汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2019年第1号）

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金的募集申请于【2017】年【1】月【22】日经中国证监会证监许可[2017]【167】号文注册。

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。

汇丰晋信珠三角区域发展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：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金是一只混合型基金，其预期收益及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，属于中高风险收益特征的基金品种。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，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

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也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，由投资者自行负责。

本招募说明书（更新）已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年12月2日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

汇丰晋信基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼
法定代表人：杨小勇
成立时间：2005年11月16日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：证监基金字【2005】172号
组织形式：有限责任公司
注册资本：2亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：周慧
联系电话：021-20376868

公司的股权结构如下：

山西信托股份有限公司（以下简称“山西信托”）持有51%的股权，HSBC Global Asset Management（UK）Limited（汇丰环球投资管理（英国）有限公司）持有49%的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员

杨小勇先生，董事长，硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资（集团）公司副总经理，山西光信实业有限公司副董事长，山西省国信投资（集团）公司党委书记、山西信托副董事长，晋商银行股份有限公司党委副书记、副行长（正职待遇）。现任山西金融投资控股集团有限公司专职党委副书记、副总经理（正职待遇）。

郭晋普先生，董事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司房地产开发部、投资实业总部副总经理，太原万丰房地产发展有限公司总经理，山西国际贸易中心有限公司总经理、董事长，山西信托董事长，山西国信投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

柴宏杰先生，董事，本科学历。曾任长治银监分局办公室主任、党委办公室主任，晋商银行股份有限公司董事会办公室主任、大同分行行长，山西省国信投资（集团）公司董事会办公室主任兼党委办公室主任、中合盛资本管理有限公司董事、董事长，山西国信投资集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理，山西金融投资控股集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理。现任山西省国有资本投资运营有限公司总经理助理兼资本运营部负责人。

李选进先生，董事，硕士学历。曾任怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监，汇丰投资管理（香港）董事兼亚太区企业拓展及中国事业主管，汇丰晋信基金管理有限公司总经理、董事。现任汇丰中华证券投资信托股份有限公司董事长。

巴培卓（Pedro Augusto Botelho Bastos）先生，董事。曾任汇丰环球投资管理（巴西）行政总裁、汇丰环球投资管理（拉丁美洲）首席投资官、行政总裁。现任汇丰环球投资管理亚太行政总裁。

王栋先生，董事。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理。

常修泽先生，独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长，国家发改委经济研究所常务副所长、教授、博士研究生导师。现任清华大学中国经济研究中心研究员。

梅建平先生，独立董事，博士学历。曾任纽约大学金融学副教授、芝加哥大学访问副教授、阿姆斯特丹大学访问副教授、清华大学特聘教授、长江商学院EMBA项目副院长。现任长江商学院金融学教授。

叶迪奇先生，独立董事，硕士学历。曾担任汇丰银行(美国)西岸业务副总裁，汇丰银行(香港)零售部主管、汇丰银行中国总代表处中国业务总裁、交通银行副行长、国际金融协会(IIF)亚太区首席代表。现任星展银行(香港)有限公司独立董事。

2、基金管理人监事会成员

焦杨先生，监事，硕士学历。曾任山西信托副总经理兼资金管理部经理，常务副总经理，山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理。现任山西金融投资控股集团有限公司运营总监兼资本运营部总经理，山西证券股份有限公司监事会主席，山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席。

廖宜建，监事，本科学历。曾任职于日本兴业银行（现为瑞穗国际），1997 年加入汇丰负责大中华区及新加坡的本地外汇、利率及债券市场业务，后先后担任汇丰中国地区司库、汇丰中国环球银行及资本市场总监、汇丰银行（中国）有限公司副行长。现任汇丰银行（中国）有限公司行长兼行政总裁。

曹菁女士，监事，硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理、汇丰晋信基金管理有限公司人事经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

侯玉琦先生，监事，硕士学历。曾任山西信托及山西省国信投资（集团）公司担任交易员及投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员，现任汇丰晋信基金管理有限公司股票基金经理。

3、基金管理人高级管理人员

王栋先生，总经理，硕士学历。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。

闫太平先生，副总经理，本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托副处长、国际金融部经理。

王立荣先生，副总经理，硕士学历。曾任山西信托固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监；上海万方投资管理有限公司副总经理；汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

赵琳女士，副总经理，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金注册部副总监；中银基金管理有限公司基金运营部总监；汇丰晋信基金管理有限公司基金运营部总监；现任汇丰晋信基金管理有限公司首席运营官。

张毅杰先生，副总经理，硕士学历。曾任招商基金管理有限公司华东业务发展经理、天同基金管理有限公司机构理财部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、直销业务部总监。

古韵女士，督察长，硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理，国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

4、本基金基金经理

吴培文先生，1980年出生，清华大学工学硕士。历任宝钢股份研究员、东海证券研究员、平安证券高级研究员，2011年8月加入汇丰晋信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。现任汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金和汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

王栋，总经理；郑宇尘，投资部总监；基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

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9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：010-67595096

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

汇丰晋信基金管理有限公司投资理财中心
地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼
电话：021-20376868
传真：021-20376989
客户服务中心电话：021-20376888
公司网址：www.hsbcjt.cn

2、其他销售机构

中国建设银行股份有限公司
注册地址：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
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：彭纯
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
联系人：王菁
客服电话：95559
网址：www.bankcomm.com

广州农村商业银行股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号
法定代表人：王继康
公司网站：www.grcbank.com
客服电话：95313

汇丰银行（中国）有限公司
注册地址：上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层
办公地址：上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层
法定代表人：廖宜建
公司网站：www.hsbc.com.cn
客服电话：卓越理财客户 800-820-8828（限中国内地固话）
(+86)-(21)-3888 8828（适用于境外或移动电话）
运筹理财客户 800-820-8878（限中国内地固话）
(+86)-(21)-3888 8878（适用于境外或移动电话）
非汇丰个人客户800-830-2880（限中国内地固话）
(+86)-(21)-3888 3015（适用于境外或移动电话）

招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：秦晓
电话：（0755）83195834，82090060
传真：（0755）83195049，82090817
联系人：刘薇
客户服务热线：95555
网址：www.cmbchina.com

宁波银行股份有限公司
注册地址：浙江省宁波市中山东路294号
法定代表人：陆华裕
客户服务电话：96528（上海地区962528）
网址：www.nbcb.com.cn

渤海银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区马场道201-205号
办公地址：天津市河东区海河东路218号
法定代表人：李伏安
联络人：王宏
电话：022-58316666
传真：022-58316569
客服电话：95541
公司网址：www.cbhb.com.cn

申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
联系人：黄莹
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客户服务电话：95523或4008895523

中信建投证券股份有限公司
注册地址：朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市东城区朝内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
电话：010-85130577
传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108(免长途费)
网址：www.csc108.com

光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客户服务电话：4008888788、10108998
网址：www.ebscn.com

海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
电话：021-23219000
传真：021-23219100
客服电话：95553或拨打各城市营业网点电话
网址：www.htsec.com

国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82133066
传真：0755-82133302
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城东路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
联系电话：021-38676161
传真：021-38670161
客服电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com

中国银河证券股份有限公司
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人：陈共炎
客服电话：4008-888-888或95551
公司网址：www.chinastock.com.cn

中信期货有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：韩 钰
客服电话：400-990-8826
公司网站：www.citicsf.com

兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：福州市湖东路268号
法定代表人：兰荣
联系人：杨盛芳
电话：0591-87613888
传真：0591-87546058
客户服务电话：400-8888-123
网址：www.xyzq.com.cn

中信证券（山东）有限责任公司
法定代表人：杨宝林
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
基金业务联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客户服务电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-84683893
传真：010-84865560
客服电话：010-84588888
网址：www.cs.ecitic.com

上海天天基金销售有限公司
注册地点：上海浦东新区峨山路613号6幢551室
法定代表人：其实
联系人：朱钰
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：杨泽柱
电话：021-68751929
联系人：李良
客户服务电话：95579
网址：www.95579.com

申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：李季
联系人：唐岚
电话：010-88085258
传真：010-88013605

华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：（025）83290979
联系人：万鸣
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人：肖雯
公司网站：www.yingmi.cn
客服电话：020-89629099

北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人：赵荣春
公司网站：www.qianjing.com
客服电话：400 893 6885

中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
客服电话：95558
联系人：丰靖
电话：010-65557013
传真：010-65550827
网址：bank.ecitic.com

中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
电话：010-58351666
传真：010-83914283
联系人：董云巍
客户服务热线：95568
公司网站：www.cmbc.com.cn

招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼
邮编：518033
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636客服电话：400-8888-111、95565
网址：www.newone.com.cn

安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
客服电话：4008001001
公司网址：www.essences.com.cn

东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座12、15层
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座12、15层
法定代表人：魏庆华
联系人：汤凝川
电话：010-66555316
传真：010-66555147
客户服务电话：4008888993
网址：www.dxzq.net

平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26楼
法定代表人：曹实凡
联系人：石静武
电话：021-38631117
传真：021-58991896
客服电话：95511-8
公司网址：stock.pingan.com

东海证券有限责任公司
注册地点：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
联系人：汪汇
公司网站：www.longone.com.cn
客服电话：400-8888-588

中泰证券股份有限公司
注册地点：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889518
公司网站：www.zts.com.cn
客服电话：95538

中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：杨涵宇 陈曦
客服电话：400 910 1166
公司网址：www.cicc.com.cn

广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点
公司网站：www.gf.com.cn

北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座1108号
法定代表人：王伟刚
联系人：熊小满
电话：400-619-9059/010-56251471
传真：010-62680827
公司网站：www.hcjijin.com
客服电话：400-619-9059

北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人：江卉
电话：4000988511/ 4000888816
传真：010-89188000
公司网站：fund.jd.com
客服电话：95118

3、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：汇丰晋信基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼
法定代表人：杨小勇
联系人：赵琳
联系电话：021-20376892

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：俞卫峰
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：丁媛
经办律师：黎明、丁媛

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：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
执行事务合伙人/首席合伙人：杨绍信
联系电话：021-2323 8888
传真电话：021-2323 8800
经办注册会计师：薛竟、赵钰
联系人：赵钰

第四部分 基金的名称

汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

混合型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

本基金是一个“纯粹”的区域投资主题基金，将股票资产聚焦于本基金主题所指的珠三角区域的上市公司或有确切证据能证明受益于该区域经济的上市公司，通过筛选优质上市公司，争取中长期投资收益超越比较基准。

第七部分 基金的投资方向

本基金为混合型基金，投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券、同业存单等以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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。

本基金可以参与融资业务。

基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的50%-95%，其中，投资于“珠三角区域发展”主题的股票比例不低于非现金资产的80%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券的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。

第八部分 基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金借鉴汇丰集团的投资资理念和流程，基于多因素分析，对权益类资产、固定收益类及现金类资产比例进行动态调整。具体而言，本基金将通过对宏观经济面、资金流动性、上市公司整体盈利水平、市场估值水平、基于技术指标及成交量的趋势分析、市场情绪、政策面、海外市场情况等因素进行跟踪，全面评估上述因素中的关键指标及其变动趋势，以最终确定大类资产的配置权重，实现资产合理配置。

2、股票投资策略

（1）本基金所指“珠三角区域”是以珠三角经济区为中心，辐射至珠江沿海。具体为：广东省、广西省、福建省。本基金所指“珠三角区域发展”主题的股票，包含以下两部分：

1）注册于广东省、广西省及福建省的上市公司。

2）有确切证据能证明受益于该区域经济的上市公司，包括但不限于如下情况：

该公司非注册在上述三省份，但其主营业务收入或销售额等主要来源于上述三省份，或者公司计划在这三省份内增加投资，包括开设厂房或增加分支机构等投资行为，且有确切证据能认定该投资行为对公司发展起到积极作用。

公司发展是个动态的过程，随着公司所处的阶段不同，以及区域经济环境和政策的变化，都会对公司的业绩、发展战略及投资行为产生影响，本基金将会从受益于区域经济的视角出发，密切关注各行业动态并挖掘潜在的机会，从而筛选出优质的上市公司。

（2）本基金主题包含了数个行业，这些行业的发展趋势和估值水平区别较大，这为主动型资产管理提供了空间。在个股选择时，本基金将着重选择那些需求空间大、技术确定性较高、公司治理结构优良，发展趋势向好的上市公司。具体而言，本基金对区域主题内的上市公司采用“盈利-估值指标”二维估值模型，并从公司治理结构等方面进行综合评价，以筛选出优质的上市公司。

1）“盈利-估值指标”是一个二维的概念（以EBIT、ROE等指标为代表的盈利维度与PB、PE、EV等指标为代表的估值维度），其分别反映公司的盈利能力和估值水平。基金管理人力求在这两个维度中选出高盈利下具有低估值属性的投资标的。在实际投资操作中，本基金并不拘泥于参照单一指标，而是将综合考虑上市公司的基本面后，最大程度地筛选出具有持续投资价值的上市公司。

2）公司治理结构：公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。因此，公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定上市公司盈利能力能否持续的重要因素。本基金对上市公司治理水平的评估主要包括以下几个因素：

●股东价值创造力
●公司声誉记录
●管理层战略
●管理层稳定性
●盈利的可预见性

3、债券投资策略

本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益：

●利率趋势预期

准确预测未来利率趋势能为债券投资带来超额收益。本基金将密切关注宏观经济运行状况，全面分析货币政策、财政政策和汇率政策变化情况，把握未来利率走势，在预期利率下降时加大债券投资久期，在预期利率上升时适度缩小久期，规避利率风险，增加投资收益。

●收益率曲线变动分析

收益率曲线反映了债券期限同收益率之间的关系。投资研究部门通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券投资组合长短期品种的比例获得投资收益。

●收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债券）、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差基础上，投资部门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，比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或市场供求发生变化时，这种稳定关系会被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

●公司基本面分析

公司基本面分析是公司债(包括可转换债券)投资决策的重要决定因素。研究部门对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析，并结合实际调研结果，准确评价该公司债券的信用风险程度，作出价值判断。对于可转债，通过判断正股的价格走势及其与可转换债券间的联动关系，从而取得转债购入价格优势或进行套利。

4、权证投资策略

本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。基金的权证投资策略主要包括以下几个方面：

1）综合衡量权证标的股票的合理内在价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。

2）根据权证的合理内在价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理内在价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理内在价值的考量，决策买入、持有或沽出权证。

3）通过权证与证券的组合投资，利用权证衍生工具的特性，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、资产支持证券投资策略

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。

第九部分 基金的业绩比较基准

业绩比较基准=中证珠三角沿海区域发展主题指数*70%+同业存款利率（税后）*30%

中证珠三角沿海区域发展主题指数由中证指数有限公司根据本基金的主题范围定制的指数。该指数以注册在广东、广西和福建省的股票为备选样本空间，根据总市值、净利润增长率、营业总收入三个指标，挑选出100只股票，综合反映这三个省份的股票市场的表现，与本基金的投资范围契合。

因此“中证珠三角沿海区域发展主题指数*70%+同业存款利率（税后）*30%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

同业存款利率指金融机构的资金存于银行或其他金融机构的活期利息，真实反映基金作为机构投资者的现金资产收益。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，或有更具代表性、更能为市场接受的业绩比较基准，在法律法规及基金合同约定的范围内，并对投资人无实质性不利影响的情况下，基金管理人可与基金托管人协商一致，履行适当的程序后变更业绩比较基准并予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金是一只混合型基金，其预期收益及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，属于中高风险收益特征的基金品种。

第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合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。

本基金的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月25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。

本基金投资组合报告的报告期为2018年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

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	213,908,506.97	91.44
	其中：股票	213,908,506.97	91.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	17,428,584.96	7.54
8	其他资产	2,386,804.38	1.02
9	合计	233,923,985.30	100.00

11.2 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、渔业	-	-
B	采矿业	25,929,385.96	11.29
C	制造业	68,023,656.63	29.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,538,048.41	14.61
E	建筑业	2,969,878.23	1.29
F	批发和零售业	10,532,356.36	4.59
G	交通运输、仓储和邮政业	61,031,438.50	26.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,992,185.00	1.30
J	金融业	196,510.86	0.09
K	房地产业	8,695,141.00	3.79
L	租赁和商务服务业	-	-
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	213,908,506.97	93.16

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

代码	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	600548	深高速	1,616,609	13,595,681.69	5.92
2	601857	中国石油	1,468,070	13,462,201.90	5.86
3	000022	深赤湾A	692,448	13,385,019.84	5.83
4	601139	深圳燃气	1,986,085	13,008,856.75	5.67
5	000089	深圳机场	1,621,111	12,822,905.73	5.58
6	600663	陆家嘴	1,844,258	12,467,184.08	5.43
7	002162	广电运通	1,894,729	12,145,276.99	5.29
8	601333	广深铁路	3,216,357	11,611,048.77	5.06
9	000895	双汇发展	440,560	11,520,644.00	5.02
10	002024	苏宁易购	781,332	10,532,356.36	4.59

11.4 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

11.9.1 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。

11.9.2 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。

11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.10.2 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。

11.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.11 投资组合报告附注

11.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	71,025.50
2	应收证券清算款	2,291,043.93
3	应收股利	-
4	应收利息	2,066.15
5	应收申购款	21,768.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,386,804.38

11.11.4 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债券。

11.11.5 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	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000022	深赤湾A	13,385,019.84	5.83	重大事项

11.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

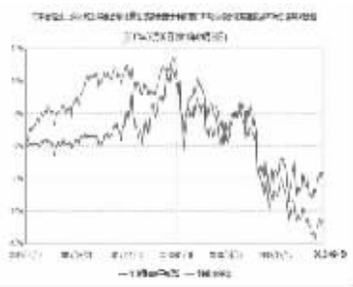
第十二部分 基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017/6/2(基金合同生效日)-2017/12/31	5.38%	0.68%	9.07%	0.58%	-3.69%	0.10%
2018/1/1-2018/9/30	-8.88%	1.22%	-18.22%	0.96%	9.37%	0.26%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：

1. 本基金的基金合同于2017年6月2日生效，截至2018年3月31日，基金合同生效未满1年。

2. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的50%-95%，其