

中银智能制造股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第2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 二〇一八年八月

重要提示
本基金经2016年6月4日中国证监会资产管理委员会证监许可[2015]1100号文备案注册。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,也不表明投资者对本基金没有风险。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者保证。

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,但不保证基金本金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

注册资本:489.35亿元人民币

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函[1987]14号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号

基金管理人:中信银行资产托管部
联系电话:4006800000
传真:010-85230024
客服电话:95585
网址:bank.chinait.com

2、主要人员情况
孙德顺先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行(国际)董事长。此前,孙先生于2014年5月至2016年7月任本行常务副行长;2014年3月起任本行执行董事;2011年12月至2014年5月任本行副行长,2011年10月起任本行党委副书记;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理副副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长;2005年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长,1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心(北京)等单位工作,期间,1995年12月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1999年1月至2004年4月曾兼任中国工商银行数据中心(北京)总经理;1981年4月至1984年5月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学,获经济学硕士学位。

张强先生,中信银行副行长,分管托管业务。张先生自2010年3月起任本行副行长。此前,张先生于2006年4月至2010年3月任本行行长助理、党委委员,期间,2006年4月至2007年3月曾兼任总行公司银行部总经理。张先生2000年1月至2006年4月任本行总行资产管理部总经理、常务副总经理和总经理;1990年9月至2000年1月先后在本行信贷部、济南分行和青岛分行工作,曾任总行信贷部副总经理、总经理、分行副行长和行长。自1990年9月至今,张先生一直为本行服务,在中国银行业有近三十年从业经历。张先生是高级经济师,先后于中南财经大学(现中南财经政法大学)、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生,现任中信银行资产托管部总经理,硕士研究生学历,高级经济师,教授级专家咨询员。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理专业。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997年加入中信银行,相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长、总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长,总行政管理部总经理。

四、相关服务机构
(一)基金销售服务机构
1、直销机构
中银基金管理有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼
法定代表人:章砚
电话:(021)38834999
传真:(021)68872488

1)中银基金管理有限公司直销柜台
地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
客户服务热线:(021-3883 4788, 400-888-5566
电子信箱:clientservice@bocim.com

2)中国银行股份有限公司
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1 号
公众地址:北京市西城区复兴门内大街1 号
法定代表人:陈四清
客户服务电话:95566
联系人:陈洪源
网址:http://www.bocim

3)交通银行股份有限公司
注册地址: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:彭纯
客户服务电话:95558
联系人:曹榕
网址: www.bankcomm.com

4) 中信银行股份有限公司
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
客户服务电话: 95558
联系人:赵树林
网址: /bank.chinait.com

5) 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
客户服务电话:95568
联系人:魏敏
公司网站: http://www.cmbc.com.cn

6) 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: 95561
公司网址: http://www.cib.com.cn

7) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙山路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人:束昱
客户服务热线:95021/4001818188
联系人:唐湘怡
网址: http://fund.louintmoney.com/

8) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:4000-766-123
联系人:胡蝶
网址:www.fund123.cn

9) 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区南1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:4007009665
联系人:王诗涛
网址:www.ehowbuy.com

10) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人:肖雯
客户服务电话:020-89629066
联系人:邵南琪
网址:www.yingmi.cn

11) 上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路589弄1号610室10号楼12楼
法定代表人:李兴春
客户服务电话:400-921-7755
联系人:陈霞明
网址:www.lefund.com.cn

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、27楼、45楼
法定代表人:章砚
电话:(021)38834999
传真:(021)68872488
联系人:宋娜
(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:上海市浦东新区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)31359666
传真:(021)31359500

经办律师:黎明、孙青
联系人:孙青

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
执行事务合伙人:毛敏宁
电话:010-58133000
传真:010-5818298
联系人:徐皓
经办会计师:徐皓、许培增

五、基金名称
中银智能制造股票型证券投资基金
六、基金的类型
股票型证券投资基金
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机会,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(包括中小板、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、分离交易可转债、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、银行承兑、货币市场工具),以及法律法规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的相关规定。
本基金股票投资占基金资产的比例范围为80-95%,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80%。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或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货期货需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

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)投资策略
1、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的绝对水平与增长率、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)来研判经济周期目前的位置以及未来发展的方向,在此基础上对各类资产的风险和预期收益进行风险分析,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。

2、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的方法,通过对智能制造主题相关的行业和股票票的深入研究与分析,挖掘该类上市公司的投资价值,分享制造业升级带来的投资机会。

1)智能制造主题的定义
本基金所指智能制造,是指把信息技术、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,以重大先进生产设备装备为核心的高端装备制造企业。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,一方面是制造业企业依托在线监测、远程诊断、云服务等为代表的智能服务,另一方面是制造业企业的互联网。

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及商业模式的发展,对智能制造主题相关行业的定义进行适时更新。

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、社会产业结构、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
本基金通过定性和定量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分析。竞争优势分析包括上市公司的市场地位、资源优劣势、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和拓展市场的潜力。治理结构分析包括对公司管理层、战略定位、管理制度、内部控制等方面的评价。

定量分析是从公司的财务和运营数据进行企业估值评价,主要包括营业收入能力(收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等)、盈利能力(毛利率、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(P/S)、自由现金流贴现、企业价值/EBITDA)等指标的比较。

3、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、收益率曲线配置和种资产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,以获取稳定的投资回报。

(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优势的特点,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,采取下面的几种策略进行期限结构配置:首先采取主动型策略,直接运用上述策略对债券组合的期限结构进行调整,确保长期、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)信用类属配置
收益率曲线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属债券流动性、税收以及信用资质等因素基础上,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,通过对个体证券的价值分析,重点考察债券的收益率、流动性、信用评级、选择期限最优的投资对象。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的小型型企业,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,企业治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,对企业整体价值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投资信用评级体系,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体系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背景、声誉地位、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、估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。

4、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、资产结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预测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及收益率曲线的影响,同时关注关键风险点变化对标的证券收益率的影响,在严格控制信用风险暴露程度的前提下,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。

5、衍生品投资策略
(1)股指期货投资策略
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过证券市场和期货市场运行趋势的研究,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,追求较稳定的当期收益。

(二)投资决策流程、机制和程序
1.投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同的相关规定;
(2)宏观经济形势、债券市场和证券市场走势。

2.投资决策机制
本基金管理人实行投资决策机制是:在投资决策委员会授权范围内,分管投资领导领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会:根据研究报告,负责制定整体投资策略和原则,审定季度资产配置调整建议和转换持仓组合的投资方案;参考投资报告,审定核心投资对象和范围,并定期调整投资策略和资产配置策略。

基金经理:在投资决策委员会的授权范围内,参考投资决策委员会的资产配置建议,行业投资比例和整体持仓的绝对和相对风险控制水平,决定整个资产组合的资产配置。

风险控制水平、增值性、稳定性、分散性和流动性等特征,并结合自身对证券市场的分析,判断,确定具体的投资品种、数量和买卖时间,构建和优化投资组合,并进行日常分析和调整。为有效控制投资组合风险,基金经理只有获得投资决策委员会的批准,才可以超越权限超越个别证券。

基金经理助理/投资分析员:通过内部调研和参考外部研究报告,定期提出宏观分析、行业分析、公司分析以及数据模拟的各类报告或建议,提交投资决策委员会,作为投资决策的依据。

数量分析人员:通过数量模型发现潜在投资机会,运用组合业绩评估系统,定期对投资组合中大类资产配置、行业配置、风格轮动、个股选择、个股选择、买卖成本等对整体业绩的贡献进行分析归因分析。风险管理人员对投资组合的风险进行分析、监控和报告。根据反馈结果,基金经理及时对组合进行必要的调整。

3.投资决策程序
本基金具体的投资决策机制和流程为:

(1)研究支持
研究人员从基本面对宏观经济、行业、个股、和市场走势提出研究报告,数量小组利用集成市场预测模型和风险控制模型对市场、行业、个股进行分析和预期收益测算。

(2)投资决策
投资决策委员会依据上述研究报告,定期(月)或遇重大事项时召开投资决策会议,决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理

的日常决策。
(3)组合构建
在投资决策委员会制定的投资原则和资产配置原则下,基金经理根据研究人员和数量小组的投资建议,结合自身对证券市场的分析判断,制定大类资产配置、行业配置及个股投资策略,在严格贯彻投资流程和风控纪律的基础上,严格控制风险构建投资组合,进行投资组合的构建和日常管理,并定期进行组合优化。

(4)交易执行
基金经理直接向集中交易室下达交易指令。集中交易室依据基金经理的指令,制定交易策略,统一执行投资组合计划,进行具体品种的交易,并将执行结果反馈基金经理确认。交易执行结束后,交易员填写交易回执,经基金经理确认后交给基金行政人员存档。

(5)业绩评估
数量小组风险控制小组利用公司开发的业绩评估系统,对投资组合中整体资产配置、投资组合、个股选择、个股选择、买卖成本等因素对整体业绩的贡献进行分析。该评估结果将为基金经理进行积极投资风险的控制和调整提供依据。

(6)组合维护
基金经理将根据市场状况,结合行业、个股的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整。

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权计算。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),能够很好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。

如果今后证券市场中有其他代表性更强,或者指数编制单位停止编制该指数,或者更权威机构认可的业绩比较基准出现,本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就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资业绩。

十一、风险收益特征
本基金为股票型证券投资基金,属于高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
基金管理人、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2018年7月18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2018年3月31日,本报告所列财务数据未经审计。

(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	1,685,746,455.51	83.26
	其中:股票	1,685,746,455.51	83.26
2	固定收益投资	125,097,552.26	6.67
	其中:债券	125,097,552.26	6.67
	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	--	--
6	银行存款及拆入的买入返售金融资产	--	--
7	其他资产	--	--
合计		2,024,570,442.87	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合