

# 农银汇理工业4.0灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 2016年第1次更新 摘要

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
重要提示  
农银汇理工业4.0灵活配置混合型证券投资基金的募集申请经中国证监会2015年6月19日证监许可〔2015〕1305号文注册。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，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。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持份额享受基金的收益，但同时也也要承担相应的投资风险。本基金资产中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人本基金管理实施过程中产生的基金管理风险，某一基金的特有风险等。本基金为较高风险、较高预期收益的混合型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。投资有风险，投资者认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的投资业绩并不预示其未来表现。

本基金经理人已经对本招募说明书中涉及与更新业务相关的更新信息进行了复核、审查。招募说明书（更新）所载内容截止日为2016年2月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）公司概况

名称：农银汇理基金管理有限公司  
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层  
办公地址：上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼  
法定代表人：于进  
成立日期：2008年3月18日  
批准设立机关：中国证券监督管理委员会  
批准设立文号：证监许可〔2008〕307号  
组织形式：有限责任公司  
注册资本：人民币贰亿零壹元  
存续期间：持续经营  
联系人：崔爱东  
联系电话：021-61095588  
股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中国铝业股份有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

### （二）主要人员情况

1、董事会成员：  
于进先生：董事长  
金融硕士、高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息部副处长、处长、人事处处长、副总经理，电子银行总经理，科技与产品管理局局长。2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。  
Bernard Carayon先生：副董事长  
经济学博士。1978年起历任法国农业信贷银行集团督察员、中央风险控制部主管，东方汇理银行和东方汇理投资银行风险控制部部门主管，东方汇理资产管理公司管理委员会成员。现任东方汇理资产管理公司副总裁。  
许金超先生：董事  
高级经济师，经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行采购管理部总经理，中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。  
Thierry Mequillet先生：董事  
工商管理硕士。1979年开始从事银行工作，在Credit Agricole Indosuez 工作近15年并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，任香港地区总经理。1999年起至今任东方汇理资产管理香港有限公司亚太区行政总裁。  
谢尉志先生：董事  
工商管理硕士、高级会计师。1986年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司副总经理，并先后兼任中国铝业海外控股有限公司总裁、中铝矿业国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。

华若鸣女士：董事  
高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行国际业务部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行电子银行部副总经理。现任中国农业银行股份有限公司金融市场部总经理兼基金交易中心总经理、外汇交易中心总经理。  
王小卒先生：独立董事  
曾任香港城市大学助理教授、世界银行顾问、联合国顾问、韩国首尔国立大学客座教授。现任复旦大学管理学院金融系教授，兼任香港大学商学院名誉教授和挪威管理学院兼职教授。

傅晓寒先生：独立董事  
经济学博士，高级经济师。1973年起，任江苏省盐城汽车运输公司教师，江苏省人民政府研究中心科员。1990年3月起任东方财务咨询公司总经理。  
徐信忠先生：独立董事  
金融学博士、教授。曾任英国Bank of England货币政策政策局金融经济学家；英国兰卡斯特大学管理学院金融学教授；北京大学光华管理学院副教授、金融学教授。现任中山大学岭南（大学）学院院长、金融学院院长。  
2、公司监事  
Jean-Yves Glain先生：监事  
硕士。1996年加入东方汇理资产管理公司，历任销售部负责人、市场部负责人、国际事务协调和销售部副负责人。现任东方汇理资产管理公司国际协调与支持部负责人。

刘小武先生：监事  
1985年起在中国有色金属工业总公司、中国铜铅锌集团公司工作。2000年起历任中国铝业公司和中国铝业股份有限公司处长、财务部（审计部）主任和财务部总经理。2001年至2006年任中国铝业股份有限公司监事。现任中国铝业公司审计部主任、中国铝业股份有限公司审计部总经理。  
胡惠琳女士：监事  
工商管理硕士。2004年起进入基金行业，先后就职于长信基金管理有限公司、富国基金管理有限公司。2007年参与农银汇理基金管理有限公司筹建工作，2008年3月公司成立后任市场部总经理兼基金业务部负责人。  
项目管理部门：2002年起进入资产管理相关工作，先后就职于恒生电子股份有限公司、国联安基金管理有限公司。2007年加入农银汇理基金管理有限公司参与筹建工作，现任农银汇理基金管理有限公司运营部副总经理。  
杨晓玫女士：监事  
管理学学士。2008年加入农银汇理基金管理有限公司，现任综合管理部人力资源助理。  
3、公司高级管理人员  
于进先生：董事长  
金融学硕士、高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息部副处长、处长、人事处处长、副总经理，电子银行总经理，科技与产品管理局局长。2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。  
许金超先生：总经理  
高级经济师，经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行采购管理部总经理，中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。  
崔爱东先生：督察长  
高级工商管理硕士。1988年起先后在中国农业银行《中国城乡金融报》社、美国、伦敦担任处长、银行卡部工作。2004年11月起参加农银汇理基金管理有限公司筹备工作。2008年3月担任农银汇理基金管理有限公司董事会秘书、监稽核部总经理。2012年1月起任农银汇理基金管理有限公司督察长。

4、基金经理  
邬伟楠，上海交通大学硕士研究生。历任交银施罗德基金公司产品研究员、农银汇理基金公司基金经理助理。2015年3月3日起任农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金经理。2015年5月26日起任农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年8月13日起担任农银汇理工业4.0灵活配置混合型证券投资基金基金经理。  
5、投资决策委员会  
本基金采取集体投资决策制度。  
投资决策委员会由下述委员组成：  
投资决策委员会主席许金超先生，现任农银汇理基金管理有限公司总经理；  
投资决策委员会成员付娟女士，投资副总监兼任投资部总经理，农银汇理消费主题混合型证券投资基金基金经理、农银汇理中小盘混合型证券投资基金基金经理；  
投资决策委员会成员凌晨先生，研究部副总经理，农银汇理研究精选灵活配置混合型基金基金经理、农银汇理低估值高增长精选基金基金经理、农银汇理医疗保健主题股票型基金基金经理；  
投资决策委员会成员史向明女士，固定收益部总经理，农银汇理恒久增利债券型基金基金经理，农银汇理增强收益债券

型基金基金经理、农银汇理7天理财债券型基金基金经理、农银汇理主题轮动灵活配置混合型基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况  
名称：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号  
成立时间：1984年1月1日  
法定代表人：姜建清  
注册资本：人民币35,640,625.71万元  
联系电话：010-61081079  
联系人：洪渊  
（二）主要人员情况  
截至2015年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工205人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况  
作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产管理、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定资产管理计划、ODII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年9月，中国工商银行共托管证券投资基金406只。自2003年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球财经》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的49项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

1、直销机构：  
名称：农银汇理基金管理有限公司  
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层  
办公地址：上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼  
法定代表人：于进  
联系人：叶冰沁  
客户服务电话：4006895599、021-61095599  
客服电话：021-61096610  
网址：www.abc-ca.com  
2、代销机构：  
（1）中国农业银行股份有限公司  
住所：北京市东城区建国门内大街69号  
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号  
法定代表人：刘士余  
客户服务电话：95599  
网址：www.abchina.com  
（2）中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号  
法定代表人：姜建清  
传真：010-66107914  
客户服务电话：95588  
网址：www.icbc.com.cn  
（3）中国建设银行股份有限公司  
住所：北京市西城区金融大街25号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
法定代表人：王洪章  
联系人：张静  
客服电话：95533  
网址：www.ccb.com  
（4）交通银行股份有限公司  
住所：上海市银城中路188号  
办公地址：上海市银城中路188号  
法定代表人：牛锡明  
联系人：张宏革  
客服电话：95559  
网址：www.bankcomm.com  
（5）中信证券股份有限公司  
住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座  
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  
法定代表人：王东明  
联系人：陈忠  
电话：010-60833722  
传真：010-60833739  
客服电话：95558  
网址：www.citics.com  
（6）中信证券（山东）有限责任公司  
住所：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001  
办公地址：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001  
法定代表人：杨宝林  
联系人：吴志超  
电话：0532-85022326  
传真：0532-85022605  
客服电话：95548  
网址：www.citicssd.com  
（7）中信证券（浙江）有限责任公司  
住所：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层  
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层  
法人代表：沈强  
联系人：李珊  
电话：0571-88573737  
传真：0571-88106383  
客服电话：95548  
网址：www.bigsun.com.cn  
（8）中国银河证券股份有限公司  
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
法定代表人：田薇  
联系人：田薇  
电话：010-66568430  
传真：010-66568990  
客服电话：400-888-888  
网址：www.chinastock.com.cn  
（9）广发证券股份有限公司  
住所：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）  
办公地址：广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼  
法定代表人：孙树明  
联系人：黄岚  
电话：020-87555888  
传真：020-87555417  
客服电话：95575或致电各地营业网点  
网址：www.gf.com.cn  
（10）光大证券股份有限公司  
住所：上海市静安区新闸路1508号  
办公地址：上海市静安区新闸路1508号  
法定代表人：薛峰  
联系人：刘晨、李亚芳  
电话：021-22169011  
传真：021-22169134  
客服电话：4008888788、95525  
网址：www.ebscn.com  
（11）申万宏源证券有限公司  
注册地址：上海市徐汇区龙山路989号45层  
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层  
法定代表人：李梅  
联系人：黄维琳、陆臻琛  
电话：021-33388698  
传真：021-33388224  
客服电话：95523或4008895523  
网址：www.swhysc.com  
（12）中信建投证券股份有限公司  
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址：北京市朝阳区门内大街188号  
法定代表人：王常青  
联系人：权恒  
传真：010-65182261  
客户服务电话：400-888-8108  
网址：www.csc108.com  
（13）长江证券股份有限公司  
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦  
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦  
法定代表人：杨泽洋  
联系人：李良  
电话：027-65799999  
传真：027-85481900  
客户服务电话：95579；4008-888-999  
网址：www.95579.com  
（14）海天天基销售有限公司  
住所：上海市徐汇区龙阳路190号2号楼  
办公地址：上海市徐汇区龙阳路195号3C座3楼  
法定代表人：其实  
联系人：许云娜  
电话：021-54509898  
传真：021-64385308  
客服电话：400-1818-188  
网址：www.1234567.com.cn  
（15）上海好买基金销售有限公司  
住所：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号  
办公地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号  
法定代表人：杨文斌  
联系人：陆敏  
电话：021-20613999  
传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665  
网址：www.ehowbuy.com  
（16）深圳众合基金控股股份有限公司  
住所：深圳市罗湖区梨园路物控投资置地大厦8楼  
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物控投资置地大厦8楼  
法定代表人：薛峰  
联系人：董彩平  
电话：0755-33227950  
传真：0755-33227951  
客服电话：4006-788-887  
网址：www.zlfund.com  
（17）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
住所：北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦A座17层  
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦A座17层  
法定代表人：杨晓  
联系人：文雯  
电话：010-83363099  
传真：010-83363072  
客服电话：400-166-1188  
网址：http://.8rjir.com.cn.  
（18）和讯信息科技有限公司  
住所：北京市朝阳区朝外大街22 号泛悦大厦10 层  
法定代表人：王利  
电话：021-20835879  
传真：021-20835885  
联系人：刘英  
客服电话：400-920-0022  
网址：licaike.hexun.com  
（19）上海陆金所资产管理有限公司  
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元  
法定代表人：郭坚  
电话：021-20669592  
联系人：何雪  
客服电话：400-821-9031  
网址：www.lufunds.com  
（20）上海联泰资产管理有限公司  
住所：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6层  
法定代表人：燕斌  
电话：021-52822063  
传真：021-52975270  
联系人：陈东  
客服电话：4000-466-788  
网址：http://www.91fund.com.cn/index.html  
其它代销机构名称及其信息另行公告。  
（二）登记机构  
农银汇理基金管理有限公司  
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层  
办公地址：上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼  
法定代表人：于进  
联系人：杨绍信  
联系电话：(021)23233888  
传真：(021)23238800  
联系人：张勇  
经办注册税务师：江桂、张勇  
四、基金名称  
农银汇理工业4.0灵活配置混合型证券投资基金  
五、基金类型  
契约型开放式  
六、基金的投资目标  
本基金通过积极把握中国经济转型升级及工业4.0战略实施所带来的投资机会，精选工业4.0相关行业的优秀上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

七、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发行并上市的公司）、债券（包括国债、金融债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据等）、货币市场工具（包括短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等）、权证、资产支持证券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，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。  
基金的投资组合比例为：本基金的投资资产配置比例为基金资产的90%-95%，其中投资于本基金界定的工业4.0股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

八、投资策略  
1、大类资产配置策略  
本基金基于对宏观经济、政策面、市场面、资金面等因素综合分析，并根据股票资产、债券资产、现金类资产等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，在严格控制风险的前提下，确定并适时调整基金资产中股票资产、债券资产、现金类资产等大类资产的配置比例。  
2、股票投资策略  
（1）工业4.0主题的界定  
工业4.0，即以智能制造为主导的第四次工业革命，旨在通过移动互联网、云计算、物联网、大数据等新一代信息技术在制造业的集成应用，将制造业推向智能化。  
本基金所称的工业4.0主题相关股票是指上市公司中属于计算机、通信、传媒、电子、机械装备、家用电器、电力设备、军工、汽车和轻工制造的股票。本基金采用申银万国行业分类标准。

如果申银万国行业分类发生调整，行业分类方法发生变更，本基金将暂停发行行业分类或基金管理人认为有更适当的行业划分标准，基金管理人将在履行适当程序后可对工业4.0 主题相关股票的界定方法进行进行调整并及时公告。  
因上述原因使得本基金持有的工业4.0股票的比例低于非现金基金资产的80%，本基金将在三个月交易日之前进行调整。  
（2）个股投资策略  
本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法，通过定量方法与定性方法相结合的分析方法筛选个股。  
从定性方面来看，主要考察上市公司行业发展前景、行业地位、公司治理结构、创新能力等因素。通过研究行业发展的广度、深度，分析上市公司所处的竞争格局和推动上市公司持续增长的业务边界，对公司战略、管理团队、创新能力、盈利能力进行综合评估。  
从定量方面来看，主要考察上市公司的盈利能力（主要指标包括净资产收益率、毛利率、净利率、EBITDA/主营业务收入）、成长能力（主要指标包括EPS增长率和主营业务收入增长率）及估值水平（市盈率/P/E、市净率/P/B、市盈增长比率PEG、自由现金流贴现PCFV、企业价值/EBITDA等），通过财务和运营数据对上市公司进行评估，筛选出具备相对投资优势的上上市公司。

（3）优化配置投资品种  
本基金将根据宏观经济运行情况、货币市场及资本市场资金供求情况以及不同时期市场投资热点，分析国债、央票、金融债等不同债券种类的利差水平，评定不同债券属属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券属属之间配置比例。  
（4）谨慎选择个券  
在具体个券的选择上，本基金主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、收益率曲线形态变化预期、信用评析和流动性分析等方式，合理评估不同券种的风险收益水平，筛选出流动性较好、目标久期匹配、信用质量较好或预期信用质量将得到改善、风险水平合理、有较好下行安全边界特征的品种。  
4、权证投资策略  
本基金将从权证的投资证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个维度对拟投资权证进行研究分析，结合权证定价模型寻求合理估值水平，谨慎投资，在风险可控的基础上追求稳健收益。

5、资产支持证券投资策略  
本基金将投资于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，在严格控制法律风险的前提下，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。

定收益。

九、业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*65%+中证全债指数\*35%  
沪深300指数是由中证指数公司编制发布、表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证全债指数是覆盖交易所债券市场和银行间债券市场两大市场国债、金融债及企业债整体走势的指数，具有更广的覆盖面，成分债券的流动性较高，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又当市场出现更合适、更权威的比较基准，并且更接近本基金风格时，经基金托管人同意，报中国证监会备案，可选用新的比较基准，并将及时公告，调整业绩比较基准无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征  
本基金为混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。

十一、投资组合报告  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2016年2月26日复核了本招募说明书中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容。  
本投资组合报告所载数据截至2015年12月31日。  
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	145,703,963.21	78.36
其中：股票	145,703,963.21	78.36	
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	32,080,216.27	17.26
合计		8,141,807.56	4.38
9	合计	185,935,977.03	100.00

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	96,390,839.34	54.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,217,860.00	1.83
E	建筑业	3,490,112.00	1.87
F	批发和零售业	3,287,670.00	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	2,389,670.00	1.31
H	住宿和餐饮业	1,902,978.00	1.08
I	信息技术、软件和信息技术服务业	14,066,899.39	7.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,627,132.32	4.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,218,790.60	6.38
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	5,501,671.56	3.13
S	综合	-	-
合计		145,703,963.21	82.80

### 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	300279	和晶科技	277,200	13,804,560.00	7.84
2	600593	大连圣亚	184,500	9,481,465.00	5.39
3	300241	瑞丰光电	481,700	8,670,600.00	4.93
4	600083	博信股份	382,600	8,662,064.00	4.92
5	000835	长城动漫	387,400	8,650,642.00	4.92
6	002474	榕泰股份	330,200	7,908,290.00	4.49
7	002137	康达新材	331,400	7,622,200.00	4.33
8	000902	北京文化	162,397	5,501,671.56	3.13
9	002098	罗舜股份	264,500	5,480,570.00	3.11
10	300113	顺网科技	53,713	5,444,886.81	3.08

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券。  
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  
本基金本报告期末未持有债券。

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  
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明细  
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细  
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  
（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

（2）本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

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。  
（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

（3）本期国债期货投资评价  
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没有发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本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没有超出基金合同规定的备选股票库。

### （3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	249,258.92
2	应收证券清算款	637,238.55
3	应收利息	-
4	应收股利	5,082.23
5	应收申购款	7,250,227.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,141,807.56

（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。

### 十二、基金业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的投资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。本基金合同生效日为2015年8月13日，基金业绩数据截至2015年12月31日。

一、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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2015年8月13日-2015年12月31日	28.76%	1.84%	-2.75%	1.53%	31.51%	0.31%
基金成立至今	28.76%	1.84%	-2.75%	1.53%	31.51%	0.31%

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



1、本基金合同生效日为2015年8月13日，至2015年12月31日不满一年。  
2、基金的投资组合比例为：本基金的投资资产中股票资产占基金资产的90%-95%，其中投资于本基金界定的工业4.0股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低

于基金资产净值的5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

3、根据法律法规规定，本基金建仓期为自基金合同生效日起六个月，至2015年12月31日尚未建仓。

十三、费用概览  
（一）与基金运作有关的费用  
1、与基金运作有关费用种类  
1.基金管理人管理费；  
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事务所、律师费、仲裁费和诉讼费。  
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。

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1.5 %年费率计提。管理费的计算方法如下：  
H＝E×1.5 %÷当年天数  
H为每日应计提的基金管理费  
E为前一日基金资产净值

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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

上述“基金费用的种类中第3-9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。