

## 建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2018年第1号

**基金管理人:建信基金管理有限责任公司**  
**基金托管人:兴业银行股份有限公司**  
二〇一八年十月  
【重要提示】

本基金经中国证监会管理委员2017年 6月2日证监许可〔2017〕840号文准予注册募集。本基金的基金合同于2007年3月5日正式生效。

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投资价值、市场前景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财产,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,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、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,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。

本基金的封闭运作期间,基金份额持有人不能申购、赎回、转换基金份额,因此,若基金份额持有人错过某一开放期而未能赎回,其份额将自动转入下一封闭期,至少到下一开放期方可赎回。

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高风险/风险特征的基金。

基金业绩比较基准为20%\*“中证500指数收益率+80%”中证全债指数收益率,但本基金的收益水平有可能不能达到或超过同期的目标收益率水平,投资者面临获得低于目标收益率甚至亏损的风险。

投资有风险,投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

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。

## 一、基金管理人

一、基金管理人概况  
名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
设立日期:2005年9月19日  
法定代表人:孙志晨  
联系人:郭雅莉  
电话:010-66228888  
注册资本:人民币2亿元  
建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下:中国建设银行股份有限公司,65%;美国信安金融服务公司,25%;中国华电集团资本控股有限公司,10%。

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司治理机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东大会依法行使权利,不以任何形式直接或间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事,根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权,对公司基本制度的制定和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司监事会,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

二、主要人员情况  
1、董事会成员  
孙志晨先生,董事长,高级经济师,享受国务院特殊津贴,中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章获得者。1983年毕业于辽宁财经学院基建财务与信用专业,获学士学位。历任中国建设银行筹资储蓄部副主任,零售业务部副总经理,个人银行部副总经理,营业部主要负责人、总经理,个人银行业务部总经理,个人银行业务委员会副主任,个人金融部总经理,2006年5月起任中国建设银行河南省分行行长,2011年3月出任中国建设银行批发业务总监,2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生,董事,现任建信基金管理有限责任公司总裁,兼建信资本管理公司董事长。1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长,中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生,董事,现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理,北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行总行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生,董事,现任信安亚太亚地区副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕。历任新加坡公共事务委员会副部长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,信诚基金公司首席运营官和代总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事。

郑明先生,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席运营官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理,新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长,爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场部总监。

王淑薇女士,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学,获经济学博士学位。历任中国建设银行北京分行农村工作部记者,湖南卫视《我非非道》财经节目组运营总监,锦辉控股集团中国区副总裁,锦辉精细化工有限公司总经理,吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理,财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理,光大证券财富管理中心总经理(MD)。

李全先生,独立董事,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院,1988年毕业于中国人民大学研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理,博时基金管理有限公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生,独立董事,曾任大新人寿保险有限公司首席行政员,中银保诚退休信託管理有限公司董事,英国保诚保险有限公司首席行政员,美国国际保险集团亚太区资深副总裁,美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获Pacific Southern University 工商管理硕士学位。  
伏军先生,独立董事,法学博士,现任对外经济贸易大学法学院教授,兼任中国法学会国际经济法研究会常务理事、副秘书长,中国国际金融法专业委员会副主任。

2、监事会成员  
张军红先生,监事会主席。毕业于国家行政学院行政管理专业,获博士研究生学位。历任中国建设银行筹资储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员;零售业务部主任科员;个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理;行长办公室秘书一处高级副经理级秘书,秘书、高级经理;投资托管服务部总经理助理、副总经理;投资托管业务部副总经理;资产托管业务部副总经理。2017年3月起任公司监事会主席。

方晋敏女士,监事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区总监和美国国际集团全球意外及健康保险集团副总裁等职务。1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限公司机构与风险管理部经理。1992年获北京工业大学会计专业学士学位,2009年获中央财经大学会计专业硕士学位。历任北京信奥有限公司、中进会计师事务所、中瑞华恒信会计师事务所、中国华电集团财务有限公司计划财务部助理、副经理,中国华电集团资本控股(华电财务公司)计划财务部经理,中国华电集团财务有限公司财务部经理,中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

尹冰女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司,历任人力资源部专员、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副总经理,英国特许公认会计师公会(ACCA)资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

安辉先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系,获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部,中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长,建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理,信息技术部执行总经理、总经理。

3、高级管理人员  
孙志晨先生,总裁(简历请参见董事会成员)。

张威威先生,副总裁。1997年毕业于大连理工大学,获学士学位;2003年毕业于大连理工大学,获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁分行筹资资料科、主任科员;中国建设银行总行人行零售业务部主任科员、高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任建信基金管理有限责任公司副副总监。

曲寅军先生,副总裁。1996年毕业于中国人民大学,获学士学位;1999年毕业于中国人民大学,获硕士学位。曾任中国建设银行总行审计部科员,副主任科员;团委主任科员;重组改制办公室高级副经理;行长办公室高级副经理。2005年9月起就职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监,投资管理部副总监,专户投资部总监和公司首席战略官。2013年8月起,任建信基金管理有限责任公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理,并于2015年8月6日起任建信基金管理有限责任公司副副总监。

吴昊明先生,副总裁,硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行,先后在总行营业部、金融结构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,历任科员、副主任科员,主任科员,机构业务部高级副经理等职;2006年3月加入我公司,担任董事会秘书,并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长,

2016年12月23日起任我公司副副总监。

吴灵玲女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作;2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部,历任副主任科员、业务经理、高级经理助理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副副总监。

4、督察长  
吴鹰明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。  
5、本基金基金经理  
薛玲女士,2009年3月获北京航空航天大学计算机系博士学位。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院电网电配电研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4月在路通世纪公司工作,任亚洲数据收集部门高级软件工程师;2013年4月至2015年8月在中建投证券有限责任公司工作,历任量化投资研究员、投资经理;2015年9月加入建信基金任基金经理助理,2016年7月4日起任建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;2017年5月27日起任建信鑫盛回报基金的基金经理;2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理;2017年9月28日起任深证基本面60ETF及其联接基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员  
张军红先生,总裁。  
姚 颖女士,权益投资部总经理。  
李 菁女士,固定收益投资部总经理。  
乔 梁先生,研究部总经理。  
许 杰先生,权益投资部副总经理。  
朱 虹女士,固定收益投资部副总经理。  
陶 灿先生,权益投资部总经理助理。  
7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

一、基金托管人情况  
名称:兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)  
注册地址:福建省福州市湖东路154号  
办公地址:上海市江宁路168号  
法定代表人:高建平  
成立时间:1988年8月22日  
注册资本:207.74亿元人民币  
存续期间:持续经营  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]174号  
托管部门联系人:刘峰  
电话:021-52629999  
传真:021-62159217  
2、发展概况及财务状况  
兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本207.74亿元。

开业二十多年来,兴业银行始终坚持“真诚服务,相伴成长”的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2017年12月31日,兴业银行资产总额达6.42万亿元,实现营业收入1399.75亿元,全年实现归属母公司股东的净利润720.00亿元。三、托管业务部的部门设置及主要人员  
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室。

## 三、相关服务机构

一、基金销售机构  
1、直销机构  
本基金直销机构为基金管理人直销柜台以及网上交易平台。  
(1)直销柜台  
名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
法定代表人:孙志晨  
联系人:郭雅莉  
电话:010-66228800  
(2)网上交易平台  
投资者可以通过基金管理人网上交易平台办理基金的认购、申购、赎回、定期投资等业务,具体业务办理情况及相关规则请登录基金管理人网站查询。  
基金管理人网址:www.ccbfund.cn。

2、其他销售机构  
其他销售机构的具体名单详见基金份额发售公告。  
基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的其他机构销售本基金,并及时公告。

二、基金份额登记机构  
名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
法定代表人:孙志晨  
联系人:郑文广  
电话:010-66228888  
三、出具法律意见的律师事务所  
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21楼  
负责人:俞卫锋  
电话:021-31358666  
传真:021- 31358600  
联系人:陆奇  
经办律师:黎明、陆奇  
四、审计基金资产的会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路318号星展银行大厦507单元01室  
办公地址:上海市湖南路202号普华永道中心11楼  
法定代表人:李丹  
联系人:沈兆杰  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238800  
经办注册会计师:许康伟、陈燕

## 四、基金的名称

建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

混合型证券投资基金。

## 六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险并持有资产流动性的前提下,充分利用较低风险的证券投资策略,力争为投资者提供持续、稳定的回报。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、中期票据、短期融资券)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、权证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。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%-40%。开放期内,每个交易日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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,封闭期可不受上述5%的比例限制。在封闭期内,每个交易日终在扣除股指期货期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人可在履行适当程序后,可以做出相应调整。

## 八、基金的投资策略

(一)封闭期投资策略  
本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的一类资产配置策略动态调整本基金在各大类资产间的分配比例;然后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体到大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略五个部分组成。  
1、大类资产配置策略  
本基金将在基金合同约定的投资范围内,结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析,自上而下地实施积极的大类资产配置策略。主要考虑的因素包括:  
(1)宏观经济指标:年度/季度GDP增速、固定资产投资总量、消费价格指数、采购经理人指数、进出口数据、工业增加值、客运量及货运量等;  
(2)政策因素:税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策,利率水平、货币市场投放等货币政策;

(3)市场指标:市场整体估值水平、市场资金的供需以及市场的参与情绪等因素。

结合对全球宏观经济的研判,本基金将在严格控制投资组合风险的前提下,动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例,力图规避市场风险,提高资产配置效率。

2、股票投资组合策略  
本基金运用建信多因子选股模型,依托公司投资团队的研究成果,精选股票,力争在最佳时机选择估值合理、基本面优良且具有持续成长潜力的股票进行适度的优化配置。

(1)行业精选  
本基金对各行各业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度等因素进行综合评估,对景气周期处于拐点或者处于上升阶段的行业进行适度重点配置。

(2)个股精选

A、价值分析  
本基金对上市公司的多种财务指标,以及上市公司在行业中的竞争地位等多方面的因素进行综合评估,挖掘上市公司的投资价值。

B、成长性分析  
本基金将重点关注企业的持续增长潜力,对公司内部因素进行深刻理解和分析,挖掘上市公司保持高成长性业绩增长的驱动因素及其可持续性,从而优选出竞争力优良、成长潜力高于平均水平的上市公司。

4、督察长  
吴鹰明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。  
5、本基金基金经理  
薛玲女士,2009年3月获北京航空航天大学计算机系博士学位。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院电网电配电研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4月在路通世纪公司工作,任亚洲数据收集部门高级软件工程师;2013年4月至2015年8月在中建投证券有限责任公司工作,历任量化投资研究员、投资经理;2015年9月加入建信基金任基金经理助理,2016年7月4日起任建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;2017年5月27日起任建信鑫盛回报基金的基金经理;2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理;2017年9月28日起任深证基本面60ETF及其联接基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员  
张军红先生,总裁。  
姚 颖女士,权益投资部总经理。  
李 菁女士,固定收益投资部总经理。  
乔 梁先生,研究部总经理。  
许 杰先生,权益投资部副总经理。  
朱 虹女士,固定收益投资部副总经理。  
陶 灿先生,权益投资部总经理助理。  
7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

(2)信用债券投资策略  
根据国民经济运行周期阶段,分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用级别,确定企业债券、公司债券的信用风险等级。  
债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息,同时需要考虑企业的经营环境等外部因素,着重分析企业未来的偿债能力,评估其违约风险水平。

(3)套利交易策略  
在预期分析同一市场不同板块之间(比如国债与金融债)、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利率差基础上,基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下,比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破,若能提前预测并进行交易,就可进行套利或减少损失。

(4)可转换债券投资策略  
着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究,同时兼顾其债券价值和转换期权价值,对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。

基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析,包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等,并参考同类公司的估值水平,研判发行公司的投资价值;基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析,判断其债券投资价值;采用期权定价模型,估算可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析,综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,制定可转换债券的投资策略。

4、资产支持证券投资策略  
本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

5、金融衍生品投资策略  
(1)国债期货投资策略  
国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析,构建量化分析体系,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

(2)股指期货投资策略  
本基金进行股指期货投资以套期保值为目的,投资方法是择时对冲,即根据策略目标仓位,综合考虑股指期货的基差情况、现货的超额收益情况及市场其他因素,决定股指期货所占的仓位。当标的指数期货存在两种及两种以上近月合约时,本基金将利用各类近期合约的择机转换策略从而获取一定的基差收益。

(3)权证投资策略  
本基金还可能运用组合资产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具;

A、运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要通过波幅套利及风险对冲策略实现对冲收益;

B、构建权证与债券的组合,利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性,形成保本投资组合;

C、针对不同的市场环境,构建增持组合、减持组合、蝶式组合等权证投资组合,形成多元化的盈利模式;

D、在严格风险监控的前提下,通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究,谨慎参与以杠杆放大为目的的权证投资。

(二)开放运作期投资策略  
开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资A安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。

若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。

九、基金的业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:20%\*“中证500指数收益率+80%”中证全债指数收益率

## 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低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高风险/风险特征的基金。

## 十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

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	286,466.38	0.14
	其中:股票	286,466.38	0.14
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
4	资产支持证券	--	--
5	贵金属投资	--	--
6	金融衍生品投资	--	--
7	买入返售金融资产	18,000,000.00	8.67
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
8	银行存款和结算备付金合计	184,798,188.68	87.98
9	其他资产	6,666,028.16	3.31
9	合计	210,029,673.29	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	--	--
B	采矿业	146,088.00	0.07
C	制造业	69,206.00	0.03
D	电力、热力、燃气及生产供应业	12,180.00	0.01
K	建筑业	28,388.00	0.01
F	批发零售业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,000.36	0.02
J	金融业	--	--
L	房地产业	--	--
M	租赁和商务服务业	--	--
N	科学研究和技术服务业	--	--
O	教育	--	--
P	综合	--	--
合计		286,466.38	0.14

以上行业分类以2018年6月30日的证监会行业分类方法为依据。

(2)报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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	600759	洲际油气	23,100	91,014.00	0.04
2	000426	兴源矿业	7,100	54,075.00	0.03
3	002668	奥马电器	2,500	50,260.00	0.02
4	300324	康辰药业	4,215	40,000.36	0.02
5	300197	联华生物	3,600	19,320.00	0.01
6	000499	金隅股份	1,800	12,180.00	0.01
7	002051	中汇医药	950	7,620.00	0.00
8	002011	信达生物	1,000	6,400.00	0.00
9	600746	圆通速递	2,000	2,560.00	0.00
10	002431	棕榈股份	300	2,013.00	0.00

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十名债券投资明细  
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。

(1)报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约价值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1807	IC1807	17	17,639,200.00	-1,470,480.00	--
公允价值变动总额合计(元)				-1,470,480.00	--
股指期货投资本期收益(元)				-626,840.00	--
股指期货投资公允价值变动(元)				-1,741,840.00	--

(2)本基金股指期货期货的投资政策  
本基金股指期货投资股指期货风险管理的原则,以套期保值为主要目的,综合考虑基成本、流动性等因素选择合适的股指期货合约。本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

10、报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

(1)本期国债期货投资政策  
本基金报告期内未投资于国债期货。

(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投资国债期货。

(3)本期国债期货投资评价  
本报告期末本基金未投资国债期货。

11、投资组合报告附注  
(1)本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中,奥马电器于2017年7月15日公告称:因财务报告违规收到中国证券监督管理委员会广东监管局出具的《关于对广东奥马电器股份有限公司采取责令改正的决定》(【2017】21号)。

(2)基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,717,792.83
2	应收证券清算款	1,129,270.89
3	应收利息	--
4	应收股利	--
5	应收申购款	2,108,866.44
6	其他应收款	--
7	预付款项	--
8	其他资产	--
9	合计	6,956,029.16

(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债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	00075				