

华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2018年第1号)

基金管理人:华安基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

二〇一八年十二月

重要提示

本基金于2018年2月28日经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]369号注册,进行募集。本基金基金合同自2018年4月27日正式生效。

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和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作及技术风险,本基金的特有风险等。本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”),将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金是股票型基金,风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金;本基金在股票型基金中属于指数型基金,主要采用完全复制法紧密跟踪标的指数的表现,本基金的表现与标的指数的表现密切相关。

本基金初始面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。因折算、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低本基金投资风险或提高基金投资收益。

本基金目前提供场内现金申赎,未来在条件允许的情况下,基金管理人可以在场内开通本基金现金申购、赎回以外的方式办理本基金的申购、赎回业务或开通本基金的场外申购、赎回等业务。

在目前结算规则下,投资者当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回,即T日申购的基金份额,T日交收成功后,T+1日可卖出和赎回。当买入日的基金份额,当日可以赎回。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》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、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,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。

投资者一旦认购、申购或赎回本基金,即表示对基金认购、申购和赎回所涉及基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及申购、赎回对价的方式已经认可。

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它基金的表现并不构成对本基金业绩表现的保证。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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,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。

本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书摘要所载内容截止日为2018年10月27日,有关财务数据截止日为2018年9月30日,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

1. 名称:华安基金管理有限公司
2. 住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
3. 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
4. 法定代表人:朱学华
5. 设立日期:1998年6月4日
6. 批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]02号
7. 联系电话:(021)38969099
8. 联系人:王艳
9. 客户服务中心电话:40088-50099
10. 网址:www.huacan.com.cn

二、注册资本和股权结构

1. 注册资本:1.5亿元人民币
2. 股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海锦江国际商务股份有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
国泰君安证券股份有限公司	20%

三、主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

(1) 董事会

朱学华先生,本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理,工会主席,兼任海际和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童毓先生,博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理,上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理(主持工作),上投摩根基金管理有限公司副总经理,上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。

邱平先生,本科学历,高级政工师职称。历任上海红星轴承厂党委书记,上海东风机械(集团)公司总裁助理、副总裁,上海全光网络科技股份有限公司总经理,上海赛事商务有限公司总经理,上海东浩工艺品股份有限公司董事长,上海惠康集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事,上海建筑材料(集团)总公司党委书记、董事长(法定代表人)、总裁。现任上海工业投资(集团)有限公司党委副书记、执行董事(法定代表人)、总裁。

马名驹先生,工商管理硕士,高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理,上海东方上市企业博览中心副总经理。现任锦江国际(集团)有限公司副总裁兼计划财务部经理及金融事业部总经理,上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资管理有限公司监事。

董耀华先生,大学学历,高级经济师。历任上海市审计局基建处科员、副主任科员、处长助理、副处长,固定资产投资审计处副处长(主持工作),处长,上海市审计局财政审计处处长,上海电气(集团)总公司财务总监,上海电气(集团)总公司副总裁、财务总监。现任上海电气(集团)总公司副总裁,上海海立(集团)股份有限公司董事长,上海临港控股股份有限公司董事。

聂小刚先生,经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主任、总裁办公室副主任、营销管理总部助理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市公司办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理等职务。现任国泰君安证券投资有限公司董事长、国泰君安证券股份有限公司战略投资及直投业务委员会副总裁、战略管理部总经理、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

独立董事:

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书长、上海市第一律师事务所律师副主任、上海市金茂律师事务所律师主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所律师合伙人。

夏大慰先生,研究生学历,教授。现任上海国家会计学院学术委员会委员、教授、博士生导师,中国工业经济学会副会长,财政部会计准则委员会专家组成员、财政部内部控制标准委员会委员,香港中文大学名誉教授,复旦大学管理学院兼职教授,上海证券交易所上市公司委员会委员,享受国务院政府津贴。

(2) 监事会

张志红女士,经济学博士。历任中国证监会上海监管局(上海证监局)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务,长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员、国泰君安证券股份有限公司总裁助理、投行业务委员会副委员等职

务。现任国泰君安证券股份有限公司业务总监兼投行业务委员会副总裁,华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生,研究生学历。曾任怡安翰威特咨询业务总监,麦理根(McLagan)公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司人力资源部高级总监,华安资产管理(香港)有限公司董事。

诸慧女士,研究生学历,经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员,集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

(3) 高级管理人员

朱学华先生,本科学历,19年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席,兼任海际和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童毓先生,博士研究生学历,17年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理,上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理(主持工作),上投摩根基金管理有限公司副总经理,上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛彦女士,硕士研究生学历,17年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授,中国证监会上海证监局机构处副处长,中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

翁启森先生,硕士研究生学历,24年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深助理,台湾JP摩根银行证券投资经理,台湾摩根证券投资经理,台湾中信证券自营部助理,台湾博德信投信基金经理,华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生,硕士研究生学历,14年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员,华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理,华安基金管理有限公司上海业务助理总监、机构业务部高级董事总经理,公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士,硕士研究生学历,19年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理,京华山一国际(香港)有限公司高级经理,华安基金管理有限公司市场部业务二部大区经理,产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

2. 本基金基金经理

倪斌先生,硕士研究生,8年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010年7月加入华安基金,历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师,基金经理助理。2018年9月起,同时担任华安沪深全球原油指数证券投资基金(LOP)、华安纳斯达克100指数证券投资基金、华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、本基金及其联接基金的基金经理。

苏昕涵先生,博士研究生,14年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾先后于研究发展部、战略策划部工作,担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部,担任基金经理职务。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2015年6月至2016年9月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年3月同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年2月同时担任华安安全全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016年6月至2018年2月同时担任华安安全全球美元惠信债券型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月至2018年9月,同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月起,同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年8月起,同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年10月担任华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

历任基金经理:

徐宜宣先生,自2018年4月27日至2018年9月28日担任本基金的基金经理。

童毓先生,总经理

翁启森先生,副总经理、首席投资官

杨明先生,投资研究部高级总监

许之彦先生,指数与量化投资部高级总监

贺涛先生,固定收益部总监

苏昕涵先生,全球投资部助理总监

万建军先生,投资研究部联席总监

谢振东先生,基金投资部副总监

崔莹女士,基金投资部助理总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

4. 业务人员的准备情况:

截至2018年9月30日,公司目前有员工361人(不含香港公司),其中57.9%具有硕士及以上学历,91.7%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历,具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号8层808室

法定代表人:周慕冰

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关及批准设立文号:中国银监会银监监[2009]13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

存续期间:持续经营

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京,经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的优势赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过中国农业银行国际内控标准(ISA E3402)认证,表明了独立第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金理财”TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳托管银行奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国金融报授予的公募基金20年“最佳基金托管奖”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年8月经中国证监会和中国银监会批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

二、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的

专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

三、基金托管业务经营情况

截止2018年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共419只。

三、相关服务机构

- 一、基金份额发售机构
1. 网下现金发售直销机构
- 名称:华安基金管理有限公司
- 住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
- 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
- 法定代表人:朱学华
- 电话:(021)38969999
- 传真:(021)58406138
- 联系人:王艳
- 客户服务电话:40088-50099
- 网址:www.huacan.com.cn
2. 申购赎回代办证券公司(简称:一级交易商):
- 中信证券、中信证券(山东)、国都证券、中信建投、招商证券、申万宏源、申万宏源(西部)、光大证券、海通证券、中泰证券、银河证券、上海证券、国信证券、长江证券、平安证券、华安证券、兴业证券、国泰君安、方正证券、广发证券。
3. 网上现金发售机构
- 网上现金发售机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。
4. 基金管理人可根据有关法律法规,选择其他符合要求的机构发行发售本基金,并及时公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。基金管理人可以根据情况增加其他发售机构,并另行公告。

二、登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

负责人:周明

联系人:严峰

电话:(0755)25946013

传真:(0755)25987122

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19楼

负责人:俞卫锋

电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

联系人:陈颖华

经办律师:安冬、陈颖华

四、审计本基金的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦5楼

办公地址:中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

首席合伙人:李丹

联系电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:魏佳莹

经办会计师:崔峰、魏佳莹

四、基金的名称

本基金名称:华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:交易型开放式。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为了更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行的股票)、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、权证以及法律法规和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)。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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:投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,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。

如果法律法规对上述比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的的投资组合不做相应调整。

八、基金的投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。当指数编制方法发生变更、成份股发生变更、成份股权重由自由流通市值调整而发生变动、成份股发生股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。

一、组合复制策略

本基金要采取复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

二、替代性策略

对于出现市场流动性不足,因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况,导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

三、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

四、债券投资策略

本基金进行债券投资的目的在保证基金资产流动性的基础上,使基金资产得到更加合理有效的利用,从而提高投资组合收益。为此,本基金将以市场利率趋势研判为主,基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析,在保证流动性和风险可控的前提下,灵活运用目标久期策略、收益曲线策略、相对价值策略、骑乘策略和利差策略等对高流动性、低风险的债券品种进行主动投资。

五、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

六、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考虑量可投资品种的收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险,追求稳定的投资回报。

七、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则,在法律法规允许的范围和比例内,风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资及转融通证券出借业务。

参与融资融券业务时,本基金将力争利用融资融券的杠杆作用,降低因申购造成仓位较低带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

参与转融通证券出借业务时,本基金将选择具有融券标的的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象,力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中华交易服务港股通精选100指数收益率(经

汇率调整)。

本基金为交易型开放式指数基金,将紧密跟踪标的指数中华交易服务港股通精选100指数,努力追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。因此,选择本基金业绩比较基准为:中华交易服务港股通精选100指数收益率(经汇率调整)。

本基金的指数变更的,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),经基金管理人与基金托管人协商一致按照监管部门要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告,并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要通过港股通机制投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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9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	78,133,066.32	94.82
	其中:股票	78,133,066.32	94.82
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	3,081,079.28	4.07
7	其他各项资产	414,430.04	0.51
8	合计	82,309,145.64	100.00

2 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股票投资组合

行业名称	公允价值(人民币)	占基金总资产比例(%)
A 基础材料	233,328.73	0.28
B 消费者非必需品	6,687,071.08	8.16
C 消费必需品	3,227,795.00	3.93
D 能源	2,944,173.91	3.59
E 金融	23,614,329.60	28.79
F 医疗保健	2,717,090.38	3.31
G 工业	5,064,462.63	6.17
H 信息技术	9,250,038.28	11.32
I 电信服务	5,698,261.34	6.93
J 公用事业	6,305,029.86	7.76
K 房地产	12,300,029.11	14.99
合计	78,133,066.32	96.22

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	00005	汇丰银行	130,400	7,940,387.22	9.88
2	01099	友邦保险	128,800	7,922,266.44	9.86
3	00700	腾讯控股	24,100	6,864,036.14	8.49
4	00941	中国移动	65,500	4,446,673.33	5.42
5	00088	香港交易所	13,300	2,621,547.04	3.19
6	00883	中国海洋石油	190,000	2,591,462.76	3.16
7	00003	长和	29,000	2,301,773.21	2.81
8	00002	中国中铁	21,500	1,739,919.48	2.11
9	00016	中航国际	15,500	1,564,971.68	1.89
10	00011	恒生银行	8,200	1,534,034.43	1.87

3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

- 1 本基金本报告期末未持有积极投资股票。
- 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
- 5 本基金本报告期末未持有债券投资。
- 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五名债券投资明细
- 6 本基金本报告期末未持有债券投资。
- 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
- 7 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
- 3 2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金经理报告期末未持有有证投资。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要的目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对其证券市场与期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

10.2 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持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。