客服电话:4008-909-998
网站:www.jnlc.com
(三)登记机构
名称:东方基金管理股份有限公司
住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人:崔伟
联系人:肖向辉
电话:010-66295871
传真:010-66578680
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:北京德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层
负责人:王丽
联系人:刘焕志
电话:010-52682888
传真:010-52682999
经办律师:刘焕志、孙艳利
(五)审计基金财产的会计师事务所
名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市南京东路61号4楼
办公地址:北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层
法定代表人:朱建弟
联系人:朱锦梅
电话:010-68286868
传真:010-88210608
经办注册会计师:朱锦梅、高慧丽

五、基金名称和基金类型

(一)本基金名称:东方区域发展混合型证券投资基金
(二)本基金类型:混合型
(三)基金运作方式:契约型,开放式

六、基金投资目标和投资范围

(一)投资目标
在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
(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(包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(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其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为30%-95%;投资于受益于国家区域发展战略的地区及相关行业的上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,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

(一)类别资产配置
在类别资产的配置上,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态调整。
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、CPI、PPI水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、M1、M2值及其增加量等;
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、房地产调控政策等;
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最佳配置比例并实时进行调整。
(二)股票投资策略
1、区域发展主题股票的界定
本基金定义的"区域发展"主题是指与我国区域经济发展相关的各个主题的集合体。该主题包括但不限于"一带一路"、"京津冀一体化"、"自贸区"、"新型城镇化"、"西部大开发"、"中部崛起"等子主题(各子主题涉及到的相关产业可能有交叉)。
"一带一路",指"新丝绸之路经济带"和"21世纪海上丝绸之路"。该主题涉及到的产业包括但不限于建筑建材、交运设备、金融、机械设备、商业贸易、交通运输等产业。
"京津冀一体化",指国家出台的旨在加强环渤海及京津冀地区经济协作的战略主题。该主题涉及到的产业包括但不限于通信、交通运输、房地产、环保、建筑材料等产业。
"自贸区",指设置采取自由港政策的关税隔离区的政策主题,目前中国的自贸区包括发展较为成熟的上海自贸区以及2015年3月24日审议通过的广东、天津、福建自由贸易试验区。该主题涉及到的产业包括但不限于银行、通信、运输、非银行金融、制造业等产业。
"新型城镇化",指着力于提高城镇化质量,并将生态文明理念和原则全面融入城镇化过程的战略主题。该主题涉及到的产业包括但不限于建筑建材、房地产、交运设备、机械设备、商业贸易、交通运输、公用事业以及家用电器等产业。
"西部大开发",指国家为促进西部地区经济发展,提高西部人民生活水平而推出的西部发展战略主题。该主题涉及到的产业包括但不限于通信、交通运输、公用事业、采矿、环保、医疗、家用电器等产业。
"中部崛起",指促进中国中部经济区——河南、湖北、湖南、江西、安徽和山西6省共同发展的战略主题。该主题涉及到的产业包括但不限于农业、信息产业、房地产、银行、通信等产业。
如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金"区域发展"主题的覆盖范围发生变动,本基金在深入研究的基础之上,有权把变动行业内的公司股票纳入本基金主题的界定范围内。
2、个股投资分析
(1)定性分析
本基金将结合财务数据、企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性等定性因素,给予股票一定的折溢价水平,最终确定股票合理的价格区间。
(2)定量分析
在定量分析方面,本基金将通过对成长性指标(预期主营业务收入增长率、净利润增长率、PEG)、相对价值指标(P/E、P/B、P/CF、EV/EBITDA)以及绝对估值指标(DCF)的定量评判,筛选出具有GARP(合理价格成长)性质的股票。
(三)债券投资策略
1、久期调整策略
本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断,形成对未来市场利率变动方向的预期,进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值,达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时,本基金将延长所持有的债券组合的久期值,从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得;反之,当预期市场总体利率水平上升时,则缩短组合久期,以避免债券价格下降带来的资本损失,获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合理预期,调整组合的期限结构策略,适当的采取子弹策略、哑铃策略、梯式策略等,在短期、中期、长期债券间进行配置,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陡时,采取子弹策略;当预期收益率曲线变平时,采取哑铃策略;当预期收益率曲线不变或平行移动时,采取梯形策略。
3、类属资产配置策略
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为一般债券(含国债、央行票据、政策性金融债等)、信用债券(含公司债券、企业债券、非政策性金融债券、短期融资券、地方政府债券、资产支持证券等)、附权债券(含可转换公司债券、可分离交易公司债券、含回售及赎回选择权的债券等)三个子市场。在大类资产配置的基础上,本基金将通过对国内外宏观经济状况、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,在目标久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。
(1)一般债券投资策略
在目标久期控制及期限结构配置基础上,对于国债、中央银行票据、政策性金融债,本基金主要通过跨市场套利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、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究,分析违约风险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:回购放大是一种杠杆投资策略,通过质押组合中的持仓债券进行正回购,将融得资金购买债券,获取回购利率和债券利率的利差,从而提高组合收益水平。影响回购放大策略的关键因素有两个:其一是利差,即回购资金成本与债券收益率的关系,只有当债券收益率高于回购资金成本时,放大策略才能取得正的回报;其二是债券的资本利得,所持债券的净价在放大操作期间出现上涨,则可以获取价差收益。在收益率曲线陡峭或预期利率下行的市场情况下,在防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。
(3)附权债券投资策略
本基金在综合分析可转换公司债券的债性特征、股性特征等因素的基础上,利用BS公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值,重视对可转换债券对应股票的分析与研究,选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券,本基金将利用债券市场收益率数据,运用期权调整利差(OAS)模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值,作为此类债券投资的主要依据。
(四)权证投资策略
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型,深入分析的资产价格及其市场隐含波动率的变化,寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,谨慎投资,追求较稳定的当期收益。
(五)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、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数收益率+40%×中债总全价指数收益率
本基金选择中债总全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债总全价指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),是中国目前最权威、应用也最广的指数。中债总全价指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标的,反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。
本基金选择沪深300指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深300指数样本覆盖了沪深市场60%左右的市值,具有良好的市场代表性和可投资性。
若今后法律法规发生变化或未来市场发生变化导致此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,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

十、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。
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2019年12月31日(财务数据未经审计)。
(一)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	84,557,502.75	54.50
	其中:股票	84,557,502.75	54.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,201,800.00	4.64
	其中:债券	7,201,800.00	4.64
	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	59,994,230.00	38.67
	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	3,279,306.56	2.11
8	其他资产	120,525.36	0.08
9	合计	155,153,364.67	100.00

(二)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	10,480,111.31	6.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	134,067.00	0.09
J	金融业	55,647,679.40	35.99
K	房地产业	16,798,067.00	10.86
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,491,000.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	84,557,502.75	54.69

(三)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	601166	兴业银行	435,700	8,626,860.00	5.58
2	601288	农业银行	2,273,100	8,387,739.00	5.42
3	601939	建设银行	1,152,080	8,329,538.40	5.39
4	601988	中国银行	2,200,000	8,118,000.00	5.25
5	601818	光大银行	1,836,200	8,097,642.00	5.24
6	001914	招商积余	362,300	7,351,067.00	4.75
7	600048	保利地产	400,000	6,472,000.00	4.19
8	601318	中国平安	70,000	5,982,200.00	3.87
9	600519	贵州茅台	4,300	5,086,900.00	3.29
10	600036	招商银行	115,000	4,321,700.00	2.80

(四)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	7,009,800.00	4.53
	其中:政策性金融债	7,009,800.00	4.53
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)	192,000.00	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,201,800.00	4.66

(五)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(%)
1	190211	19国开11	70,000	7,009,800.00	4.53
2	113029	明阳转债	710	71,000.00	0.05
3	128085	鸿达转债	450	45,000.00	0.03
4	128084	木森转债	350	35,000.00	0.02
5	110065	淮矿转债	250	25,000.00	0.02

(六)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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
(七)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
本基金本报告期末未持有贵金属。
(八)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
本基金本报告期末未持有权证。
(九)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。
(十)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。
(十一)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说明
本基金所持有的兴业银行(601166)收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司旗下昆明分行、宁波分行、信用卡中心、南宁分行、武汉分行、大连分行、广州分行、襄阳分行、烟台分行、兰州分行、上杭支行、龙岩分支行、济南分行、东营分行、威海分行、湖州分行、唐山分行、马鞍山分行等分支机构进行处罚,违规类型为未依法履行其他职责等。
本基金所持有的农业银行(601288)收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司旗下焦作分行、富锦市支行、梨树县支行、深圳市分行、信用卡中心、岳阳分行东乡族自治县支行、宁波市分行、温州分分行、重庆南岸支行、铁门关兵团分行、鞍山分行、广西区分行、泉州分行、厦门市分行、上海徐汇淮海中路支行、上海奉贤支行、黄山昱城支行、鄂温克族自治旗支行、葫芦岛支行、钦州分行、大连市分行、淄博分行、偃师市支行、咸宁分行、广州海珠支行、十堰分行、阳江分行、榆林分行、南充顺庆支行、格尔木分行、济宁分行等分支机构进行处罚,违规类型为未依法履行其他职责。
本基金所持有的建设银行(601939)公司因业务违规受到中国人民银行、各地银监会及各地保监会的行政处罚。公司目前经营一切正常,上述处罚不会对正常经营造成影响。
本基金所持有的中国银行(601988)收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司旗下张家界天门路支行、龙游县支行、福安支行、云南省分行、广西区分行、山东省分行、巴彦浩特分行、呼和浩特市分支行、内蒙古自治区分行、天津市分行、宝鸡分行、内蒙古自治区分行、大连市分行、淄博市分行、广东省分支行、张家界分行、武汉市分支行、淮北分行、深圳市分行、阳江分行、百色分行、襄阳分行、厦门市分行、信阳分行、徐州分行等分支机构进行处罚,违规类型为未依法履行其他职责。
本基金所持有的光大银行(601818)收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司旗下大庆分行、南昌分行、青岛分支行、昆明分行、大连分支行、宁波分行、珠海分行、济南分行、淄博分行、长春分行、广州支行、九江分行、北京分行、潍坊分行、日照分行、郑州分行、武汉分行、长沙分行等分支机构进行处罚,违规类型为未依法履行其他职责等。
本基金所持有的招商银行(600036)收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司及旗下武汉分行、丽江分行、金华义乌支行、南昌分行、上海天山支行、昆明分行、信用卡中心、南宁分行、厦门分行、哈尔滨分行、淄博分行、济南分行、赣州分行、滨州分行等分支机构进行处罚,违规类型为未依法履行其他职责等。
公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。
本基金所持有的保利地产(600048)在2019年1月1日至2019年12月31日期间,收到以下处罚:
公司高管吴章焰,受到广元市监察委员会处罚,未依法履行其他职责。
公司公告以上内容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:
(1)研究员对宏观经济、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,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。
(4)交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。
(5)投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、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制。
本基金投资兴业银行主要基于以下原因:公司是国内股份制银行龙头企业之一,业务结构稳健,PB估值便宜业绩增长稳定,具备投资价值。
本基金投资农业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。
本基金投资建设银行主要基于以下原因:公司隶属五家国有大行之一,为我国系统性重要金融机构,经营稳健,资产质量扎实,分红水平高,在经济下行趋势较为明显的阶段,具备很好的防御属性。
本基金投资中国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。
本基金投资光大银行主要基于以下原因:公司是国内股份制银行龙头企业之一,业务结构稳健,PB估值便宜业绩增长稳定,具备投资价值。
本基金投资招商银行主要基于以下原因:公司是国内领先的零售银行,通过多年来零售战略的执行,公司的零售客户不仅存在规模优势,而且客户质量优质,客户结构中私行客户占比高,客户潜在价值空间大。公司在零售领域建立了强大的护城河,创新能力行业领先,业务结构稳健,业绩稳定,资产质量好于行业竞争对手。
本基金投资保利地产主要基于以下原因:公司是一家专注于房地产开发及销售的大型企业集团,拥有国家一级房地产开发资质。在20余年专业开发过程中,公司培养了以商品住宅开发销售为主、经营性物业开发持有为辅的综合开发能力;以"和者筑善"为价值理念,致力于创造自然、建筑、人文交融的人居生活,打造了康居、善居、逸居、尊居四大品牌系列,包含花园系、心语系、香槟系、公馆系、林语系、康桥系、十二橡树系等多种品系,涵盖住宅、写字楼、星级酒店、购物中心、商贸会展、高端休闲地产等多种业态;形成了覆盖珠三角、长三角、环渤海、中部、西南主要经济圈,遍布全国60个主流城市的战略布局。现阶段公司估值合理偏低估,具备中长期投资价值。
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,或在报告编制日前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,没有投资超出基金合同规定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	48,853.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	67,797.73
5	应收申购款	3,874.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,525.36

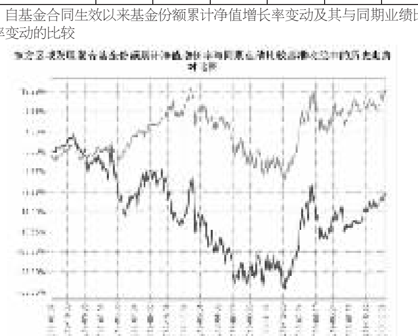
4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。
(一)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

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④	①-③	②-④
2016.09.07-2016.12.31	-0.40%	0.32%	-1.45%	0.46%	1.05%	-0.14%
2017.01.01-2017.12.31	-16.14%	0.93%	10.74%	0.39%	-26.88%	0.54%
2018.01.01-2018.12.31	-17.29%	1.37%	-13.54%	0.79%	-3.75%	0.58%
2019.01.01-2019.06.30	22.13%	1.47%	15.71%	0.92%	6.42%	0.55%
2019.07.01-2019.09.30	-1.28%	0.68%	0.14%	0.57%	-1.42%	0.11%
2019.10.01-2019.12.31	8.14%	0.47%	4.77%	0.44%	3.37%	0.03%

(二)自基金合同生效以来基金份额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



十二、费用概览

(一)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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的账户开户费用、账户维护费用;
9、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。
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。
(二)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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$H=E\times1.50\%\div$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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前五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、公休假等,支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
$H=E\times0.25\%\div$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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
上述"一、基金费用的种类中第(三)-(九)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。
(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、法规执行。

十三、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》、《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《东方区域发展混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新,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司"。
(二)在"第三部分 基金管理人"中,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。

东方基金管理股份有限公司
2020年8月

证券代码:002665　证券简称:首航高科　公告编号:2020-072

首航高科能源技术股份有限公司关于签订重大合同的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

近日,首航高科能源技术股份有限公司(以下简称"公司"或"卖方")收到与西北电力工程承包有限公司(以下简称"西北电力工程"或"买方")签订的《府谷清水川煤电一体化电厂三期扩建工程表凝式自然通风间接空冷系统设备订货合同》,合同约定公司向西北电力工程承包有限公司EPC总包项目,府谷清水川煤电一体化电厂三期扩建工程提供表凝式自然通风间接空冷系统设备。根据《公司章程》规定,该合同经公司总经理办公会审议批准后签订。
一、合同当事人介绍
1、公司名称:西北电力工程承包有限公司;
2、法定代表人:郑舒贵;
3、注册资本:5000万人民币;
4、住　所:陕西省西安市新城区金花北路280号西北电力设计院办公楼2层;
5、经营范围:电力工程及工业与民用建筑工程(含国〔境〕外工程)的全过程总承包或分包、工程管理、工程招标代理、技术咨询、技术服务以及和工程相关设备、材料的进出口业务;发、送变电设备、计算机设备、金属材料、建筑材料、机械设备、电器、通讯器材(卫星地面接收设施、无线电发射设备除外)的批发和零售。
6、西北电力工程与本公司不存在关联关系;
7、最近一个会计年度西北电力工程与本公司未发生类似业务;
8、履约能力分析:本合同交易对方是大型综合公司,信誉优良,具有较好的履约能力。
二、合同主要内容
1、合同标的:表凝式自然通风间接空冷系统设备;
2、合同总金额(含税):人民币157,600,000.00元(人民币大写:壹亿伍仟柒佰陆拾万元整);
3、结算方式:分阶段按比例结款,具体如下:
3.1 预付款为合同总价的10%;
3.2 生产进度款为合同总价的20%;
3.3 发货款为合同总价的20%;
3.4 到货款款为合同总价的30%;
3.5 验收款为合同总价的10%;
3.6 质保金为合同总价的10%;
4、生效条件:本合同经双方法定代表人或授权代表签字,并加盖合同专用章后即刻生效;
5、合同履行期限:从合同生效之日起至签发最后一台套合同设备"最终验收证书",并且买卖双方债权债务关系全部结清为止结束。
6、违约条款
6.1 卖方保证其供应的本合同设备符合本合同约定的标准及规格。若本合同没有规定类似的标准和规格,则应满足货物预期的用途和本项目工程的生产要求、没有缺陷、在发货时是全新的和未被使用过的,且拥有正确的和现行的设计和完美的生产工艺。买方对卖方及其分包商所进行的质量保证、质量控制活动不减轻或免除卖方对本合同所承担的义务或法律责任。
如果卖方未能履行其质量保证义务,买方有权委派第三方履行此类义务,卖方承担全部由此产生的费用。
6.2 在合同有效期内,买方发现本合同设备存在缺陷或损坏,买方有权向卖方提出索赔。如果卖方未对买方的索赔提出异议或卖方的异议不成立,卖方应按买方要求进行修理、更换、赔偿买方的损失,或委托买方修理。由此产生的到安装现场的更换费用、运费及保险费由卖方负担。
6.3 在合同有效期内,如由于卖方责任需要更换、修理有缺陷的设备,而使合同设备推迟安装或停运时,则质量保证期应按实际修理或更换所延误的时间相应顺延。
6.4 如果不是由于买方原因或买方没有要求推迟交货而卖方未能按本合同附件一规定的交货期交货时(不可抗力除外),买方有权按下列比例,以差额累进法计算费用向卖方收取违约金:
迟交1-4周,每周违约金金额为合同总价的0.5%;
迟交5-8周,每周违约金金额为合同总价的1%;
迟交9周以上,每周违约金金额为合同总价的1.5%。不满一周按一周计算。
迟交合同设备不超过90日的,违约金总额不超过本合同总价的10%。
合同设备交付时间超过合同约定时间90日或合同设备迟交影响工程工期超过10日,卖方应承担合同总价的20%的违约金。
三、合同对上市公司的影响
1、公司具备履行合同的能力、资金、人员、技术和产能均能够保证合同的顺利履行;
2、在合同生效后,根据该工程的进度安排交付设备和工程的实施,具体进度根据合同和技术协议约定时间履行。合同不含税金额约占公司2019年度营业收入744,084,663.39元的18.74%。合同的执行将提升公司2020年、2021年的营业收入和营业利润;
3、本合同的签订和履行不影响公司的业务独立性。不存在因履行合同而对合同对方当事人形成依赖。
四、风险提示
1、合同履行周期较长,存在受不可抗力风险影响导致合同不能履行的风险;
2、合同货款回收分阶段按比例执行,由于履行周期较长,存在货款回收缓慢的风险,敬请各位投资者注意风险。
五、合同审议程序
该合同无需本公司董事会审议批准,也不需独立董事和律师发表意见。
六、备查文件
1、双方签订合同正本。
特此公告。

首航高科能源技术股份有限公司
董事会
2020年8月24日

证券代码:002373　证券简称:千方科技　公告编号:2020-090
债券代码:112622　债券简称:17千方01

北京千方科技股份有限公司关于参加北京辖区上市公司投资者集体接待日的公告

为进一步加强与广大投资者的沟通交流,北京千方科技股份有限公司(以下简称"公司")将参加"2020年北京辖区上市公司投资者集体接待日"活动,现将有关事项公告如下:
本次集体接待日活动将采取网络远程的方式举行,投资者可以登录"全景网"网站(http://rs.p5w.net/html/123119.shtml)或关注微信公众号全景路演天下,参与本次投资者集体接待日活动,活动时间为2020年9月8日(星期二)15:00至17:00。
届时公司的董事长兼总经理夏曙东先生、董事会秘书张兴明先生、财务总监夏曙锋先生将通过网络在线交流形式与投资者就公司治理、发展战略、经营状况、融资计划、股权激励和可持续发展等投资者关注的问题进行沟通。
欢迎广大投资者积极参与。
特此公告。

北京千方科技股份有限公司董事会
2020年8月25日

证券代码:002373　证券简称:千方科技　公告编号:2020-091
债券代码:112622　债券简称:17千方01

北京千方科技股份有限公司关于股东股份质押及解除质押的公告

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。

北京千方科技股份有限公司(以下简称"公司""本公司")近日接到公司股东夏曙锋先生的通知,获悉夏曙锋先生所持有本公司的部分股份办理了股票质押式回购交易业务和股票质押提前购回交易业务,具体事项如下:
一、股东股份质押的基本情况
本次股份质押基本情况如下:

股东名称	是否为控股股东或第一大股东及其一致行动人	本次质押数量(股)	占其所持股份比例	占公司总股本比例	是否为限售股	是否为补充质押	质押起始日	质押到期日	质权人	质押用途
夏曙锋	是	2,862,000	13.14%	0.18%	否	否	2020-08-24	2021-08-24	海通证券股份有限公司	实际控制的企业生产经营
合计	-	2,862,000	13.14%	0.18%	-	-	-	-	-	-

上述质押股份未负担重大资产重组等业绩补偿义务。
二、股东股份解除质押的基本情况
本次解除质押基本情况如下:

股东名称	是否为控股股东或第一大股东及其一致行动人	本次解除质押股份数量(股)	占其所持股份比例	占公司总股本比例	起始日	解除日期	质权人
夏曙锋	是	2,573,000	11.82%	0.16%	2020-01-06	2020-08-24	国开证券股份有限公司
合计	-	2,573,000	11.82%	0.16%	-	-	-

三、股东股份累计被质押情况
截至公告披露日,上述股东及其一致行动人所持质押股份情况如下:

股东名称	持股数量	持股比例	本次变动前质押股份数量	本次变动后质押股份数量	占其所持股份比例	占公司总股本比例	已质押股份情况		未质押股份情况	
							已质押股份限售和冻结数量	占已质押股份比例	未质押股份限售和冻结数量	占未质押股份比例
夏曙东	239,692,806	15.16%	134,785,214	134,785,214	56.23%	8.52%	0	0%	0	0%
北京千方集团有限公司	137,336,276	8.69%	0	0	0	0	0	0%	0	0%
夏曙锋	21,773,836	1.38%	5,843,000	6,132,000	28.16%	0.39%	0	0%	0	0%
合计	398,802,918	25.22%	140,628,214	140,917,214	35.34%	8.91%	0	0%	0	0%

四、相关风险提示
公司股东夏曙锋先生资信状况良好,目前所质押的股份未出现平仓风险或被强制过户的风险,未对公司生产经营、公司治理等产生影响。后续若出现平仓风险,夏曙锋先生将采取包括但不限于提前还款、补充质押股份等措施来应对上述风险,并按相关规定及时通知公司履行信息披露义务。
五、备查文件
1、海通证券股份有限公司股票质押签署协议书通知;
2、国开证券股份有限公司股票质押式回购交易协议书(购回交易)。
特此公告。

北京千方科技股份有限公司董事会
2020年8月25日

证券代码:603566　证券简称:普莱柯　公告编号:2020-054

普莱柯生物工程股份有限公司2020年第二次临时股东大会决议公告

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:
● 本次会议是否有否决议案:无
一、会议召开和出席情况
(一)股东大会召开的时间:2020年8月24日
(二)股东大会召开的地点:洛阳市洛龙区政和路15号公司二楼会议室
(三)出席会议的普通股股东和恢复表决权的优先股股东及其持有股份情况:

1、出席会议的股东和代理人人数	55
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数(股)	42,375,716
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例(%)	20.0960

(四)表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定,大会主持情况等。
由公司董事会召集,由公司董事长张许科先生主持,本次会议以现场投票与网络投票相结合的方式召开,北京德恒律师事务所律师出席了现场会议并见证.本次会议的召集、召开符合《公司法》、《公司章程》等法律法规及规范性文件的规定。
(五)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况
1、公司在任董事9人,出席7人,独立董事魏刚先生、张波先生因公务原因,未能出席;
2、公司在任监事3人,出席3人;
3、董事会秘书出席会议,其他部分高级管理人员列席会议。
二、议案审议情况
(一)非累积投票议案
1、议案名称:关于放弃参股公司增资优先认购权暨关联交易的议案
审议结果:通过
表决情况:

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
A股	42,243,200	99.6872	132,516	0.3128	0	0.0000

(二)涉及重大事项,5%以下股东的表决情况

议案序号	议案名称	同意		反对		弃权	
		票数	比例(%)	票数	比例(%)	票数	比例(%)
1	关于放弃参股公司增资优先认购权暨关联交易的议案	30,906,480	99.5730	132,516	0.4270	0	0.0000

(三)关于议案表决的有关情况说明
无
三、律师见证情况
1、本次股东大会见证的律师事务所:北京德恒律师事务所
律师:黄丰、赖元超
2、律师见证结论意见:
综上所述,本所律师认为,公司本次股东大会的召集和召开程序、出席会议人员和召集人资格、会议表决程序和表决结果均符合我国相关法律、法规、规范性文件和《公司章程》的规定,会议形成的决议合法、有效。
四、备查文件目录
1、经与会董事和记录人签字确认并加盖董事会印章的股东大会决议;
2、经见证的律师事务所主任签字并加盖公章的法律意见书;
3、本所要求的其他文件。

普莱柯生物工程股份有限公司
2020年8月24日

证券代码:002200　证券简称:ST云投　公告编号:2020-047

云南云投生态环境科技股份有限公司关于诉讼事项的公告

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。

一、诉讼事项的基本情况
近期,公司收到贵州省六盘水市中级人民法院发来的(2020)黔02民初96号《传票》、《民事裁定书》、《应诉通知书》、《民事起诉状》等相关法律文书,贵州省六盘水市中级人民法院已立案受理西部水电建设有限公司(以下称"原告"、"西部水电")作为原告以"建设工程施工合同纠纷"为由对本公司和六盘水北大教育投资有限公司(以下称"北大教育")提起的民事诉讼案,要求公司及北大教育共同向其支付工程款、赔偿违约金等款项共计32,139,293元。该案将于2020年9月29日上午9点在贵州省六盘水市中级人民法院第八法庭开庭审理。同时,西部水电向贵州省六盘水市中级人民法院申请财产保全措施,贵州省六盘水市中级人民法院裁定冻结了公司在13个银行账户共计2,620万元的资金额度。
二、有关诉讼的基本情况
(一)受理机构:贵州省六盘水市中级人民法院
(二)受理地点:贵州省六盘水市
(三)诉讼各方当事人
原告:西部水电建设有限公司(以下称"西部水电")
被告:云南云投生态环境科技股份有限公司(以下称"公司、本公司")
被告:六盘水北大教育投资有限公司(以下称"北大教育")
第三人:文德扬
(四)诉讼基本情况
2015年8月31日和2015年9月23日,公司和西部水电(承包人、乙方)分别与北大教育(发包人、甲方)签订了《建设工程施工合同》和《六盘水外国语实验学院校舍建设及附属工程联合体合同(二期工程)》。合同价款共计2.56亿元。同时,公司(总包人、甲方)与西部水电(分包人、乙方)签订了分包合同,西部水电承建了公司六盘水项目1.35亿元工程;西部水电于2015年6月25日向北大教育缴纳了定金(实为履约保证金)2,000,000元。2016年5月17日,西部水电与北大教育公司签订的《结算协议》和《六盘水外国语学校建设工程最终结算单》,涉及的应付工程款为38,051,042元。
2017年6月5日,西部水电作为原告以"建设工程施工合同纠纷"为由向贵州省高级人民法院提起了诉讼,要求被告公司及北大教育向其支付工程款和赔偿违约金等款项等共计60,051,042元。在案件审理期间,公司积极推进与诉讼各方的协商。在各方协商一致的情况下,西部水电向法院提出了撤诉。具体内容详见公司分别于2017年6月16日、2017年8月8日、2017年9月21日、2017年11月8日、2017年11月10日、2017年12月2日、2018年8月11日、2018年9月12日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)披露的相关公告。(公告编号:2017-029、2017-035、2017-063、2017-064、2017-077、2018-072、2018-086)。
近期,原告西部水电以公司及北大教育仍有9,816,042.00元的工程款及2,000,000元的保证金未支付为由,向贵州省六盘水市中级人民法院提起了诉讼。
(五)诉讼请求
西部水电的诉求为:
1、判令两被告向原告支付欠付的工程款9,816,042.00元;
2、判令两被告向原告赔偿逾期付款违约金22,323,251元(以应付未付工程款为基数,年利率24%为标准,自2016年6月21日起暂计算至起诉之日违约金为22,323,251元,实际计算至工程款支付完毕止);
3、判令被告六盘水北大教育投资有限公司退还原告保证金2,000,000.00元;
4、本案诉讼费、保全费由两被告承担。
上述诉讼公司涉及金额合计为32,139,293元。
(六)诉讼保全情况
西部水电向贵州省六盘水市中级人民法院申请了财产保全措施,贵州省六盘水市中级人民法院经过审理后出具了(2020)黔02民初96号《民事裁定书》,裁定冻结公司名下的银行账户存款3,300万元或价值相当的其他财产。目前,公司名下的13个银行账户共计2,620万元的资金额度已被冻结。
(七)本诉讼其他说明
2017年6月西部水电向公司提起诉讼后,公司始终在积极推进与诉讼各方的协商,在各方协商一致、西部水电撤诉后,公司陆续向西部水电支付了2,090万元工程款。经核查公司财务账面反映,截至本公告披露日,公司已向西部水电支付款项12,018.40万元,欠付西部水电公司款项481.60万元。
三、其他尚未披露的诉讼、仲裁事项
公司没有应披露而未披露的其他诉讼、仲裁事项。
四、本次公告的诉讼对公司本期利润或期后利润的可能影响
根据《应诉通知书》要求,公司将在15日内向贵州省六盘水市中级人民法院提交答辩状并做好应诉准备。本次诉讼对公司的影响取决于法院的判决结果,鉴于该案件尚未开庭审理,本次诉讼对公司本期利润和期后利润的影响尚存在不确定性。公司将根据案件进展情况及时履行信息披露义务,敬请广大投资者注意投资风险。
五、备查文件
(一)贵州省六盘水市中级人民法院《传票》1份;
(二)贵州省六盘水市中级人民法院《民事裁定书》1份;
(三)贵州省六盘水市中级人民法院《应诉通知书》1份;
(四)民事起诉状1份。
特此公告。

云南云投生态环境科技股份有限公司
董 事 会
二〇二〇年八月二十五日