

(上接B09版)
住所:上海市虹口区东大名路87号一幢二楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:毛伟平
电话:-
传真:010-99062124
联系人:张静
网址:www.amcfortune.com
客户服务电话:400-817-5666
3.本公司可以根据实际情况增加或者减少基金销售机构,并另行公告。基金销售机构可以根
据情况增加或者减少其销售城市、网点。
(二)代销机构
名称:华宸基金管理有限公司
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址:北京市顺义区天竺空港工业区A区33号通泰大厦B座8层
法定代表人:杨明刚
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63167000
联系人:朱威
(三)法律服务事务所
名称:北京大元律师事务所
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人:朱小钢
联系电话:010-57763688
传真:010-57763777
联系人:李强
经办律师:吴冠霖、李晓
(四)会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场永安大楼17层01-12层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东广场永安大楼17层
执行合伙人:毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58182828
联系人:徐海
经办注册会计师:王珊珊、马剑英

四、基金的名称
本基金名称:华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金。

五、基金的类型
本基金类型:契约型开放式基金。

六、基金的投资目标
在严格控制风险的前提下,本基金以网购消费数据为基础构建量化投资策略,力求实现基
金资产的持续稳健增值。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围包括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(创业板
中小板,以及其他经中国证监会核准上市的股票),债券(含中小企业私募债券、可转换债券)、货
币市场工具(含货币型、权证、货币型证券投资基金、回购协议、国债期货、期权以及法律法规允
许投资的其他金融工具,但不得用于中国证监会禁止投资)。

如法律法规或监管机构允许以其他方式投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将
其纳入投资范围。

本基金的投资比例为:股票投资占基金资产的比例为0%-95%,每个交易日将在扣除股
指期货、国债期货和期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者
到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略
本基金以网购消费数据为基础构建量化投资策略,网购消费数据指的是由蚂蚁基金提
供的网上消费行为统计数据,包括网购消费总金额、销售金额增长率、成交笔数等数据。

本基金是灵活配置型基金,在资产配置和股票投资策略上主要应用网购消费数据,

充分利用公司大数据研究平台的优势,分析网购消费数据,力求为投资者把握网购消费大
数据的投资机会。

(一) 资产配置策略
本基金主要通过自下而上的大数据模型进行资产配置,大数据模型不仅利用网购
消费数据,还应用到新闻热度、自媒体和社交媒体等数据,并通过宏观经济的研究,
结合国家的财政政策和货币政策、证券市场的走势分析对资产配置进行调整,合理确定
基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,并根据时态模型以及市场情况,适时进行动态
调整。

(二) 股票投资策略
本基金在行业配置上根据网购消费数据对每个行业进行景气度分析,行业景气度判断
指标包括行业成交量、行业资产负债率等指标。通常以行业景气度的高低作为判断,预测行业利
润的高低程度,同时结合市况对某些行业进行行业配置,达到超额收益的效果。

(三) 债券投资策略
本基金主要根据对可转债对应的基礎股票进行分析与研究,对那些有着较好盈利能力或成
长前景的上市公司进行筛选,并在其对应的可转债价值的基础上进行配置,以享受企业真实成长带来的
收益。在场内场外两个市场中,本基金将通过估值、成长性和场内场外三个因子对股票的评价价
值,在估价因子上,本基金不仅重视PE、PB等传统指标,也重视企业的分红和负债水平。在成
长因子上,本基金对于企业未来的成长性(如过去净利润、营收等)以及未来的成长性(预期利
润等)进行对比,挖掘处在净利润增速上升的企业进行配置,以享受企业真实成长带来的
收益。在场外场内因子上,本基金将通过数据研究平台的优势,分析个股股价走势与市场反应的
规律,寻找存在显著预期差的企业进行配置,以获得市场极端情绪下被低估的个股的溢价收
益。

本基金深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿
付、风险补偿条款和市场流动性等基本面因素,结合资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产
证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用定价
模型,评估其内在价值。

(四) 固定收益投资策略
本基金深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿
付、风险补偿条款和市场流动性等基本面因素,结合资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产
证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用定价
模型,评估其内在价值。

(五) 股指期货投资策略
本基金在行业配置的前提下,本着谨慎原则,适度参与股指期货投资。通过对现货市场和
期货市场的运行趋势的研究,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行操作,追求在风
险可控的前提下获取超额收益。

本基金在行业配置的前提下,结合对可转债价值的判断下重仓投资,从财务压
力、融资成本、利率风险和流动性风险等方面进行分析,并运用到转债定价和转股定价上。

本基金将着重对可转债对应的基礎股票进行分析与研究,对那些有着较好盈
利能力或成长前景的上市公司进行筛选,并在其对应的可转债价值的基础上进行配置,以享
受企业真实成长带来的收益。在场内场外两个市场中,本基金将通过估值、成长性和场内场外
三个因子对股票的评价价值,在估价因子上,本基金不仅重视PE、PB等传统指标,也重视企业的
分红和负债水平。在成长因子上,本基金对于企业未来的成长性(如过去净利润、营收等)以及未
来的成长性(预期利润等)进行对比,挖掘处在净利润增速上升的企业进行配置,以享
受企业真实成长带来的收益。在场外场内因子上,本基金将通过数据研究平台的优
势,分析个股股价走势与市场反应的规律,寻找存在显著预期差的企业进行配置,以获
得市场极端情绪下被低估的个股的溢价收益。

(六) 固定期权投资策略
本基金主要通过自下而上的大数据模型进行资产配置,大数据模型不仅利用网购
消费数据,还应用到新闻热度、自媒体和社交媒体等数据,并通过宏观经济的研究,
结合国家的财政政策和货币政策、证券市场的走势分析对资产配置进行调整,合理确定
基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,并根据时态模型以及市场情况,适时进行动态
调整。

(七) 银行存款投资策略
本基金将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性风险和风险收益特
征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。通过对现货市场和
期货市场的运行趋势的研究,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行操作,追求在风
险可控的前提下获取超额收益。

(八) 货币市场工具投资策略
本基金深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿
付、风险补偿条款和市场流动性等基本面因素,结合资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产
证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用定价
模型,评估其内在价值。

(九) 基金的资产配置策略
本基金的资产配置主要基于中证主要消费指数“50%+上证国债指数收益率”50%
中证主要消费指数是由中证指数有限公司编制,基于中证800指数,借鉴国际主流行业分类
标准,综合反映沪深两市消费行业企业的整体表现。上证国债指数是由上海证券交易所编制的,具有良好的市
场代表性及较高的知名度,适合作为本基金投资的业绩比较基准。

本基金将着重对可转债对应的基礎股票进行分析与研究,对那些有着较好盈
利能力或成长前景的上市公司进行筛选,并在其对应的可转债价值的基础上进行配置,以享
受企业真实成长带来的收益。在场内场外两个市场中,本基金将通过估值、成长性和场内场外
三个因子对股票的评价价值,在估价因子上,本基金不仅重视PE、PB等传统指标,也重视企业的
分红和负债水平。在成长因子上,本基金对于企业未来的成长性(如过去净利润、营收等)以及未
来的成长性(预期利润等)进行对比,挖掘处在净利润增速上升的企业进行配置,以享
受企业真实成长带来的收益。在场外场内因子上,本基金将通过数据研究平台的优
势,分析个股股价走势与市场反应的规律,寻找存在显著预期差的企业进行配置,以获
得市场极端情绪下被低估的个股的溢价收益。

(十) 其他投资策略
本基金将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性风险和风险收益特
征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。通过对现货市场和
期货市场的运行趋势的研究,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行操作,追求在风
险可控的前提下获取超额收益。

本基金深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿
付、风险补偿条款和市场流动性等基本面因素,结合资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产
证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用定价
模型,评估其内在价值。

(十一) 基金的投资组合报告
本基金投资组合情况的说明
截至报告期末本基金资产净值为1,000,000,000.00元,其中基金资产净值为1,000,000,000.00元,占基
金资产净值的比例为100%。

本基金投资组合情况的变动原因
本基金投资组合情况的变动原因与本报告期初相比无重大变化。

本基金投资组合情况的变动原因
本基金投资组合情况的变动原因与本报告期初相比无重大变化。</p