

中金金泽量化精选混合型发起式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:中金基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
二〇一八年十月

重要提示

中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请于2017年6月16日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017] 929号《关于准予中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册,并于2017年9月1日经中国证监会基金监管部机构部函[2017]218号《关于中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2017年9月1日生效。

本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投资价值、收益及市场前景做出实质性判断或保证,也不表明其对本基金没有风险。

中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)投资于证券及期货市场,基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于:市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、估值风险、操作及技术风险、合规性风险、本基金特有的风险、税收增加风险、其他风险等。本基金投资品种中包含中小企业私募债券,中小企业私募债券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。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发生主体信用资质恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金属于混合型基金,其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券型投资基金,低于股票型证券投资基金。

投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险,并不充分考量自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

本基金基金份额分为A、C两类,其中A类基金份额收取申购费,不计提销售服务费;C类基金份额不收取申购费,但计提销售服务费;A、C两类基金份额适用不同的赎回费率。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

投资有风险,投资人认购/申购本基金时应认真阅读本招募说明书及其更新。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本更新招募说明书己经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2018年8月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:中金基金管理有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层
法定代表人:林寿康
成立时间:2014年2月10日
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〔2014〕97号
组织形式:有限责任公司
注册资本:3亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:张磊
联系电话:010-63211122
公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	100%

(二)主要人员情况
1.基金管理人、董事会成员
林寿康先生,董事长,货币经济学博士。历任国际货币基金组织国际经济学家;香港金融管理局货币管理部高级经理,德意志银行(香港)新兴市场经济学家;中国信达资产管理公司国际部副经理。现任中国国际金融股份有限公司投资管理委员会委员、首席、董事总经理。

黄劲峰先生,董事,机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所(英国及香港)审计、核算实习生、副经理、经理等职务;香港汇丰银行资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理职务;高盛(亚洲)、高盛集团(日本东京)固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务;北京高华证券有限责任公司中后台协调、风险管理岗位;高盛(亚洲)有限责任公司资产管理部亚太区首席运营官、亚太(除日本)首席运营官、产品研发主管和董事总经理职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、董事(除日本)。

陈刚先生,董事,法学博士。历任国务院发展研究中心技术经济研究所研究人员;北京泽沛律师事务所律师;中国国际金融股份有限公司合规律师、中国国际金融(香港)有限公司合规律师、中金美国投资有限公司法律部负责人;厚朴香港投资咨询有限公司法律合规事务负责人。陈刚先生是纽约州执业律师并具有中国律师执业资格。现任中国国际金融股份有限公司合规总监、董事总经理。

孙菁女士,董事,管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副总经理、公司管理部副总经理、运营支持部执行总经理及负责人等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。

赵望先生,董事,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部经理、中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。

李永先生,董事,工商管理硕士。历任中国人保资产管理有限公司交易员、风险监控员、投资经理;中国人寿资产管理有限公司养老企业及机构业务部投资经理、固定收益团队负责人、固定收益投资经理、高级投资经理、一级团队负责人;中国人寿资产管理有限公司固定收益投资委员会成员、自有资金投资委员会委员。现任中金基金管理有限公司副总经理。

张春先生,独立董事,经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大学卡尔森管理学院金融系终身教授,中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系主任、副教授长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长。

颜羽女士,独立董事,经济法学硕士、EMBA硕士。历任云南政法干部管理学院教师;四通集团法务部法律咨询副主任;海润律师事务所证券业务律师;嘉和律师事务所合伙人。现任嘉源律师事务所创始合伙人。

曹大伟,独立董事,哲学博士。历任北京大学光华管理学院党委书记、党委副书记、党委书记,北京大学医学部副主任、财务部部长、北京大学副总会计师等职务。现任神州软件股份有限公司董事。

2.基金管理人监事
夏静女士,执行监事,理学硕士。历任普华永道(深圳)咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制管理部经理;中国国际金融股份有限公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司风险管理部负责人。

3.基金管理人高级管理人员
林寿康先生,董事长,货币经济学博士。简历同上。
孙菁女士,总经理。简历同上。
李永先生,副总经理。简历同上。
李虹女士,督察长,法学硕士。历任美国众达律师事务所北京代表处律师;中国国际金融股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。

4.本基金基金经理
王玉女士,管理学硕士。历任天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员;中国国际金融股份有限公司高级研究员、投资经理助理、投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

杨立先先生,经济学硕士。历任民生证券股份有限公司证券投资助理、证券投资经理;华融证券股份有限公司中投投资经理、高级投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部副总经理。

5.投资决策委员会成员
李永先生,副总经理。简历同上。
王雁杰先生,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部行业研究员,定向资产管理业务投资经理,集合资产管理计划投资经理。现任中金基金管理有限公司董事总经理、权益投资负责人、专户投资经理投资经理。

郭爱钰先生,工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理,华泰证券项目经理,德恒证券高级经理,华策投资有限公司投资副经理;招商基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

石玉女士,简历同上。
朱宝臣先生,理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部执行总经理,量化投资总监;现任中金基金管理有限公司量化投资部执行总经理。

杨立先先生,经济学硕士。简历同上。
6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
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:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿零玖仟柒佰肆拾柒万肆仟捌佰玖拾陆元整
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[1998]12号
联系人:田丹
联系电话:(010)6759 5096
中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年4月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末,本集团总资产216,920.67亿元,较上年末增加7,283.62亿元,增幅3.47%。上半年,本集团实现利润总额1,720.93亿元,较上年同期增长1.3%,净利润较上年同比增长3.81%至1,390.09亿元,盈利水平实现平稳增长。
2016年,本集团先后获得国内外知名机构授予的130余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”、《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”、“机构投资者”“人民币国际化服务钻石奖”、《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额连续位列全球第2;在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产管理业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产管理处、理财信托投权市场处、OFI托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管部上海业务中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常态化的内控工作手段。

(二)主要人员情况
纪伟,资产管理业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行,总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产管理业务部副总经理,曾就职于中国建设银行北京市分行国际部,营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
郑昕,资产管理业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部,委托代理处,战略客户处,长期从事客户营销、信贷资产管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀娟,资产管理业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原丁,资产管理业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海内外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国际金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构
1、直销中心
(1)直销柜台
名称:中金基金管理有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层
法定代表人:林寿康
电话:010-63211122
传真:010-66159121
联系人:张磊
客户服务电话:400-868-1166
网站:www.ciccfund.com
(2)网上直销
交易系统:中金基金网上交易系统
交易系统网址:trade.ciccfund.com

2、其他销售机构
(1)中国光大银行股份有限公司
客服电话:95565
网站:www.ceibank.com
(2)包商银行股份有限公司
客服电话: 96362
网站: www.bah.com.cn
(3)上海天天基金销售有限公司
客服电话:400-991-8918
网站:http://fund.eastmoney.com
(4)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楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-20613999
传真:021-68606919
客服电话:400-700-9665
网站:www.ehowbuy.com
(5)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
客服电话:4000-766-123
网站: www.fund123.cn
(6)通华财富(上海)基金销售有限公司
客服电话: 96166转9
网站: https://www.tonghuafund.com
(7)北京恒天明泽基金销售有限公司
客服电话:400-888-0618
网站:http://www.chtfund.com
(8)北京汇成基金销售有限公司
客服电话:400-619-9069
网站:www.fundzonen.com
(9)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
客服电话:4006199868
网站:www.tdyhfund.com
(10)上海展翼基金销售有限公司
客服电话:400-820-5369
网站:www.zyfund.com.cn
(11)北京蛋宝基金销售有限公司
客服电话:400-068-1176
网站:www.jidufund.com
(12)上海陆金所资产管理有限公司
客服电话:4008219031
网站:www.lufunds.com
(13)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
客服电话:400-098-8511
网站: http://jdt.jr.com/index.html
(14)北京康景基金销售有限公司
客服电话:400-061-8518
网站: https://danjinq.com/
(15)洪泰财富(青岛)基金销售有限公司
客服电话:4006709683
网站:www.hongtaiwealth.com
(16)银河证券股份有限公司
客服电话: 96551
网站: http://www.chinastock.com.cn/
(17)华泰证券股份有限公司
客服电话:96597
网站: http://www.htsc.com.cn
(18)长城证券股份有限公司
客服电话:400-6666-888
网站: http://www.ccwm.com/
(19)平安证券有限责任公司
客服电话:96511
网站:http://stock.pingan.com
(20)中国中投证券有限责任公司
客服电话:96532
网站: http://www.china-invs.cn/
(21)太平洋证券股份有限公司
客服电话:400-665-0999
网站: www.tpyzq.com
(22)济安财富(北京)基金销售有限公司
客服电话:400-673-7010
网站: http://www.jiantfortune.com
(23)北京德信基金销售有限公司
客服电话:010-56077518
网站:www.zhixiniv.com
(24)南京苏宁基金销售有限公司
客服电话:96177
网站:www.snjifund.com
(25)浙江蚂蚁花呗基金销售有限公司
客服电话:4008-773-772
网站:www.5ifund.com

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构的公告。

(二)登记机构

名称:中金基金管理有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层
法定代表人:林寿康
电话:010-63211122
传真:010-66155673
联系人:白嫄

(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219楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358606
经办律师:安冬、盛奇
联系人:安冬

(四)审计基金资产的会计师事务所
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层
执行事务合伙人:邵东
电话:010-85085000
传真:010-85185111
签字注册会计师:程海良、管彬
联系人:程海良

四、基金的名称

五、基金的类型与运作方式

(一)基金的类型
混合型证券投资基金。

(二)基金的运作方式
契约开放式。

六、基金的投资目标
本基金通过数量化模型合理配置资产,精选个股,在充分控制投资风险的前提下,力求实现基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的证券投资基金,包括中国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的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债))、可交换债券、短期融资券、中期票据等,债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、同业存单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)。

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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为50%-96%;在每个交易日终,在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的履约保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

本基金的量化模型从策略配置出发,投资框架涵盖理论驱动型策略、数据驱动型策略和混合策略三大类别,其中,理论驱动型策略注重基本面分析的因素策略以及密集使用量价关系的动量、反转策略,数据驱动型策略包括模式识别策略、机器学习策略。本基金在资产配置中将使用模型动态适配各策略类别的比重,强调投资纪律,降低随意性投资带来的风险,力争基金资产长期稳定增值。

(一)量化配置策略
本基金以量化配置策略管理各策略的相应头寸,采用科学的优化方法与完整的资产配置框架,估算各个子策略收益/风险指标以及相关性,以最大程度分散风险,提高收益/风险比为目标,在流动性许可的前提下,动态调整各个子策略的实际权重,提高基金组合整体表现。

(二)量化选股策略
(1)股票多因子选股策略
本策略采用多因子选股方法,秉承基本面和技术面分析相结合的理念,模型中纳入考察的因子不仅包括影响整个股票市场走势的宏观因子,如GDP、PPI、CPI、利率等;也涵盖短中期内可能显著作用个股并且具有经济意义的基本面指标,包括价值、成长性、质量、规模等因子;更覆盖在A股市场中尤其有效的量价指标,包括动量、反转、波动、换手四大类技术因子以及资金面因子。通过对因子的量化分析,综合评价个股,把握超额收益,同时剔除不稳定性背后的因子收益稳定性,精选最能代表短期强势因子的个股构建多头组合,力争创造长期稳定的超额收益。本策略具备设计完善的风控模型,针对不可预测的个股风险进行充分分散。同时,进行盘后分析构建的因子模型可定期监测,总结策略收益或损失来源。

(2)股票中低波动趋势策略
本策略通过对证券市场的运动趋势进行系统性回溯研究,通过分析市场资金、情绪、风险偏好等关键信息把握大势,试图在一定的置信度内预测行业的短期方向与趋势持续程度。以此为依据构建行业超额收益组合,并在模型设置趋势结束或侦测到市场有转折迹象退出。

(3)事件驱动策略
本基金观察事件可能造成股价异常波动的事件,把握其影响股价的原因和持续期,通过对过往事件发生时个股投资回报的量化分析,分离出事件冲击下的异常收益并寻求统计规律,获取事件影响所带来的超额预期回报率分布情况,并以此判断一类事件的投资价值。策略中包括定向增发、业绩预告、业绩超预期、次新股投资、股权激励等传统事件类别,还包含分级基金套利等广义事件。同时,模型也将持续跟踪关注可能显著影响个股短期走势的新事件。

(4)中高频配对交易统计套利策略
本基金通过对股票大量数据的回溯研究,用量化统计分析找出市场内部单个个股或个股之间的稳定性关系,估计其概率分布并确定该分布的极端区域。若短期股价出现异常波动发生极端情形,可以借由计算机快速捕捉机会,等待股票价格表现恢复正常后退出。

(5)其他投资策略
(1)债券投资策略
本基金使用量化利率模型、信用模型分析债券的合理价值,构建风控模型限制债券组合的久期、信用风险和流动性风险。一方面发现固定收益证券长期配置价值,另一方面发掘债券由于短期价值失衡带来的投资机会,动态调整配置稳定收益,与其它市场相关性低的债券投资组合。

(2)中小企业私募债券投资策略
本基金对中小企业私募债券的投资策略主要基于信用品种投资,在此基础上重点分析信用风险及流动性风险。首先,确定投资周期所处阶段,研究中小企业私募债发行人所处行业在经济周期中所受的影响,以确定行业总体信用风险的变动情况,并投资具有积极因素的行业;其次,对中小企业私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力进行综合分析;最后,结合中小企业私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素,综合评价中小企业私募债的信用风险和流动性风险,选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

(3)股指期货投资策略
本基金通过对期货市场及其标的指数运行趋势的系统性量化研究,估算其短期内价格的变化方向以及变动幅度,寻求其在情绪而带动下所能达到的短期估值水平,构建趋势投资策略;另一方面,研究期限价变动的统计规律,计算股指期货的理论价值,采用恰当的套期保值方法管理现货头寸。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

(4)国债期货投资策略
本基金投资国债期货以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

(5)权证投资策略
在进行权证投资时,基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究,辅助运用权证定价模型寻求其合理估值水平,根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性,通过限制投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(6)资产支持证券投资策略
本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展,将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,制定周密的投资策略。在具体投资过程中,重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型、预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的总体规模,选择风险调整后收益高的品种进行投资,实现资产支持证券基金资产的最佳增值。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。
中证800指数成份股由中证500和沪深300成份股一起构成,中证800指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况;中债综合指数是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),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。基于本基金资产配置比例以及中证800指数和中债综合指数的特征,选用该业绩比较基准能够反映本基金的风险收益特征。

今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人协商基金托管人后可以报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召集基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金属于混合型基金,其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金,低于股票型证券投资基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人根据本基金合同规定,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,报告期间为2018年1月1日至2018年6月30日。本报告财务数据未经审计。

11.1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	15,497,115.50	83.16
1.1	其中:股票	15,497,115.50	83.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,758,231.00	14.80
3.1	其中:债券	2,758,231.00	14.80
4	资产支持证券	-	-
4.1	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	100,000.00	0.04
6.1	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和拆入资金	213,321.06	1.14
8	其他资产	66,794.62	0.36
9	合计	18,635,322.17	100.00

11.2报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	427,440.00	2.34
C	制造业	7,062,310.70	38.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	713,622.00	3.80
E	建筑业	723,024.00	4.01
F	批发和零售业	31,964.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	106,620.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,666,000.00	20.03
K	房地产业	2,471,643.00	13.15
L	租赁和商务服务业	283,694.80	1.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
合计		15,497,115.50	84.89

11.3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	600309	万华化学	25,200	1,144,584.00	6.26
2	600897	伊泰股份	31,100	987,880.00	4.74
3	600811	格力电器	17,000	891,560.00	4.28
4	900002	万科A	31,100	774,900.00	4.23
5	600036	招商银行	28,000	740,280.00	4.06
6	601068	中国建发	134,400	733,584.00	4.01
7	601398	工商银行	128,000	689,960.00	3.72
8	600048	保利地产	53,200	649,040.00	3.56
9	600104	上汽集团	17,320	613,374.70	3.36
10	601061	中国太保	18,000	574,300.00	3.13

11.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,100,110.00	601	3.25
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	-	-	-
4	其他金融债	-	-	-
5	企业债券	-	-	-
6	企业短期融资券	-	-	-
7	中期票据	1,668,221.00	908	4.90
8	可转债(可交换债)	-	-	-
9	其他	-	-	-
10	合计	2,768,331.00	15.07	

11.5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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019571	17国债17	11,000	1,100,110.00	6.01
2	132020	17广核03	10,800	1,061,480.00	5.76
3	132002	16天集团	5,000	533,500.00	2.92
4	123015	18广核03	760	75,230.00	0.40

11.6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。

11.7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
本报告期末,本基金未持有贵金属。

11.8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
本报告期末,本基金未持有权证。

11.9报告期末本基金投资的国债期货情况说明

11.9.1本期国债期货投资政策
本报告期末,本基金未持有国债期货。

11.9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

11.9.3本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

11.10股指期货投资附注
11.10.1本基金本报告投资前十名证券的发行主体,除招商银行(600036)外,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年6月4日,中国银行业监督管理委员会江苏监管局行政处罚决定书(银监罚决字【2018】1)号,称招商银行内控管理严重违反审慎经营规则;违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;违规将票据贴现资金直接划回出票人账户;为同业投资