

中银智能制造股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016年第1号)

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
二〇一六年二月

重要提示

本基金经2015年6月4日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1109号文募集注册。基金合同于2015年6月19日生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,并承担基金投资中出现的各类风险,包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特定风险,等等。本基金投资中小企业私募债券,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法及时出售所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为股票型证券投资基金,属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

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也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本更新招募说明书所载内容截止日为2015年12月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人中信银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金合同生效日

2015年6月19日

二、基金管理人

(一) 基金管理人概况

公司名称:中银基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼
法定代表人:白志中
设立日期:2004年8月12日
电话:(021)38834999
联系人:高爽秋
注册资本:1亿元人民币
股权结构:

股东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币6360万元	93.5%
贝莱德投资管理(英国)有限公司	相当于人民币1650万元美元	16.5%

(二) 主要人员情况

1、董事会成员
白志中(BAI Zhizhong)先生,董事长。上海交通大学工商管理专业硕士,高级经济师。历任中国银行山西省分行综合计划处处长及办公室主任,中国银行宁夏回族自治区分行行长,党委书记,中国银行广西壮族自洽区分行行长,党委书记,中国银行四川省分行行长、党委书记,中国银行广东省分行行长、党委书记等职。现任中银基金管理有限公司董事长。

李道滨(LI Daobin)先生,董事。国籍:中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司,历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。具有15年基金行业从业经验。

赵春奎(ZHAO Chunqiang)先生,董事。南开大学世界经济专业硕士。历任中国银行国际金融研究所干部,中国银行董事会秘书部副部长、主管。中国银行上市办公室主任,中国银行江苏省分行行长助理,副行长、党委书记,党委委员,中国银行个人金融总部副总经理等职。现任中国银行财富管理与私人银行部副总经理(主持工作)。

宋福宁(SONG Funing)先生,董事。厦门大学经济学硕士,经济师。历任中国银行福建省分行资金计划处外汇交易科科长、资金计划处副处长、资金业务部负责人、资金业务部总经理,中国银行总行金融市场总部助理总经理,中国银行总行投资银行与资产管理部助理总经理等职。现任中国银行投资银行与资产管理部副副总经理。

葛伟栋(M David Graham)先生,董事。国籍:英国。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理,主要负责管理贝莱德合资企业关系方面的事务。葛伟栋先生于1977年—1984年供职于Deloitte Haskins & Sells(现为普华永道)伦敦和悉尼分公司,之后,在拉扎斯(Lazard)银行任职,香港和东京分公司任职。1992年,加入美林投资管理有限公司(MILM),曾担任欧洲、中东、非洲、太平洋地区客户关系部)的负责人。2006年贝莱德与美林投资管理有限公司合并后,加入贝莱德。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理,主要负责管理贝莱德合资企业关系方面的业务。

荆新,中国籍,1967年生,中共党员,会计学博士,中国人民大学商学院会计学教授、博士生导师,兼任中国会计学会理事、财政部政府会计准则委员会顾问、全国MPAcc教指委副主任委员、中国青少年发展基金会监事。

赵欣阿(ZHAO Xing)先生,独立董事。美国西北大学经济学博士。曾在美国威廉与玛丽学院商学院任教,并曾为美国投资公司协会(美国共同基金行业协会)等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教授长和金融MBA主任,并在中国的数家上市公司和金融投资公司担任独立董事。

雷晓波(Edward Radcliffe)先生,独立董事。法国INSEAD工商管理硕士。曾任百狐技术公司总经理,目前仍担任该公司的咨询顾问。在此之前,曾任英国电信集团零售部)经理,贝特利恩国际公司董事、北京代表处首席代表、总经理,中英商会财务司库、英中贸易协会理事等职。现任银湖合伙人有限公司合伙人。

2、监事

赵旭辉(ZHAO Huiping)先生,监事。国籍:中国。中央党校经济管理专业本科、人力资源管理师、经济师。曾任中国银行人力资源部信息团队主管、中国银行人力资源部综合处副处长、处长、人力资源部干部处干部、副处长。

乐阮(YUE NI)女士,职工监事。国籍:中国。工商管理硕士。曾分别在上海市浦东发展银行、山西证券有限责任公司、友邦华泰基金管理有限公司工作。2006年7月加入中银基金管理有限公司,现任基金运营部总经理。具有14年证券从业年限,11年基金行业从业经验。

3、管理层成员

李道滨(LI Daobin)先生,董事,执行总裁。简历见董事会成员介绍。
欧阳向军(Jason X. OUYANG)先生,督察长。国籍:加拿大。中国证券业协会—沃顿商学院高级管理培训班(Wharton-SAC Executive Program)毕业证书,加拿大西部大学毅伟商学院(Yvey School of Business, Western University)工商管理硕士(MBA)和经济学硕士。曾在加拿大太平洋洋集团、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年,也曾任蔚深证券有限责任公司(现光大证券)研究发展中心和总经理、融通基金管理有限公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文(ZHANG Jiawen)先生,副执行总裁。国籍:中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

陈军(CHEN Jun)先生,副执行总裁。国籍:中国。上海交通大学工商管理硕士、美国伊利诺伊大学金融硕士。2004年加入中银基金管理有限公司,历任基金经理、权益投资部总经理、助理执行总裁。

4、基金投资

王伟(WANG Wei)先生,中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP),工学硕士。2010年加入中银基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理。2015年2月至今任中银美丽中国基金基金经理,2015年3月至今任中银中小盘基金基金经理,2015年6月至今任中银优势基金基金经理,2015年6月至今任中银智能制造基金基金经理。具有5年证券从业年限。具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员的姓名及职务
主席:李道滨(执行总裁)

成员:陈军(副执行总裁)、杨军(资深投资经理)、吴鹏翔(固定收益投资部总经理)、李健(固定收益投资部副总经理)

列席成员:欧阳向军(督察长)

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况
名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)
住所:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦北楼
法定代表人:常振明
成立时间:1987年4月7日
组织形式:股份有限公司
注册资本:467.873亿元人民币
存续期间:持续经营
批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办发[1987]114号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号
联系人:中信银行资产托管部
联系电话:010-89936330
传真:010-85230024
客服电话:96568
网址:bank.ecitic.com

2、主要人员情况

李庆萍,行长,高级经济师。1984年8月至2007年1月,任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007年1月至2008年12月,任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月,任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月,任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月,任中国中信银行股份有限公司副总经理。2014年7月,任中国中信银行股份有限公司副总经理、中信银行行长。

杨毓先生,中信银行副行长,分管托管业务。1962年12月生,2011年4月起担任中国建设银行江苏省分行行长,党委书记;2006年7月至2011年3月担任中国建设银行河北省分行

行长,党委书记;1982年8月至2006年7月在中国建设银行河南省分行工作,历任计划财务处科长、副处长,信阳地区中心支行副行长,党组成员、计划处处长,中牟处长,郑州市铁路专业支行行长,党组书记;郑州分行行长,党委书记,金水支行行长,党委书记,河南省分行副行长,党委副书记。

刘泽云先生,现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理,经济学博士。1996年8月进入本行工作,历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处长经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理(主持工作)。

3、基金托管业务经营情况
2004年8月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2015年6月30日,中信银行已托管63只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模突破4亿元人民币。

四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

中银基金管理有限公司直销中心
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼
法定代表人:白志中
电话:(021)38834999
传真:(021)68872488
联系人:徐琳

2、其他销售机构

1)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客户服务电话:96568
联系人:宋亚平
网址:www.boc.cn
2)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:常振明
客户服务电话:96568
联系人:赵树林
网址:http://bank.ecitic.com
3)交通银行股份有限公司
注册地址:上海银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
客户服务电话:96569
联系人:曹程
网址:www.bankcomm.com
4)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
联系人:姚健英
客户服务电话:96568
公司网站:www.cmbc.com.cn
5)兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号中山大厦
邮政编码:350003
法定代表人:高建平
联系人:李博
联系电话:96661
公司网站:www.cib.com.cn/
6)上海银信资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
客服电话:4008219031
联系人:宁博宇
公司网站:www.lufunds.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二) 登记机构

名称:中银基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼
法定代表人:白志中
电话:(021)38834999
传真:(021)68872488
联系人:乐阮
(三)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
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
经办律师:黎明、孙睿
(四)审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50层
执行事务合伙人:吴港平
电话:021-22288888
传真:021-22280000
联系人:汤敏
经办会计师:徐艳、汤敏

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金通过挖掘中国经济结构转型、产业升级大背景下,智能制造主题相关行业的投资价值,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资对象是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(包括中小创、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票)、权证、股指期货等权益类品种,债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具),以及法律法规和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的相关规定。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为90%-95%,其中投资于智能制造主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的90%。债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规和中国证监会允许的基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的5%。本基金每个交易日终在扣除股指期货需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

九、投资策略

(一) 大类资产配置策略

本基金将通过跟踪考量宏观经济指标(包括GDP增长率、PMI、CPI、PPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

(二) 股票投资策略

1、A股股票投资策略

实施“中国制造2025”,是推动我国制造业从大国向强国转变的第一步,已上升为重要的国家战略。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对智能制造主题相关的行业和股票的深入研究与分析,挖掘该类上市公司的投资价值,分享制造业升级中的投资价值。

(1) 智能制造主题的定义

本基金所指智能制造,是指依托现代信息技术、智能技术与制造技术的结合,通过生产、业务模式、管理、服务等智能化、自动化、实现转型升级的制造行业。

具体地,本基金将“智能制造”主题聚焦于以下方面:一是智能技术与高端装备,包括机器人、新型传感器、自动化技术、拟人化智能技术,以及具有较高附加值和高技术含量、以重大先进工业设施设备机械为主的高端装备制造行业。二是运用智能技术和高端装备,由传

统制造业向智能化升级的制造业行业和企业,包括生产过程、生产方式的智能化、涉及机械、汽车、航空、船舶、轻工、家电、电子信息、化工、冶金、建材、食品、纺织等行业;新业态新模式的智能化,如工业互联网;管理的智能化,如物流信息化、智慧管理等;服务的智能化,一方面为制造企拓展在线监测、远程诊断、云服务等为代表的智能服务,另一方面是制造企业的互联网+。

智能制造主题相关行业的范畴会随着技术的进步不断变化,基金管理人将持续跟踪相关行业最新技术和商业模式的发展,对智能制造主题相关行业的定义进行动态更新。

(2) 行业配置策略

智能制造主题相关的各个行业由于所处的商业周期不同,面临的上下游市场环境也各不相同,其相关行业表现也并非完全同步。本基金将综合考虑经济周期、国家政策、社会经济结构、行业特性以及市场短期事件等方面因素,在不同行业之间进行资产配置。

(3) 个股选择

本基金通过定量和定性相结合的方法进行自下而上的个股选择,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,精选优质个股。

定性分析是从竞争优势、市场前景以及治理结构等方面对上市公司进行基本面对评估。竞争优势分析包括上市公司的市场优势、资源优势、产品优势等,市场前景分析包括市场的广度、深度、产业政策导向以及上市公司自身进行技术创新并拓展市场的潜力,治理结构分析包括公司治理层、战略定位、管理制度、内部控制等方面的评价。

定量分析是利用公司的财务和运营数据进行企业估值评估,主要包括对成长能力(收入增长率、营业收入利润增长率和净利润增长率等)、盈利能力(毛利润率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等)以及估值水平(市净率(PB)、市盈率(P/E)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市销率(PS)、自由现金流贴现、企业价值/EBITDA等)等指标的考察。

(三) 债券投资策略

在大类资产配置的基础上,本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略,把握债券市场投资机会,实施积极主动的组合管理,以获取稳健的投资收益。

1、久期管理

本基金将在对国内宏观经济要素变化趋势进行分析和判断的基础上,通过有效控制风险,基于对利率水平的预测和混合型基金中债券投资相对被动的特点,进行以“目标久期”为中心的资产配置,以收益性和安全性为导向调整债券组合。

2、期限结构配置

由于期限不同,债券对市场利率的敏感程度也不同,本基金将结合对收益率曲线变化的预测,采取下行的几种策略进行期限结构配置:首先采取主动型策略,直接进行期限结构配置,通过分析和情景测试,确定长期、中期、短期三种债券的投资比例,然后与数量化方法相结合,结合对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用不同投资组合中债券的期限结构配置。

3、确定类属配置

收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等因素基础上,进行类属的配置,优化组合收益。

4、个债选择

本基金在综合考虑上述配置原则基础上,通过对个体债券的价值分析,重点考察各债券的收益率、流动性、信用等级,选择相应的最优投资对象。本基金还将采取积极主动的策略,针对市场定价失误和回购套利机会等,在确定存在超额收益的情况下,积极把握市场机会。本基金在已有组合基础上,根据对未来市场预期的变化,持续运用上述策略对债券组合进行动态调整。

5、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市上的中小型企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市公司企业,企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司,信息披露情况相对滞后,对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司,且定向发行方式限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券的投资将重点关注信用风险和流动性风险。本基金采取自下而上的方法建立适合中小企业私募债券的信用评级体系,对个券进行信用分析,在信用风险可控的前提下,追求合理回报。本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良,估值合理且流动性相对充分的品种进行适度投资。

(四) 资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券平均久期和收益率曲线的影响,同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响,在严格控制信用风险暴露的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

(五) 衍生品投资策略

1.股指期货投资策略
本基金将根据股指期货管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要用于流动性好、交易活跃的品种。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的分析,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证装备产业指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%

中证装备产业指数是中证产业系列指数之一,反映沪深A股中装备产业公司股票的整体表现。全部样本由中证800样本中装备产业的个股组成,采用派许加权方法,按照样本股的调整股本数为权重加总计算。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围全面,具有广泛的代表性,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),能够很好地反映中国债券市场整体价格水平和变动趋势,适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

如果今后证券市场有其他代表性更强、或者指数编制方法停止编制该指数,或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况在履行适当的程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整,而无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照,不决定也不必然反映本基金的投資策略。

十一、风险收益特征

本基金为股票型证券投资基金,属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

十二、投资组合报告

本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。

本基金的托管人——中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月3日复核了本报告中的财务指标、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2015年9月30日,本报告所列财务数据未经过审计。

(一) 报告期末的基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	360,762,663.81	7.26
	其中:股票	360,762,663.81	7.26
2	固定收益投资	199,960,000.00	4.02
	其中:债券	199,960,000.00	4.02
	资产支持证券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	1,824,693,777.04	36.67
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	2,684,175,897.38	51.93
7	其他各项资产	6,649,492.95	0.13
8	合计	4,976,241,831.18	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	246,749,766.63	4.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	22,152,600.00	0.46
F	批发和零售业	26,095,992.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	14,533,827.00	0.29
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	5,258,166.56	0.11
M	科学研究和技术服务业	42,620,215.40	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	3,363,108.22	0.07
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	360,762,663.81	7.29

(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	000625	长安汽车	6,120,023	90,331,539.48	1.82
2	601633	长城汽车	1,490,963	48,799,218.99	0.99
3	300332	天壕环境	2,099,518	42,620,215.40	0.86
4	002594	比亚迪	430,400	26,828,304.00	0.52
5	000768	中航飞机	1,061,107	23,800,630.01	0.48
6	601618	中国中冶	3,692,100	22,152,600.00	0.46
7	002236	大华股份	454,503	15,366,746.43	0.31
8	300024	机器人	258,600	14,662,620.00	0.30
9	601021	春秋航空	129,536	14,533,827.00	0.29
10	600058	五矿发展	555,500	14,337,456.00	0.29

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合