

中金新安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要

(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

二〇一八年十一月
重要提示
中金新安灵活配置混合型证券投资基金的募集申请于2015年7月6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[2015]1616号《关于准予中金新安灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,并于2017年3月29日经中国证监会证券投资基金机构监管部函[2017]841号《关于中金新安灵活配置混合型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3月29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。2017年2月8日经中国证监会[2017]307号文批复准予延期募集。

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。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。

中金新安灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“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,投资者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、操作风险、技术风险、合规性风险、本基金特有风险、税负增加风险、其他风险等。本基金为混合型基金,其长期平均风险水平和预期收益低于股票型基金,但高于债券型基金和货币市场基金。投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本基金招募说明书。
基金管理人提醒投资本基金投资的“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。
基金管理人承诺依照恪尽职守、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。本更新招募说明书已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9月28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06室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43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:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监许可〔2014〕197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:张盟
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主任。现任中国国际金融股份有限公司投资管理委员会委员、董事总经理。

黄晓峰先生,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、核算见习生、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、董事总经理。

陈朔先生,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;北京世泽律师事务所律师;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、中金美国证券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。陈朔先生是纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。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。现任中金基金管理部总经理。

赵壁先生,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;中国人资产管理有限公司养老金及机构业务部投资经理、固定收益团队负责人、固定收益部投资经理、高级投资经理、一级团队负责人、中国人资产管理有限公司固定收益投资决策委员会、自有资金投资决策委员会委员。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。

顾羽女士,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;四通集团条法部法律咨询主任;海润律师事务所证券业务部律师;嘉和律师事务所合伙人。现任嘉润律师事务所律师合伙人。

冒大卫,独立董事,哲学博士。历任北京大学光华管理学院团委书记、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。现任神州泰岳股份股份有限公司董事。

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服务部经理;中国国际金融股份有限公司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。

汤淑女士,硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理,华安基金管理有限公司零售业务部副总经理。现任中金基金管理有限公司副总经理。

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
郭宽铭先生,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总经理;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风险管理部执行总经理。

5.投资决策委员会成员
李永先生,工商管理硕士,简历同上。
郭宽铭先生,工商管理硕士,简历同上。

王鼎先生,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、专户投资部投资经理。

石玉女士,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。

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级投资经理、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。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

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:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
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2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码039),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.05亿元,增幅6.08%。

2017年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”、美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017年全球1000强”中列第2位;在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托投资市场处、OFII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,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315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,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行担任南通分行、总行计划财务部、信贷管理部任职,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,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),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,长期从事信托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。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事中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。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原丁,资产托管业务部副总经理,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)基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户(R)、CPIII、(R)ODII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管967只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1、直销机构
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06室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人:林寿康
电话:010-63211122
传真:010-66159121
联系人:张盟
客户服务电话:400-868-1166
公司网站:www.ciccfund.com

(2)网上直销
交易系统:中金基金网上直销系统
直销系统网址:https://trade.ciccfund.com/etrade

(3)其他销售机构
(1)中国中投证券有限责任公司
客服电话:400-600-8008、95532
网址: http://www.china-inv.cn

(2)北京虹点基金销售有限公司(原“北京乐融多源投资咨询有限公司”)
地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
网址: https://www.hongdianfund.com/

电话:010-85643800
(3)北京汇成基金销售有限公司
客服电话:400-619-9069
网址: www.hcjijin.com

(4)平安证券有限责任公司
客服电话:95511-8
网站: http://stock.pingan.com

(5)上海陆金所资产管理有限公司
客服电话:400-821-9031
网站: www.lufunds.com

(6)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:上海市浦东新区南汇118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人:杨文斌
联系人:王诗琦
电话:021-20613999
传真:021-68606919
客服电话:400-700-9665
网站: www.ehowbuy.com

(7)上海天天基金销售有限公司
客服电话:400-991-8918
网址: http://fund.eastmoney.com

(8)北京恒天明泽基金销售有限公司
地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号 SOHO 嘉盛中心 30 层
法定代表人:周斌
客服电话:4008890618
网站: www.chtfund.com

(9)上海联泰资产管理有限公司
客服电话:400-166-6788
网址: http://www.66zichan.com

(10)交通银行股份有限公司
地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
客服电话:95559
网址: www.bankcomm.com

(11)上海万得投资管理有限公司
客服电话:400-821-0203
网站: www.520fund.com.cn

(12)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
客服电话:4000-766-123
网站: www.fund123.cn

(13)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
客服电话:95118
网址: http://fund.jd.com

(14)上海陆享投资管理有限公司
客服电话: 021-33366675
网站: http://www.luxxfund.com/

(15)中国建设银行股份有限公司
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:王洪章
客户服务电话:95533
网站: www.ccb.com

联系人:王琳
(16)中国光大银行股份有限公司
客服电话:95656
网站: www.cebbank.com

(17)中国国际金融股份有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路1号国贸大厦27层及28层
法定代表人:丁学东
客户服务电话:010-65051166
网站: www.cicc.com.cn

联系人:杨涵宇
(18)长城证券股份有限公司
客服电话:400-6666-888
网站: http://www.cgws.com/

(19)银河证券股份有限公司
客服电话: 95551
网站: http://www.chinastock.com.cn/

(20)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
客户服务电话:0755-82133145
网站: http://www.guosen.com.cn/

联系人:李皓
(21)上海基煜基金销售有限公司
客服电话:4008-205-369
网站: https://www.jiyufund.com.cn/

(22)和讯信息科技有限公司
客服电话:400-920-0022
网站: http://www.licaike.com

(23)北京康泰基金销售有限公司
客服电话:4000618518
网站: http://danjuanapp.com/

(24)上海挖财金融信息服务有限公司
客服电话:021-50810673
网站: www.wacaijijin.com

(25)通华财富(上海)基金销售有限公司
客服电话:95166
网站: https://www.tonghuafund.com

(26)洪泰财富(青岛)基金销售有限公司
客服电话:4006706863
网站: www.hongtaiwealth.com

(27)北京鼎顺耀华投资咨询有限公司
客服热线:400-819-9868
网站: www.tdyhfund.com

(28)北京植信基金销售有限公司
客服电话:010-5675718
网站: www.zhixin-inv.com

(29)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.jianfortune.com

(30)南京苏宁基金销售有限公司
客服电话:95177
网站: www.snjijin.com

(31)浙江同花顺基金销售有限公司
客服电话:4008-773-772
网站: www.5ifund.com

(32)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
网站: www.taichengcaifu.com
电话:400-0411-001

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06室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人:林寿康
电话:010-63211122
传真:010-66155573
联系人:白娜

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海通力律师事务所
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19楼

负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:白红、安冬
联系人:安冬
(四)审计基金财产的会计师事务所
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:邹俊
电话:010-85085000
传真:010-85118511
签字注册会计师:程海良、李砾
联系人:程海良

四、基金的名称

中金新安灵活配置混合型证券投资基金

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
运作方式为契约型开放式,存续期限为不定期。

六、基金的投资目标

在风险可控的前提下,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。

七、基金的投资方向

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上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转债债券)、次级债、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,基金管理人可在履行适当程序后,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0-95%;在每个交易日日终,在扣除股指期货合约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。

八、基金的投资策略

本基金的投资策略主要包括大类资产配置策略、固定收益类资产配置策略、权益类资产配置策略以及期货投资策略。

(一)大类资产配置策略
本基金将采用“自上而下”的分析方法,综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素,分析比较债券市场、股票市场、及现金类资产的风险收益特征,动态调整各大类资产的投资比例,控制投资组合的系统性风险。

(二)固定收益资产配置策略
本基金投资组合在进行固定收益类资产的投资时,主要通过分析宏观经济形势、货币政策、财政政策、债券市场供求关系及资金供求关系,主动判断市场利率变化趋势,确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。

1、利率策略
本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,积极主动的预测未来的利率趋势。根据相关因素的研究判断调整组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期。

2、债券类属配置策略
本基金将根据国债、金融债、公司债、企业债、短融和中期票据等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较好收益。

3、信用债投资策略
本基金将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,进行个债的精选,结合适度分散的行业配置策略,动态调整各大类资产的投资比例,控制投资组合的系统性风险。

4、期限结构配置策略
本基金将对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,在给定组合久期以及其他组合约束条件的情况下,确定最优的期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

5、骑乘策略
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。当债券收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的时候,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,对应的将是债券价格的走高,进而获得资本利得收益

6、息差策略
本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,以期获取超额收益的操作方式。

(三)权益类资产配置策略
本基金将重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业,并重点关注个别股的安全边际及绝对收益机会。在股票选择方面,充分发挥“自下而上”的主动选股能力,结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长能力的判断,结合财务与估值分析,深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司,构建股票投资组合。同时将根据行业、公司状况的变化,基于估值水平的波动,动态优化股票投资组合。

(四)期货投资策略
本基金的期货投资主要为对冲策略。本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货的投资。本基金将按照现货头寸和股票特性,使用量化方法剥离并测算整体的市场风险,进而动态调整期货对冲的数量,以达到对冲市场风险。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势;中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。基于本基金资产配置比例以及沪深300指数和中证全债指数的特征,选用该业绩比较基准能较反应本基金的风险收益特征。

今后法律法规发生变化,或者有更权威的、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基准的指数时,本基金管理人协商基金托管人后可以按照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、风险收益特征

本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金,高于债券型证券投资基金和货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人承诺基金投资组合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06月30日,报告期间为2018年01月1日至2018年06月30日。本报告财务数据未经审计。

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	50,500,143.84	50.46
其中:股票	50,500,143.84	50.46	
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	17,666,880.00	17.66
其中:债券	17,666,880.00	17.66	
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	22,800,000.00	22.78
其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—	
7	银行存款和结算备付金合计	8,628,434.09	8.62
8	其他资产	481,720.66	0.48
9	合计	100,077,178.89	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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	426,236.00	0.44
B	采矿业	1,501,227.00	1.54
C	制造业	33,398,417.57	34.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	365,555.00	0.37
E	建筑业	1,292,898.00	1.32
F	批发和零售业	1,323,534.00	1.36
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	5,808,943.00	5.96
J	金融业	1,697,992.59	1.74
K	房地产业	2,709,258.88	2.77
L	租赁和商务服务业	619,076.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	851,022.00	0.87
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	—	60,500,143.84	61.69

(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601336 新华保险	39,543	1,696,003.84	1.74
2	600048 保利地产	114,865	1,401,353.00	1.43
3	600383 金地集团	128,352	1,307,966.88	1.34
4	002415 海康威视	30,000	1,113,900.00	1.14
5	601877 正泰电器	49,400	1,102,608.00	1.13
6	002332 仙明制药	121,960		