

(上接B065版)

联系人:高珊珊
电话:021-20211993
传真:021-20211993
客户服务热线:4000-888-080
网址:www.qianfondo.com
(83)北京尚特瑞财富管理有限公司
住所:北京市海淀区海淀大街2号B2101
办公地址:北京市海淀区中关村软件园二期三期N-1、N-2地块新浪总部大厦1101室
法定代表人:周明
电话:010-62677471
联系人:朱露露
客户服务热线:4000-888-080
网址: http://fund.fund.com
(84)北京新合鑫鑫基金销售有限公司
住所:北京市西城区西便门内大街2号215室
办公地址:北京市西城区西便门内大街2号215室
法定代表人:李志强
电话:010-63901233
联系人:李志强
客户服务热线:4000-888-080
网址: http://www.xhfc.com

(61)上海泰富资产管理(上海)有限公司
住所:上海市浦东新区东陆路1339号3楼3310室
办公地址:上海市浦东新区东陆路1339号3楼3310室
法定代表人:沈伟
电话:021-58285713
联系人:魏林
客户服务热线:4000-1199-811
网址: www.taifuam.com

(62)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区东陆路1339号3楼3310室
办公地址:上海市浦东新区东陆路1339号3楼3310室
法定代表人:沈伟
电话:021-58285713
联系人:魏林
客户服务热线:4000-1199-811
网址: www.taifuam.com

(63)浙江阳光基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市西湖区文苑路99号1幢1101室
办公地址:浙江省杭州市西湖区文苑路99号1幢1101室
法定代表人:陈刚
电话:0571-88911818
联系人:阮芳芳
客户服务热线:400-877-3772
网址: www.yinfund.com

(64)北京理财基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区望京东园四区1号楼22层22507
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区1号楼22层22507
法定代表人:李志强
电话:010-61949689
联系人:李志强
客户服务热线:400-0618-518
网址: https://danjiaapp.com/

(67)凤凰鑫信(四川)投资管理有限公司
住所:宁夏回族自治区银川市西夏区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402760000
办公地址:北京市朝阳区望京路18号望京高新科技产业园18号楼 (100000)
法定代表人:程刚
电话:010-51861017
联系人:李旭辉
客户服务热线:400-010-6199
网址: www.fenghuang.com

(88)深圳前海开源基金管理有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科技园南区天晖路18号8楼
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园南区天晖路18号8楼
法定代表人:王宇
电话:021-65689971
联系人:李南莉
客户服务热线:021-65370077
网址: http://www.fundf.com.cn/

(67)珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区阅江中路1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
电话:020-18962909
联系人:陈皓楠
客户服务热线:020-18962906
网址: www.yingmi.com

(68)深圳前海微众银行股份有限公司
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:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
电话:0755-83999607
联系人:李丹
客户服务热线:0755-83999607
网址: www.microweb.com

(69)上海浦东新区陆家嘴畔1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴畔1333号14楼09单元
法定代表人:郭奕
电话:021-20285952
联系人:李宇轩
客户服务热线:4000-1199-811
网址: www.fundf.com

(70)上海汇付金融服务有限公司
住所:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市虹口区虹口四川北路大厦7楼
法定代表人:吕世刚
电话:021-33323999
联系人:陈云奔
客户服务热线:4000213903
网址: www.huitui.com

(71)北京工银基金销售有限公司
住所:北京市西城区宣武门大街11号11层1108
办公地址:北京市西城区宣武门大街11号11层1108
法定代表人:王杨
电话:010-56828140
联系人:王杨
客户服务热线:400-618-0707
网址: www.industryfund.com

(72)上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路760号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号招信大厦4楼
法定代表人:陈健武
电话:021-63333319
联系人:李奕明
客服电话:4000-178-000
网址: www.pdbf.com

(73)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
法定代表人:沈伟
电话:021-50683533
联系人:魏林
客服电话:400-005-6356
网址: www.lidifund.com

(74)华泰证券股份有限公司
住所:南京市建邺区江东中路359号华泰大厦14-15楼A4/A506室
办公地址:上海市市长宁区虹桥路1386号光大大厦15楼A座
法定代表人:李洪源
电话:021-22888869
联系人:何庭宇
客户服务热线:400-928-2266/021-22267995
网址: www.htsc.com

(75)北京工银基金销售有限公司
住所:北京市西城区宣武门大街11号11层1108
办公地址:北京市西城区宣武门大街11号11层1108
法定代表人:王杨
电话:010-56828140
联系人:王杨
客户服务热线:400-618-0707
网址: www.industryfund.com

(76)北京天润基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路19号SOHO嘉盛中心30层3001室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:李俊
电话:010-56642600
联系人:李俊
客户服务热线:400-884-0500
网址: www.tianrun.com

(77)上海爱建基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
法定代表人:汪静
电话:021-62888888
联系人:汪静
客户服务热线:400-820-1515
网址: www.aifund.com

(78)北京创信投资管理有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路11号17层1717室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路11号17层1717室
法定代表人:魏林
电话:021-20638999
联系人:魏林
客户服务热线:400-820-1515
网址: www.chengxin.com

(79)上海泰富资产管理(上海)有限公司
住所:上海市浦东新区东陆路1339号3楼3310室
办公地址:上海市浦东新区东陆路1339号3楼3310室
法定代表人:沈伟
电话:021-58285713
联系人:魏林
客户服务热线:400-1199-811
网址: www.taifuam.com

(80)上海爱建基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
法定代表人:汪静
电话:021-62888888
联系人:汪静
客户服务热线:400-820-1515
网址: www.aifund.com

(81)上海爱建基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
法定代表人:汪静
电话:021-62888888
联系人:汪静
客户服务热线:400-820-1515
网址: www.aifund.com

(82)上海爱建基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609单元
法定代表人:汪静
电话:021-62888888
联系人:汪静
客户服务热线:400-820-1515
网址: www.aifund.com

行业综合评价,首先考察发行人历史和新增增长表现,对未来发行人增长和行业平均增长率进行预测,与前期预测值计算的增长率低于GDP增长率的行业进行剔除,然后根据艾罗穆德优势债券评估体系,对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序,挑选出未来一段时期内预期增长最快的行业。具体评估从宏观经济环境重点包括宏观经济政策、产业政策对相关产业发展的影响,行业景气度分析和预测关注上下游行业对本行业景气度影响,密切追踪行业景气度指标,行业财务状况与盈利能力,行业经营效率和行业景气综合表现四个维度入手,采用定性与定量相结合的分析方法对行业的未来的增长潜力进行综合评价。

最后,在完成对行业预期和信用评级基础上,通过市场及各个行业的相对和绝对估值水平PE、PB等数据的横向、纵向分析,进行估值比较,开展跨行业资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力,动态把握行业板块轮动最佳的投资机会。

3. 股票选择
本基金综合运用策略集成的股票研究方法组合及投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资价值且估值合理的优质个股,前述优质行业股票优先入选。具体分以下两个层次进行股票选择:

(1) 品质筛选
筛选出在公司治理、财务及管理素质符合基金品质要求的上市公司,构建选股策略,主要筛选指标包括:盈利能力指标(E/P、Cash Flow、P/CF、P/S、P/E2T等)、经营效率指标(ROE、ROA、Return on operating assets等)和财务状况指标(D/A、流动比率等)。(2) 多元化价值评估
本基金在上述行业选择体系的基础上,根据下述标准筛选出中具有投资潜力的上市公司构建核心股票池。
① 公司治理结构良好,管理规范,信息透明;
② 主营业务清晰,盈利能力,收入,净利润稳定增长;
③ 公司具有超越行业的增长性,通过控制成本费用提升盈利质量的目标(如 ROIC、WACC、EVA 等)进行评估,挑选EVA不断增长或改善的质优公司;
④ 公司财务状况良好,具备一定的规模优势和较强的抗风险能力;
⑤ 公司在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相应的核心竞争优势,有良好的市场知名度和较好的品牌效应,处于行业龙头地位。
对上述核心股票池中的重点上市公司进行内在价值和成长性跟踪研究,在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可靠的优质股票。

在债券投资方面,本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债可转换债券等债券品种,本基金的债券投资管理采取主动的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

在全球经济的框架下,本基金管理人将对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出前瞻性预判,具有良好的市场预判,投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取,用该数据指引投资决策和管理的逻辑,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,沪深300指数是目标衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时,根据本基金资产配置比例来分配权重,本基金的业绩比较基准中加入了综合考虑各指标并参照目标资产配置比例来构建。
如上所述,本基金的资产配置,或在有关法律法规允许发生变化,又或在法律法规限制,且经修改后,本基金的资产配置,或本基金的资产配置,将视情况调整业绩比较基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十、基金的风险控制特征
本基金是一只灵活运用的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金。本基金的资产配置策略主要应用于避险交易策略。

九、基金的投资业绩比较基准
本基金的整体业绩比较基准采用:
60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率
本基金管理人认为,沪深300指数和上海深圳证券市场选取300只A股作为样本编制而成,该指数对于沪深两市具有较高的市场代表性,投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取,用该数据指引投资决策和管理的逻辑,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,沪深300指数是目标衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时,根据本基金资产配置比例来分配权重,本基金的业绩比较基准中加入了综合考虑各指标并参照目标资产配置比例来构建。
如上所述,本基金的资产配置,或在有关法律法规允许发生变化,又或在法律法规限制,且经修改后,本基金的资产配置,或本基金的资产配置,将视情况调整业绩比较基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十、基金的风险控制特征
本基金是一只灵活运用的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金。本基金的资产配置策略主要应用于避险交易策略。

十一、基金的投资业绩比较基准
本基金管理人认为,沪深300指数和上海深圳证券市场选取300只A股作为样本编制而成,该指数对于沪深两市具有较高的市场代表性,投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取,用该数据指引投资决策和管理的逻辑,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,沪深300指数是目标衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时,根据本基金资产配置比例来分配权重,本基金的业绩比较基准中加入了综合考虑各指标并参照目标资产配置比例来构建。
如上所述,本基金的资产配置,或在有关法律法规允许发生变化,又或在法律法规限制,且经修改后,本基金的资产配置,或本基金的资产配置,将视情况调整业绩比较基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十、基金的风险控制特征
本基金是一只灵活运用的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金。本基金的资产配置策略主要应用于避险交易策略。

十二、基金的投资业绩比较基准
本基金管理人认为,沪深300指数和上海深圳证券市场选取300只A股作为样本编制而成,该指数对于沪深两市具有较高的市场代表性,投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取,用该数据指引投资决策和管理的逻辑,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,沪深300指数是目标衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时,根据本基金资产配置比例来分配权重,本基金的业绩比较基准中加入了综合考虑各指标并参照目标资产配置比例来构建。
如上所述,本基金的资产配置,或在有关法律法规允许发生变化,又或在法律法规限制,且经修改后,本基金的资产配置,或本基金的资产配置,将视情况调整业绩比较基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十、基金的风险控制特征
本基金是一只灵活运用的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金。本基金的资产配置策略主要应用于避险交易策略。

十三、基金的投资业绩比较基准
本基金管理人认为,沪深300指数和上海深圳证券市场选取300只A股作为样本编制而成,该指数对于沪深两市具有较高的市场代表性,投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取,用该数据指引投资决策和管理的逻辑,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,沪深300指数是目标衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时,根据本基金资产配置比例来分配权重,本基金的业绩比较基准中加入了综合考虑各指标并参照目标资产配置比例来构建。
如上所述,本基金的资产配置,或在有关法律法规允许发生变化,又或在法律法规限制,且经修改后,本基金的资产配置,或本基金的资产配置,将视情况调整业绩比较基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十、基金的风险控制特征
本基金是一只灵活运用的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金。本基金的资产配置策略主要应用于避险交易策略。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	股权投资	1,356,729,592.94	70.62
2	货币资金	1,356,729,592.94	70.62
3	应收利息	-	-
4	应付利息	-	-
5	资产减值准备	-	-
6	公允价值变动资产	412,400,798.89	21.44
7	持有待售金融资产	144,746,380.84	7.52
8	其他流动资产	1,923,797,316.46	100.00
9	合计	1,356,729,592.94	71.16

2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 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	-	-
B	医药	5,914,343.00	0.30
C	制造业	487,223,079.39	24.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,558.05	0.00
E	建筑业	5,184,006.74	0.27
F	批发和零售业	92,746,068.66	4.82
G	交通运输、仓储和邮政业	31,744,650.00	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	446,113,534.69	23.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	69,588,354.73	3.59
L	租赁和商务服务业	10,527,074.20	0.56
M	公用事业	16,919,204.00	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	631,163.29	0.03
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	76,223,224.00	4.04
R	文化、体育和娱乐业	106,242,546.04	5.58
S	综合	-	-
合计		1,356,729,592.94	71.16

2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

本本基金本报告期末未持有通过港股投资的股票。

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	300065	恒顺新材	6,711,938	138,079,880.94	7.36
2	300188	美亚光电	7,010,128	128,269,263.76	6.86
3	603096	航新装备	661,175	62,202,674.90	3.33
4	002944	奥圣股份	3,272,086	76,222,228.00	4.04
5	2021000	奕东电子	3,272,086	62,467,622.28	3.33
6	300529	润建股份	1,465,209	62,242,711.32	3.32
7	300061	泰富证券	248,327	56,447,053.00	3.00
8	300070	长信科技	3,477,068	66,567,167.84	3.59
9	300012	华测检测	9,724,640	65,819,204.00	3.56
10	603096	航新装备	1,434,447	68,183,074.73	3.61

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十名贵金属投资明细

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
本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

11. 投资组合报告附注
(一) 本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一个月内本基金投资的前十名证券的发行人未受到公开谴责和处罚。

(二) 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同约定的备选股票之外的股票。

(三) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应收利息	476,044.61
2	应付利息	-
3	应收股利	-
4	应收申购款	164,742.53
5	其他应收款	9,180,790.96
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,180,574.69

(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的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由“四.5.2.1 基金的投资”中基金的投资”部分予以补充。

十一、基金的投资业绩
本基金管理人认为,沪深300指数和上海深圳证券市场选取300只A股作为样本编制而成,该指数对于沪深两市具有较高的市场代表性,投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取,用该数据指引投资决策和管理的逻辑,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,沪深300指数是目标衡量本基金股票投资业绩的理想基准。同时,根据本基金资产配置比例来分配权重,本基金的业绩比较基准中加入了综合考虑各指标并参照目标资产配置比例来构建。
如上所述,本基金的资产配置,或在有关法律法规允许发生变化,又或在法律法规限制,且经修改后,本基金的资产配置,或本基金的资产配置,将视情况调整业绩比较基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十、基金的风险控制特征
本基金是一只灵活运用的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益高于股票型基金和债券型基金。本基金的资产配置策略主要应用于避险交易策略。

注:艾罗穆德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德优势行业灵活配置混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型后的基金净值表现,转型后基金的业绩比较基准由“60%×沪深300指数收益率+40%×沪深300国债指数收益率”变更为“60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率”,详见见本基金管理人于2012年9月28日发布的《艾罗穆德保本混合型证券投资基金关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关法律文书的公告》。



注:艾罗穆德优势行业灵活配置混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德优势行业灵活配置混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型后的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

2. 基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

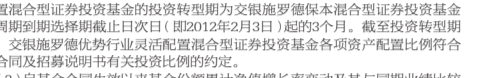
(1) 自基金转型以来以基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

艾罗穆德优势行业灵活配置混合型证券投资基金业绩走势图(2012年2月3日至2018年12月31日)



注:艾罗穆德优势行业灵活配置混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德保本混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

艾罗穆德保本混合型证券投资基金业绩走势图(2009年1月21日至2012年2月2日)



注:艾罗穆德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德保本混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

艾罗穆德保本混合型证券投资基金业绩走势图(2009年1月21日至2012年2月2日)



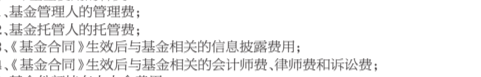
注:艾罗穆德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德保本混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

艾罗穆德保本混合型证券投资基金业绩走势图(2009年1月21日至2012年2月2日)



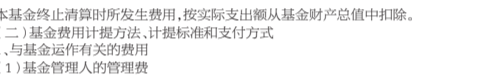
注:艾罗穆德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德保本混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

艾罗穆德保本混合型证券投资基金业绩走势图(2009年1月21日至2012年2月2日)



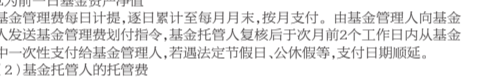
注:艾罗穆德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德保本混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

艾罗穆德保本混合型证券投资基金业绩走势图(2009年1月21日至2012年2月2日)



注:艾罗穆德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德保本混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

艾罗穆德保本混合型证券投资基金业绩走势图(2009年1月21日至2012年2月2日)



注:艾罗穆德保本混合型证券投资基金从2012年2月3日起正式转型为艾罗穆德保本混合型证券投资基金。本表列示的是基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率。

艾罗穆德保本混合型证券投资基金业绩走势图(2009年1月21日至2012年2月2日)

