

# 德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第2号）

德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2015]1231号文注册募集。自2016年10月28日至2017年1月10日通过销售机构公开发售。本基金为契约型开放式基金。本基金的基金合同于2017年1月13日成立正式生效。

## 重要提示

德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2015年10月20日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1231号文准予募集注册，本基金的基金合同于2017年1月13日正式生效。

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作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财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者投资于本基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，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，由于基金投资组合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。本基金的特定风险详见招募说明书“风险提示”章节。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，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。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

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。

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。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年7月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。

一、基金管理人  
（一）基金管理人概况  
名称：德邦基金管理有限公司  
住所：上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层  
办公地址：上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层  
法定代表人：左轲  
成立时间：2012年3月27日  
组织形式：有限责任公司  
注册资本：人民币5.9亿元  
批准设立机关：中国证监会  
批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]249号  
经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务  
存续期间：持续经营  
联系人：刘利  
联系电话：021-26010999  
公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
德邦证券股份有限公司	70%
浙江省土产畜产进出口集团有限公司	20%
西子联合控股有限公司	10%

（二）主要人员情况  
1. 董事会成员  
左轲女士，董事长，硕士，国籍中国。现任德邦证券股份有限公司常务副总裁兼财务总监，中国证券业协会资产管理业务委员会副主任委员，中国证券投资基金业协会证券投资基金业务专业委员会委员。曾先后于华泰证券、东海证券工作，对于资产管理、固定收益等业务具有丰富的管理经验，同时在财富管理、资产证券化等领域颇有建树。

姚文平先生，董事，硕士，国籍中国。复星集团全球合伙人，现任复星集团副总裁，复星科技与金融集团总裁，德邦证券股份有限公司董事长，复星恒利证券有限公司董事长，中国证券业协会互联网金融专业委员会副主任委员，上海新金融研究院创始理事。曾先后于南京大学、华泰证券、东海证券工作，对于证券经纪、投资银行、固定收益、资产管理、股权投资等业务具有丰富的管理经验，同时在财富管理、资产证券化、对冲基金等方面颇有创新。

程兴华先生，董事，国籍中国，上海财经大学经济学博士，浙江大学理论经济学博士后，高级经济师，副研究员。现任浙江省国际贸易集团有限公司投资管理部总经理，曾任浙江省信托投资有限责任公司投资银行部负责人，金信信托投资股份有限公司投资银行总部总经理，中天发展控股集团有限公司投资总监，浙商金汇信托股份有限公司董事、董事会法务总监、总经理，浙江省国际贸易集团有限公司金融产业部总经理等职。

高初水先生，董事，国籍中国。现任西子联合控股有限公司财务部兼兼西子金融部总经理，中国注册会计师非执业会员，国际注册内部审计师、会计师。曾任新疆独山子二厂操作工，吉利汽车上海、桂林、宁波杭州湾等基地财务负责人，广汽集团萧山基地财务部长，西子联合控股有限公司海宁工厂财务总监。

易强先生，董事，硕士，国籍中国。现任德邦基金管理有限公司总经理、德邦创新资本有限责任公司董事长。曾任招商基金管理有限公司业务发展部副总监，比利时联合资产管理有限公司中国区业务发展总监，比利时联合资产管理有限公司上海代表处首席代表，元金元联基金管理有限公司总经理。

于彤先生，独立董事，硕士，国籍中国。现任北京利信科技股份有限公司董事。曾任帝华企业集团董事局副主席、副总裁，国务院扶贫办原扶贫培训中心主任，中国农垦经济发展中心主任，江苏省原江宁县县委副书记（挂职），原企业办公厅秘书、原国家计委办公厅秘书等职。

阮青松先生，独立董事，博士，国籍中国。现任同济大学经济与管理学院教授、美国凯斯西储大学金融硕士项目的特聘课程教授、上海市金融学会理事、上海市金融硕士教学指导委员会委员、同济大学金融硕士教学指导委员会主任，上海交通大学上海高级金融学院SAP-EMBA研究生导师等职。

吕炭先生，独立董事，硕士，国籍中国。现任上海融孚律师事务所高级合伙人、管委会委员，兼任中国全国律师协会理事、上海市律师协会副会长等职。

2. 监事会成员  
汤骏先生，监事会主席，硕士，国籍中国。现任德邦证券股份有限公司高级总裁助理兼财务管理部总经理，曾任安永华明会计师事务所金融服务部经理、高级经理、合伙人。此前先后在英国证券、第一证券以及普华永道工作。

王桦先生，监事，硕士，国籍中国。现任浙江省国际贸易集团有限公司经营管理部高级经理，曾任中国工商银行技术员，浙江省农信联社科员，浙江省国际贸易集团有限公司投资发展部高级主管。

王刚先生，职工监事，硕士，国籍中国。现任德邦基金管理有限公司监察稽核部副经理（主持工作），曾任天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理、职工董事、子公司监事。

茅彦文先生，职工监事，学士，国籍中国。现任德邦基金管理有限公司人力资源部总监，曾任太平养老保险股份有限公司、华泰财产保险有限公司人事经理等职。

3. 高级管理人员  
左轲女士，董事长，硕士。（简历请参见上述董事会成员介绍）  
易强先生，总经理，硕士。（简历请参见上述董事会成员介绍）  
汪晖先生，副总经理，硕士。曾任华泰证券股份有限公司研究员、投资经理、高级投资经理，华宝信托公司信托基金经理，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、投资总监，具有20年以上的证券投资管理经验。

宣培栋先生，副总经理，硕士。曾任任职于上海市第二工业大学、工商银行山东信托投资有限公司上海证券业务部，历任招商银行上海分行经理、金桥支行行长。

洪双龙先生，副总经理，硕士。曾任江苏省创业投资有限公司证券投资部研究员、投资经理助理；东海证券有限责任公司证券投资部、衍生品部投资部副经理、副总经理；德邦证券股份有限公司金融产品部、量化投资部总经理，资产管理总部联席总经理，信息技术部总经理。

李定荣先生，督察长，硕士。曾任长城证券研究员，华安证券研究所副所长，华富基金管理有限公司监察稽核部总监，元金元联基金管理有限公司监察稽核部总监。

4. 基金经理  
戴鹏涛先生，博士，从业19年。曾任中国人民保险集团公司投资管理部投资经理；天弘基金管理有限公司投资管理部负责人；中国出口信用保险公司资产管理部人民币业务处长、股票投资处主管；工银瑞信基金管理有限公司专户投资总监。2014年12月加入德邦基金，现任公司事业七部总监，担任德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金、德邦景顺债券型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5. 投资决策委员会成员  
汪晖先生，副总经理。（简历请参见上述高级管理人员介绍）  
黎莹女士，硕士，毕业于复旦大学基础医学专业，从业8年。曾任群益证券《医药行业》研究员。2014年4月加入德邦基金，现任公司研究部总监，担任德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金的基金经理。

张峰铮女士，硕士，毕业于北京交通大学技术经济及管理专业，从业10年。曾任安邦资产管理有限责任公司固定收益部投资经理、信用评估部研究员，中诚信国际信用评级有限责任公司评级部分析师。2015年11月加入德邦基金，现任公司固定收益部副总监，担任德邦德邦利货币市场基金、德邦如意货币市场基金、德邦增利货币市场基金、德邦纯债90天定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

王昌先生，硕士，毕业于上海交通大学应用数学专业，从业14年。曾任华泰柏瑞基金管理有限公司研究部高级数量分析师，投资部基金经理助理、基金经理、量化投资部基金经理，塔塔咨询服务服务有限公司业务分析师；济安信信科技服务有限公司金融工程师，济安陆博投资管理有限公司金融工程师。2015年8月加入德邦基金，现任公司金融工程与量化投资部总监，兼任组合基金投资部总监，担任德邦基金优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦量化新锐股票型证券投资基金（LOF）、德邦红利进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

房建敏先生，硕士，毕业于浙江大学化学工程专业，从业3年。曾任上海华谊工程有限公司化工设计工程师。2015年5月加入德邦基金，现任公司投资研究部基金经理

助理。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）  
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD  
法定代表人：彭纯  
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号  
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号  
邮政编码：200120  
注册时间：1987年3月30日  
注册资本：742.62亿元  
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[1998]25号  
联系人：陆志浩  
电话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行。总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2017年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本本位列第11位，较上年上升4位；根据2017年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第171位。

截至2018年3月31日，交通银行资产总额为人民币92667.97亿元。2018年1—3月，交通银行实现净利润归属于母公司股东）人民币200.91亿元。  
交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支勤勉勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

### （二）主要人员情况

彭纯先生，董事长，执行董事，高级会计师。  
彭先生2018年2月起任本行董事长，执行董事。2013年11月起任本行执行董事。2013年11月至2018年2月任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。  
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2018年3月31日，交通银行共托管证券投资基金350只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QDII证券投资基金、ROFII证券投资基金、ODII证券投资基金和ODLP资金等产品。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

1. 直销机构  
（1）德邦基金管理有限公司直销中心  
住所：上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层  
办公地址：上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层  
法定代表人：左轲  
联系人：王伟  
公司总机：021-26010999  
直销电话：021-26010928  
直销传真：021-26010960  
客服热线：400-821-7788  
（2）德邦基金管理有限公司网上直销平台  
网址：www.dbfund.com.cn

投资者可以通过基金管理人网站和其他网上直销平台办理本基金的认购、申购及赎回等业务，具体业务规则请参阅相关公告。

### 2. 销售机构

（1）交通银行股份有限公司  
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号  
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号  
法定代表人：彭纯  
联系人：王菁  
电话：021-58781234  
客服电话：95559  
公司网址：www.bank.com.cn  
（2）上海天天基金销售有限公司  
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
办公地址：上海市宛平南路88号26楼  
法定代表人：陶涛  
客服电话：400-181-8188  
联系人：王超  
电话：021-54509898  
传真：021-54509081  
网址：www.1234567.com.cn  
（3）深圳众禄基金销售有限公司  
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼  
办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼  
法定代表人：薛峰  
客服电话：4006-788-887  
联系人：童彩平  
电话：0755-33227950  
网址：www.zlfund.cn  
（4）浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址：浙江省杭州市文二西路1号903室  
办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大厦4层  
法定代表人：凌顺平  
客服电话：400-8773-772  
联系人：董一峰  
电话：0571-88911818  
传真：0571-86800423  
公司网址：www.5ifund.com

（5）其他销售机构具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

### （二）登记机构

名称：德邦基金管理有限公司  
住所：上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层  
办公地址：上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层  
法定代表人：左轲  
联系电话：021-26010999  
联系人：吴培金  
（三）出具法律意见书的律师事务所  
名称：上海市通志律师事务所  
住所：上海市银城中路68号10楼  
办公地址：上海市银城中路68号19楼  
负责人：俞卫锋  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：丁媛  
经办律师：黎明、丁媛  
（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（特殊普通合伙人）  
法定代表人：葛明  
住所：中国北京东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层  
办公地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层  
邮政编码：100738  
公司电话：010-58153000  
公司传真：010-85188288  
签字会计师：陈露、陶育化  
业务联系人：陶育化

## 四、基金的名

德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金

### 5. 基金的类型

本基金类型：契约型开放式、混合型证券投资基金

### 6. 基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，通过股票、债券等大类资产间的灵活配置，力求超越业绩比较基准的资产回报，为投资者实现资产长期稳健增值。

### 7. 基金的投资范围

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股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等）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相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为0-95%，投资于债券、债券回购、货币市场工具、现金、银行存款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的5%；每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交交易保证金后，应当保持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。权证、股指期货及其

他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

### 八、基金的投资策略

#### 1. 资产配置策略

本基金根据对经济周期和市场走势的判断，在权益类资产、固定收益类资产之间进行相对灵活的配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。

本基金战略性资产配置决策将从经济运行周期的变动，判断市场利率水平、通货膨胀率、货币供应量、盈利变化等因素对证券市场的影响，分析类别资产的预期风险收益特征，通过战略性资产配置决策确定基金资产在各大类资产类别间的比例，并参照投资组别风险评估报告，积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等种类资产的配置比例并实时动态调整。本基金同时还将基于经济结构调整过程中的动态变化，通过策略性资产配置把握市场时机，力争实现投资组合的收益最大化。

### 2. 股票投资策略

#### （1）行业配置策略

在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，对不同行业进行横向、纵向比较，并在此基础上判断行业的可持续发展能力，从而确定本基金的行业布局。

#### （2）个股投资策略

本基金将在确定行业配置之后在备选行业中，“自下而上”地精选出具有持续成长性、竞争优势、估值水平合理的优质个股。

1. 基本定性分析：本基金将重点考察分析公司投资价值、核心竞争力、公司治理结构、市场开发能力、商业模式优势、资源优势等方面的综合竞争实力，挖掘具有较大成长潜力的公司。

2. 价值定量分析：本基金通过对上市公司的成长能力、收益质量、财务品质、估值水平进行价值量化评估，选择价值被低估、未来具有相对成长空间的上市公司股票，形成优化的股票库。

### 3. 固定收益投资策略

债券投资方面，本基金亦采取“自上而下”的投资策略，通过深入分析宏观经济、货币政策和利率变化等趋势，从而确定债券的配置策略。同时，通过考察不同券种的收益率水平、流动性、信用风险等因素认识债券的核心内在价值，运用久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等投资策略进行债券组合的灵活配置。

对于中小企业私募债券而言，由于其采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，会导一定的流动性风险。同时，中小企业私募债券的发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差，进而整体的信用风险相对较高。因此，本基金在投资中小企业私募债券的过程中将从以下三个方面控制投资风险。首先，本基金将仔细甄别发行人资质，建立风险预警机制；其次，将严格控制中小企业私募债券的投资比例上限。第三，将对拟投资或已投资的品种进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资。

### 4. 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，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。

#### （2）权证投资策略

本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中以权证的市场价格分析为基础，以主动式的科学投资管理为手段，综合考虑股票合理价格、标的股票价格、结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证投资价值，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求基金资产稳定的当期收益。

### 5. 资产支持证券的投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产证券化产品的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%

沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且具有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的比较基准。一年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币存款基准利率，其能反映出本基金投资范围固定收益及现金类资产以达到获得持续稳定收益的目的。

如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须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，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。

### 十一、基金投资组合报告

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。基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，核对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止至2018年6月30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	133,748,893.64	83.75
	其中：股票	133,748,893.64	83.75
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	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	25,916,941.61	16.23
8	其他资产	40,032.84	0.03
9	合计	159,765,868.09	100.00

#### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,886,000.00	1.18
B	采矿业	9,063,700.00	5.70
C	制造业	62,563,160.01	39.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,542,850.95	1.60
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	6,003,300.00	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	8,888,283.38	5.57
H	住宿和餐饮业	3,508,612.80	2.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,707,070.46	7.35
J	金融业	13,765,889.90	8.64
K	房地产业	4,365,000.00	2.74
L	租赁和商务服务业	2,181,960.00	1.37
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.05
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	7,191,820.00	4.51
S	综合	—	—
	合计	133,748,893.64	83.95

#### （2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未有通过沪港通交易机制投资的港股。

#### 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	300003	乐普医疗	210,000	7,702,800.00	4.83
2	600028	中国石化	700,000	4,543,000.00	2.85
3	300188	美亚新科	248,000	4,538,400.00	2.85
4	600276	恒瑞医药	59,675	4,520,978.00	2.84
5	002563	森马服饰	265,000	3,646,500.00	2.29
6	600754	锦江股份	94,930	3,508,612.80	2.20
7	300055	欧普康视	77,398	3,468,978.36	2.18
8	600030	中信证券	200,000	3,314,000.00	2.08
9	601899	紫金矿业	820,000	2,960,200.00	1.86
10	601318	中国平安	50,000	2,929,000.00	1.84

#### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。