

建信互联网+产业升级股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2019年第一期

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
二〇一九年一月

【重要提示】
本基金经中国证券监督管理委员会2015年5月19日证监许可[2015]930号文注册募集。本基金合同已于2015年6月23日生效。
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和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。
本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。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,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,并承担由于证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金管理人会在投资经营过程中产生的操作风险等。基金管理人提醒投资者投资基金的“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。

基金的历史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。
本招募说明书所载内容截止日为2018年12月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

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%;中国华电集团公司控股公司,10%。
本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实保障基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,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。公司章程中明确规定了股东对股东大会行使权利,不以任何形式直接或变相干预公司的经营管理和基金资产的运作。

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及对公司基本制度的制定和对总裁等高级管理人员的监督和执行权。

(二)主要人员情况

1.董事会成员
孙志晨先生,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,零售业务部业务处处长,中国建设银行总行总行个人银行业务部副总经理,2005年9月出任建信基金公司总裁,2011年4月起任建信基金公司董事长。
李庆华先生,董事,现任建信基金公司总裁,毕业于国家行政学院工商管理专业,获硕士学位。历任中国建设银行筹资储蓄部业务处科长、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,行政办公室秘书一室高级副经理级秘书、秘书,高级经理,投资托管服务部总经理助理、副总经理,投资托管服务部副总经理,资产托管服务部副总经理。2017年3月出任公司监事会主席,2018年4月起任建信基金公司总裁。

魏伟先生,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,北京分行支行行长助理,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,现任信安亚洲区总裁,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美国加州EMBA工商管理硕士学位。历任新加坡公共服务委员会副处长,新加坡国际有限公司业务发展总监,信诚基金公司首席运营官和总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理部首席执行官,宏利金融集团副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官兼执行董事,信安亚洲区副总裁。

郑树明先生,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,爱德蒙得洛尔北亚洲有限公司市场行销总监。

李淑蕊女士,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《长春日报》新闻中心农村工作部记者,湖南卫视《新闻非诚勿扰》财经节目组运营总监,锦辉控股集团副总裁,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经理,理财中心总经理,财富管理总监兼兼理信托公司总经理,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,1989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银行总行信托投资公司职员,正大国际(中国)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。
史亚辉女士,独立董事,现任中金资本跨境股权投资部副经理。1994年毕业于对外经济贸易大学,获国际金融学硕士学位,1996年毕业于耶鲁大学研究生院,获经济学硕士学位,先后在标准普尔国际评级公司、美国友邦国际银行、野村证券亚洲、雷曼兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理公司等多家金融机构担任管理职务。

邱峰先生,独立董事,现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业,获EMBA学位,全国会计领军人才,中国注册会计师,注册资产评估师,高级会计师,澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所,现任首席合伙人。

2.监事会成员
马晋芳女士,监事会主席,高级经济师,1984年毕业于中央财政金融学院,获学士学位,2009年获长江商学院高级管理人员工商管理学位。1984年加入建设银行,历任总行筹资储蓄部,零售业务部,个人银行部副处长、处长,资深客户经理(技术二级),个人金融部副总经理,个人存款与投资部副总经理。2018年5月起任建信基金公司监事会主席。

方晋女士,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总监和美国国际集团全球业务及健康保险副总裁等职务。方女士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战略研究部总经理。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。历任北京北奥有限公司,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经理助理、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副经理,中国华电集团资本控股企业金融部副经理。

安晖先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术总监兼信息技术管理部总经理。1996年毕业于北京工业大学计算机专业,获得硕士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术处,中国建设银行信息技术管理部北京研发中心项目经理、处长,建信基金管理有限责任公司运管部副经理,副总经理,信息技术管理部总经理,建信基金管理有限责任公司人力资源部副经理,2002年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,2005年10月曾任安华明会计师事务所人力资源部门人力资源专员,安华明会计师事务所建信基金管理公司,历任人力资源部管理专员、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内控合规部副总经理兼内控合规部副经理(二级部)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内控合规部。

3.公司高管人员
张军红先生,总裁(简历请参见董事会成员)。
曲俊军先生,副总裁,硕士。1999年7月加入中国建设银行总行,历任审计部科长、副主任科员,团委主任科员,重组改制中心主任科员,副经理,行政办公室高级副经理;2006年9月任职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部副经理,投资管理部副经理,专户投资部副经理和首席战略官;2013年8月至2015年7月,任我公司控股子公司建信资本管理有限公司董事、总经理。2015年8月6日起任我公司副总裁,2015年8月至2017年11月30日专任建信资本管理有限公司董事、总经理,2017年11月30日至2018年11月1日兼任建信资本管理公司董事长。

张威威先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券基金销售业务,任高级副经理;2006年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,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日起任我公司副总裁。
吴晓明先生,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,先后在总行资产管理、金融机构、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月加入建信基金管理公司,担任董事、秘书,并兼任综合管理部总经理。2015年6月8日起任我公司董事长。
吴良英女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建新华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,任人力资源部副经理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部副经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。
马勇先生,副总裁,硕士。1993年8月至1995年8月在江苏省机械研究院设计院工作。1998年7月加入中国建设银行总行,历任副主任科员,主任科员,秘书,高级经理级秘书,高端客户部总经理助理,财富管理私人银行部总经理助理、副总经理,建行黑龙江省分行副行长等职务。2018年8月30日加入建信基金管理有限责任公司,2018年11月13日起任副总裁;2018年11月1日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事长。

4.督察长
吴晓明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。
5.本基金基金经理
何冲华先生,硕士。2010年5月加入建信基金管理公司,历任助理研

究员、初级研究员、研究员、研究主管、基金经理等职务。2015年4月17日至2017年6月30日任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年6月23日起任建信互联网+产业升级股票型证券投资基金的基金经理;2018年1月10日起担任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
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。
姚 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关系。

二、基金托管人

(一)基本情况
名称: 华夏银行股份有限公司
住所: 北京市东城区建国门内大街22号(100005)
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)
法定代表人:李庆军
成立时间:1992年10月14日
组织形式:股份有限公司
注册资本:12,822,686,663元人民币
批准设立机关和设立文号:中国人民银行(银复(1992)391号)
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]125号
联系人:刘翀
电话:(010)85236657
传真:(010)85236980

(二)主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理部及运营室4个职能处室。资产托管部共有员工40人,高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

华夏银行于2005年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准,获得证券投资基金托管资格,是证券投资基金托管业务的第一家银行。自成立以来,华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神,始终遵循“安全保管基金资产,提供优质服务”的原则,坚持以客户为中心的服务理念,依托丰富的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验,严格履行法律法规和协议所规定的各项义务,为“大基金”机构投资者和人民币理财产品提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2018年9月末,托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、保险资产管理、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计4165只,总托管资产规模达到26606.92亿元。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构
本基金直销机构为本公司设在北京的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

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务,具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址:www.ccbfund.cn

2.其他销售机构

(1)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(长安兴融中心)
法定代表人:田国立
客服电话:96563
网址:www.ccb.com

(2)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人:李庆萍
客服电话:96568
网址:bank.ecitic.com

(3)光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街26号光大大厦
办公地址:北京市西城区复兴门内大街26号光大大厦
法定代表人:李晓翥
客服电话:95695
网址:www.cebbank.com

(4)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
客服电话:95568
公司网站:www.cmbc.com.cn

(5)华夏银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:李庆军
客户服务热线:96577
网址:www.hxb.com.cn

(6)渤海银行股份有限公司
住所:天津市滨海新区天津大道191-205号
办公地址:天津市河东区海大道218号
法定代表人:李伏安
客服电话:95541
网址:www.bhbb.com.cn

(7)深圳前海新兰德证券投资有限公司
住所:深圳市南山区华侨城海德三道1006号
法定代表人:马勇
客户服务电话:400-166-1188
电话: http://www.jrj.com.cn/

(8)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客户服务电话:4009200022
网址:www.Licaike.com

(9)上海招财资本管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层011、02、03室
法定代表人:冷飞
客户服务电话:021-56010673
网址: http://www.wacaijin.com

(10)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市虹口区四川路360号39724室
法定代表人:汪静波
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

(11)深圳众禄基金销售股份有限公司
住所:深圳市罗湖区笋岗东路6047号发展银行大厦25楼J、J单
法定代表人:薛峰
客户服务电话:4006788887
网址:www.zlfund.com, www.jmmw.com

(12)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2楼
法定代表人:其实
客户服务电话:4001818188
网址:www.1234567.com

(13)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

(14)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幢202室
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:4000766123
网址:www.fund123.com

(15)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法定代表人:凌顺平
客户服务电话:400-877-3772
网址:www.5ifund.com

(16)上海浦基基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区峨山路90弄61号10号楼12楼
法定代表人:李兴春
客户服务电话:400-921-7755
网址:www.leadbank.com.cn

(17)嘉实财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海金中心办公楼二期53层312-15单元
法定代表人:赵学军
客户服务电话:400-021-8880
网址:https://www.harvestwm.com

(18)南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:刘汉青
客户服务电话:95177
网址: http://www.snjfund.com

(19)北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市丰台区东管城大街62号10层5122室
法定代表人:周斌
客户服务电话:4007896989
网址:www.htmfund.com

(20)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市西城区广安门内大街217号11层1108
法定代表人:王伟刚
客户服务电话:010-56221240
网址:www.hcfund.com

(21)北京展恒天基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区望京东里二号楼1909国际大厦1504/1205室
法定代表人:蒋煜
客户服务电话:4008188866
网址:www.shengzhentian.com

(22)北京唐润基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦A座1504/1205室
法定代表人:张冠宇

客户服务电话:400-819-9668
网址: http://www.tdyhtfund.com/
(23)天津国美基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区霞光路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人:丁东华
客户服务电话:400-111-0889
网址:www.gomefund.com

(24)上海万得基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
客户服务电话:400-821-0203
网址:www.windmoney.com.cn

(25)北京微动利基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区景山西街113号景山财富中心341
法定代表人:李永军
客户服务电话:400-819-6666
网址: www.buyforyou.com

(26)北京虹点基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层2220单元
法定代表人:李志刚
客户服务电话:400-618-0707
网址: http://www.hongdianfund.com/

(27)深圳富济财富管理有限公司
住所:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦36层01B、02、03、04单元
法定代表人:刘宇宇
客户服务电话:0755-83999913
网址: http://www.fujifund.com/

(28)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:王之光
客户服务电话:400-821-9031
网址: www.lufunds.com /

(29)大泰金石基金销售有限公司
住所:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
法定代表人:姚珏
客户服务电话:400-928-2266
网址: https://www.dtfunds.com/

(30)珠海盈米基金销售有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
客户服务电话:400-8962906
网址: http://www.yingmi.com.cn/

(31)奕丰基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
法定代表人:TEO WEE HOWE
客户服务电话:400-684-0600
网址: https:// www.ifastps.com.cn

(32)北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街9号院6号楼2单元21层222607
法定代表人:钟奕坚
客户服务电话:4000-618-518
网址: https://danjuanapp.com/

(33)上海华夏财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人:毛滢
客户服务电话:400-818-5666
网址: https://www.huaweifund.com

(34)中信证券股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门内大街29号
法定代表人:王东明
客服电话:95558
网址: www.citics.com

(35)华融证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区朝明门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层
法定代表人:杨晓忠
客户服务电话:95390
网址: http://www.hrsec.com.cn

(36)北京植信基金销售有限公司
法定代表人:杨红斌
住所:北京市朝阳区四惠盛世龙园食品街105号
客户服务电话:4006-825-123
网址: www.zhixin-inv.com

(37)中国期货有限公司
地址:深圳市福田区中心三路3号卓越时代广场(二期)北座13层
1301-1305、1314
法定代表人:张浩
客服电话:400 9908 826
网址: http://www.citics.com

(38)上海量量基金销售有限公司
地址:上海浦东新区浦东南路555号裕景国际大厦16层
电话:400-820-2899
(39)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市建国门外大街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:400-910-1166
网址: www.cvic.com.cn

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机构销售本基金,并及时公告。
(一)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
法定代表人:孙志晨
联系人:范文丹
电话:010-66228888

(二)出具法律意见书的律师事务所
名称:北京德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层
负责人:王丽
电话:010-52682888
传真:010-52682999
经办律师:刘焕志、孙艳利

(四)审计本基金的会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址:上海市黄浦区湖路202号群展企业广场2楼11楼
电话:021-2323 8888
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:许康玮、沈兆杰
联系人:沈兆杰

四、基金的名称
建信互联网+产业升级股票型证券投资基金。
五、基金的类型
股票型证券投资基金。

在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围为具有较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公司股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转债、超短期融资券)、资产支持证券、信用债、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货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的相关规定。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的90%—95%,投资于互联网+产业升级主题相关的上市公司投资股票占非现金资产的比例不低于80%;基金持有全部权证的市值不得超过基金净资产的3%;每个交易日终在扣除股指期货合约的缴纳保证金后,投资于现金类资产(指在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金净资产的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。

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

八、基金的投资策略
本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、券种精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产配置策略和权证投资策略四部分组成。

(一)大类资产配置策略
本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

本基金主要考虑的因素为:
1.宏观经济指标,包括GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、货币供应量、固定资产投资、进出口贸易数据等,以判断当前所处的经济周期阶段;
2.市场方面指标,包括股票及债券市场的涨跌及预期收益、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化;
3.政策因素,包括货币财政政策、财政政策、资本市场相关政策等;
4.行业因素,包括相关行业所处的周期阶段、行业政策扶持情况等。

通过对以上各因素的分析,结合全球宏观经济形势,研判国内经济的发展趋势,并在严格控制投资组合风险的前提下,确定和调整投资组合中大类资产配置比例。

(二)股票投资策略
“互联网+”是互联网2.0下的互联网新兴产业、新业态,是知识社会创造2.0推动下互联网形态演进。“互联网+”代表一种新的经济形态,即充分发挥互联网在生产要素配置中的优化和集成作用,将互联网的创新成果深度融合于经济社会各领域之中,提升实体经济的创新力和生产力,形成更高层次以互联网为基础设施和实现工具的产业发展形态。“互联网+”将重点应用于云计算、物联网、大数据为代表的新一代信息技术和现代制造业、生产性服务业等的融合应用,发展壮大新兴产业,打造新的经济增长点,为大众创业、万众创新提供环境,为产业升级提供支撑,增强新的经济发展动力,促进中国经济提质增效升级。

具体到产业来说,“互联网+”不仅包括电子商务、工业互联网、互联网金融以及由此带来的创新创业,还包括工业、商业和金融等服务业务与互联网这个当前信息产业发展核心全面融合。

二、行业配置策略
本基金将自上而下地依据互联网+产业升级的主题逻辑,重点投资于移动互联网、云计算、物联网、大数据为代表的新一代信息技术,以及

与新一代信息技术融合后产生巨大提升的相关产业。本基金将从行业成长度、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等角度以及互联网、信息化对原有产业改造提升程度等方面,综合评估各个行业投资价值。

3、个股选择
本基金通过定量和定性相结合的方法进行个股下面的选择。在定性方面,本基金通过以下标准对拟投资的基本面进行研究并筛选出基本面向优的上市公司:
第一,根据公司的核心业务竞争力、市场地位、经营管理者能力、人才资源等选择具备良好竞争优势的公司;
第二,根据上市公司股权结构、公司治理框架、信息透明度等做定性分析,选择公司治理结构较好的公司;

第三,通过定性的方式分析公司在自身的发展过程中,受国家相关政策的扶持程度、公司发展方向、核心产业发展前景、公司规模增长及经营效益的趋势。另外还将考察公司在同业中的地位、核心产品的竞争力、市场需求状况及公司的决策体系及其开拓精神等。

在定量方面,本基金通过对上市公司内在价值的深入分析,挖掘具备估值优势的上市公司,并将其在宏观经济发展、行业分析的基础上,根据公司的基本面以及财务表现等信息灵活运用各类估值方法评估其价值。本基金采用的估值方法及评估指标包括PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA等。

(三)固定收益类资产配置策略
在进行固定收益类资产配置时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略,可转换债券投资策略和资产支持证券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。

1、利率预期策略
通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量,分析宏观经济运行的可能情景,并预测财政、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融资产市场状况及结构,在此基础上,预测未来利率水平变动趋势,以及金融资产收益率曲线变化趋势。
组合久期是反映利率风险最重要的指标,本基金将根据对市场利率变化趋势的判断,制定组合的目标久期;预期市场利率水平上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。

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、业务发展前景、市场竞争力、财务状况、管理水平及债务水平等因素,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利差。债券信用风险评价需要重点分析企业财务状况、偿债能力、经营效益等财务信息,同时需要综合考虑企业经营环境等因素,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)、不同市场同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上,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。但是在某些情况下,比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改善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。

本基金将对可转换债券对应的基础股票进行分析,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,研发发行人的投资价值;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,估算可转换债券的可转换期权价值。综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,确定可转换债券的投资策略。

5、资产支持证券投资策略
本基金将深入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。

(四)权证投资策略
本基金还可运用组合财产进行权证投资。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:

1.运用权证与标的资产可能形成的对冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要通过波动率套利及风险对冲策略实现相对收益;
2.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;
3.针对不同的市场环境,构建骑墙组合、期指组合、蝶式组合等权证投资组合,形成多元化的盈利模式;

4.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分析,谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。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。

(五)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,以套期保值为主要目的。本基金将充分考量股指期货的流动性及风险收益特征,选择流动性好、交易活跃的投资品种进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对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。

九、基金的业绩比较基准
中证800指数收益率×80%+中债综合指数收益率(全价)×20%
中证800指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证800指数的成分股中证500指数和沪深300指数的成份股一起构成。本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够较好地反映本基金股票投资部分的风险收益特征,中债综合指数具有“泛市场代表性,并在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况”。基于本基金特征,使用上述业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

若未来市场发生变动导致业绩比较基准不再适用或有更合适的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征
本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

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。