

信息披露

(上接B043版)
住所:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119号
办公地址:北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号
法定代表人:许现良
客服电话:40081109580
77) 一路财富(北京)基金销售股份有限公司
住所:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
法定代表人:吴雪涛
电话:010-88312877-8028
联系人:段路璐
客服电话:400-001-1566
78) 上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:李喜春
客服电话:400-921-7733
79) 深圳富济基金销售有限公司
住所:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元
法定代表人:刘鹏宇
客服电话:0755-83999907
80) 北京广源达信基金销售有限公司
住所:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
客服电话:400-623-6060
81) 上海云湾基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区新金桥27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区
法定代表人:冯轶明
电话:021-20530224
联系人:江晖
客服电话:400-820-1515
82) 上海联泰基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:尹彬彬
电话:021-52822063
联系人:兰敏
客服电话:400-118-1188
83) 北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B室
法定代表人:曲馨月
电话:010-56176118
联系人:张旭
客服电话:400-100-3391
84) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
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)
办公地址:深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE
法定代表人:高峰
客服电话:400-804-8688
85) 深圳前海财厚基金销售有限公司
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)
办公地址:深圳市南山区南山大道1088号南园枫叶大厦15层15K室
法定代表人:杨艳平
客服电话:0755-86575665
86) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区星海中心龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中心龙园3号
法定代表人:李春光
电话:0411-88891212
联系人:徐江
客服电话:400-0411-001
87) 上海万得基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:黄伟
电话:021-51327185
联系人:陈亚非
客服电话:400-799-1888
88) 北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座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11层
法定代表人:王俐
客服电话:400-619-9059
89) 深圳市金斧子基金销售有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
法定代表人:赖钰军
电话:0755-29330513
联系人:刘昕霞
客服电话:400-930-0660
90) 北京肯特瑞基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人:江卉
客服电话:95118
91) 北京辉路汇富基金销售有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1
法定代表人:许宁
电话:010-51455516
联系人:周雯
客服电话:400-829-1218
92) 万家财富基金销售(天津)有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:张军
电话:010-5901384
联系人:王芳芳
客服电话:010-59013842
93) 上海大智慧基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人:申健
电话:021-20219988
联系人:张妮
客服电话:021-20292031
94) 和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址: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
客服电话:400-920-0022
95) 上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号的太平金融大厦1503-1504室
法定代表人:王翔
电话:021-65370077-209
联系人:俞申麒
客服电话:400-820-5369
96) 凤凰信信(银川)基金销售有限公司
住所:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:张旭
客服电话:400-810-5919
97) 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
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
客服电话:95177
98) 深圳盈信基金销售有限公司
住所:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
办公地址:大连市中山区南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
电话:0411-66661322
联系人:王清臣
客服电话:4007-903-688
99) 乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
住所:北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
办公地址:北京市西城区德胜门外大街合生财富广场1302室

法定代表人:董云巍
客服电话:400-088-8080
100) 北京玺泰基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层
法定代表人:钟斐斐
电话:010-61840688
联系人:戚晓强
客服电话:400-159-9288
101) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7楼23层1号、4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7楼23层1号、4号
法定代表人:陶捷
客服电话:4000-027-9899
102) 天津国美基金销售有限公司
住所:天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层
法定代表人:丁东华
电话:010-59287105
联系人:许艳
客服电话:400-111-0889
103) 北京格上富信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:叶倩倩
电话:010-85594745
联系人:张林
客服电话:400-066-8586
104) 上海挖财基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:冷飞
客服电话:021-50810673
105) 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
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层
法定代表人:毛淮平
106) 中民财富基金销售(上海)有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层
法定代表人:张洪军
客服电话:400-876-5716
107) 深圳信诚基金销售有限公司
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)
办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元
法定代表人:周文
客服电话:0755-23946579
108) 喜鹊财富基金销售有限公司
住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
法定代表人:陈路路
客服电话:4006997719
109) 通华财富(上海)基金销售有限公司
住所:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人:沈丹义
客服电话:4001019301 / 95193
110) 深圳市小牛基金销售有限公司
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)
办公地址:深圳市福田区彩田路2009号瀚森大厦17楼
法定代表人:李俊
客服电话:4006695666
111) 沈阳腾龙投资顾问有限公司
住所:辽宁省沈阳市沈河区白塔二南街18-2号B座601
办公地址:辽宁省沈阳市沈河区白塔二南街18-2号B座601
法定代表人:朱荣晖
客服电话:400-003-5811
112) 厦门市鑫鼎股权投资有限公司
住所:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人:陈洪生
客服电话:400-918-0808
113) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财经中心A座5层
法定代表人:钱昊昊
客服电话:4008-909-998
114) 贵州省贵文文化基金销售有限公司
住所:贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际A栋2单元75层17号
办公地址:贵州省贵阳市南明区兴业西路CCDI大楼一楼
法定代表人:陈成
客服电话:0851-85407888
115) 永安财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
电话:010-65309516
联系人:李海燕
客服电话:400-673-7010
116) 嘉实财富管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
电话:010-85097570
联系人:余永健
客服电话:400-021-8880
117) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:戎兵
电话:010-52858244
联系人:魏晨
客服电话:400-6099-200
118) 和耕财富基金销售有限公司
住所:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路东、康宁街166号楼6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号国际电子城360大厦A座
法定代表人:王旋
客服电话:4000-555-671
119) 民商基金销售(上海)有限公司
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
法定代表人:黄惠康
客服电话:021-50206003
120) 大河财富基金销售有限公司
住所:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层12号
法定代表人:王荻
客服电话:0851-88235678
121) 大连网金基金销售有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
法定代表人:樊怀东
客服电话:4008899100
122) 成都华羿恒信基金销售有限公司
住所:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
法定代表人:赵壁
客服电话:400-8010-009
123) 江苏汇林保大基金销售有限公司
住所:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
法定代表人:吴言林
客服电话:025-86663409
124) 泰信财富基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区建国路92号-4至24层内18层1804
法定代表人:张冲
客服电话:400-004-8821
125) 海银基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
法定代表人:惠晓川
客户服务热线:400-808-1016
126) 中信期货有限公司
住所: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: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

电话:13718246886/010-60834022
联系人:刘宏莹
客服电话:400-990-8826
127) 东海期货有限责任公司
住所:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
法定代表人:陈太康
客服电话:95531/400888588
128) 大有期货有限公司
住所:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
法定代表人:颜如意
电话:0731-84409106、0731-84409130
联系人:马科、王霞
客服电话:4006-365-058
129) 阳光人寿保险股份有限公司
住所:海南省三亚市迎宾馆360-1号三亚阳光金融广场16层
法定代表人:李科
客服电话:95510
130) 玄元保险代理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马永涛
客服电话:021-50701082
基金管理人可根据有关法律法规的要求增加、更换其他机构销售本基金,并及时公告。
二、注册登记机构
名称:中融基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B
办公地址:北京市朝阳区东风南路3号院中融信托北京园区C座4层、5层
法定代表人:王瑶
电话:010-56517000
传真:010-56517001
联系人:李同庆
网址:www.zrfunds.com.cn
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:安冬
经办律师:安冬、陆奇
四、审计基金资产的会计师事务所
名称:上会会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
办公地址:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼执行事务合伙人:张静璇(首席合伙人)
电话:021-52920000
传真:021-52921369
经办注册会计师:陈大愚、江嘉炜
联系人:杨伟平

第四部分 基金的名称

中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金类型、运作方式与存续期间

1. 基金类型:混合型。
2. 基金运作方式:契约型开放式。
3. 基金存续期间:不定期。

第六部分 基金的投资目标

本基金以追求长期资本增值为目的,通过重点投资物联网主题相关的优质资产,在充分控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、中小企业私募债券、次级债券等)、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、债券回购、同业存单、权证、股指期货、国债期货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,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为0%-95%,其中投资于“物联网主题”相关资产的比例不低于非现金基金资产的约80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金后,应当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。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

股指期货、国债期货的投资比例应符合法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略

1、资产配置策略
本基金从宏观面、政策面、基本面和资金面等多方面进行综合分析,研判国内外经济发展趋势,在严格控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券及货币市场工具等大类资产的投资比例,并根据宏观经济形势和市场实际的变化适时进行动态调整。
2、股票投资策略
本基金主要投资于物联网主题的相关资产,通过发掘业绩持续增长、竞争优势明显、估值水平相对合理的优质上市公司进行投资布局。
(1)物联网主题界定
物联网是指基于通讯及网络连接,实现物与物、人与物、人与人之间信息交换的智能生态系统。具体而言,物联网通过射频识别(RFID)、红外感应器、全球定位系统、激光扫描器等信息传感设备,按约定的协议,把任何物品与互联网相连接,进行信息交换和通信,在“万物互联”所构筑的网络生态基础上,实现智能化的识别、定位、跟踪、监控和管理。
本基金主要投资的物联网主题相关行业,主要包括:
1)物联网感知制造行业:与物联网感知功能密切相关的制造业,包括传感器/节点/网关、射频识别、二维码等核心制造业、仪器仪表、嵌入式系统等配套产业、微纳器件、集成电路、微能源、新材料等原材料产业。
2)物联网通信行业:与物联网通信功能紧密相关的基础制造、运营等产业,包括近距离无线通信芯片与终端制造产业、M2M(Machine to machine)终端、通信模块、有线/无线通信网络设备、计算机、电子等产业。
3)物联网服务行业:物联网专业服务、增值服务等服务行业,包括海量数据存储、处理与决策等基础设施服务业、操作系统、数据库、中间件、应用软件、系统集成等软件开发与集成服务业,包括线上社交、移动网络、网络金融、在视频、移动支付、网络游戏等服务产业。
4)物联网应用行业:通过应用传感器接口、超高频和微波射频识别、智能网关、M2M(Machine to machine)和微支付等物联网技术提高智能化的行业,包括环保、交通、电力、物流等。

物联网的概念本身会随着技术的进步而不断更新,基金管理人将持续跟踪相关行业的最新技术及商业模式发展,并对物联网概念的具体涉及行业进行更新调整。
(2)行业配置
本基金的股票池构建以物联网主题相关行业为主,从定性分析和定量分析两个角度进行考察,依据行业周期轮动特征以及行业相对投资价值评估结果,得出各行业的相对投资价值与比较优势。本基金将密切跟踪物联网带来的投资机遇,并积极把握以物联网为驱动力、具备增长空间的相关行业所带来的投资机会。
(3)股票池与投资组合构建
本基金将采取“自下而上”和“自而上”相结合的精选策略,基于对相关上市公司深入的基本面研究,结合实地调研,精选股票构建股票投资组合。
本基金管理人的股票投资具体分为以下几个层次进行:
1)品质筛选
筛选出在公司治理、财务状况、竞争优势等方面符合基本品质要求的公司,构建备选股票池。主要筛选指标包括:
①盈利能力指标(如P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等)
②经营效率指标(如ROE、ROA、Return on operating assets等)
③财务状况指标(如D/A、流动比率等)
2)价值评估
在备选股票池基础上,本基金将进一步通过对备选上市公司深入的案头分析,结合实地调研,以定性+定量相结合的方法对公司价值进行综合评估,构建股票组合。其中,本基金重点关注以物联网为驱动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的上市公司,对其内在价值进行评估,在明确的价值评估基础上精选优质地质的投资标的构建股票组合,对组合进行动态跟踪和维护。

3、债券投资策略
本基金在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以久期控制和结构分析策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。
4、中小企业私募债券投资策略
本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。
5、衍生品投资策略
(1)股指期货投资策略
在股指期货投资上,本基金以避险保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中,将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究现货和期货市场的发展趋势,运用定价模型对其进行合理估值,谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调整投资组合仓位,以降低组合风险、提高组合的运作效率。
(2)国债期货投资策略
国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人通过构建量化分析体系,对国债期货和利率基差、国债期货的流动性、隐含波动率水平、套期保值的稳定性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。
(3)权证投资策略
本基金还将在法规允许的范围内,基于谨慎原则利用权证以及其它金融工具进行套利交易或风险管理,为基金收益提供增加价值。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合。
如法律法规或监管机构以后允许本类基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对投资组合整体收益为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下,通过对标的品种的研究,谨慎投资。
6、资产支持证券投资策略
资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。
九、基金的业绩比较基准
沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
沪深300指数是由中证指数有限公司编制,从上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本的综合性指数;样本选择标准为规模大、流动性好的股票,目前沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种,交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性,能反映出市场利率的瞬息变化,也使得上证国债指数能真实地標示出利率市场整体的收益风险度。因此本基金选取的基准具有较好的代表性。
如果今后法律法规发生变化,或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用,又或者市场出现更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征业绩比较基准,则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩比较基准并报中国证监会备案,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

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。
本基金的基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年9月19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2019年6月30日,本报告期内所列为数据未经审计。

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	28,183,424.99	74.86
	其中:股票	28,183,424.99	74.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	378,112.90	1.00
	其中:债券	378,112.90	1.00
	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	9,001,357.66	23.91
8	其他资产	83,478.32	0.22
9	合计	37,646,174.07	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

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	986,462.00	2.77
B	采矿业	22,365.00	0.06
C	制造业	19,931,371.41	55.92
D	电力、热力、燃气及水生产	-	-
	和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,468,303.68	4.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	16,103.36	0.05
J	金融业	5,414,137.54	15.19
K	房地产业	344,682.00	0.97
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	28,183,424.99	79.07

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

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	600036	招商银行	52,600	1,892,548.00	5.31
2	000651	格力电器	32,200	1,775,950.00	4.98
3	601318	中国平安	17,800	1,577,238.00	4.42
4	600887	伊泰股份	42,900	1,433,289.00	4.02
5	000858	五粮液	10,400	1,226,680.00	3.44
6	002955	壹连科技	53,200	1,117,732.00	3.14
7	601033	长城汽车	130,777	1,081,525.79	3.03
8	600104	上汽集团	41,600	1,060,800.00	2.98
9	002372	伟星新材	58,680	1,021,032.00	2.86
10	000063	中兴通讯	28,900	940,117.00	2.64

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债	-	-	-
4	企业债	-	-	-
5	企业短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转换(可交换)债	-	378,112.90	1.06
8	同业存单	-	-	-
9	其他	-	-	-
10	合计	-	378,112.90	1.06

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113522	恒升转债	2,420	251,196.00	0.70
2	128067	一心转债	454	50,961.50	0.14
3	110054	通威转债	340	41,735.40	0.12
4	128068	和而转债	252	25,200.00	0.07
5	113028	环境转债	90	9,000.00	0.03

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。
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。
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。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
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 报告期内基金投资的前十名证券除招商银行(600036)外其他证券的发行主体本期未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。
深圳保监局2018年7月9日对招商银行股份有限公司(深保监罚[2018]23号)公布实施行政处罚,前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。
11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	55,326.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,820.32
5	应收申购款	25,331.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	83,478.32

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113522	恒升转债	251,196.00	0.70

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2019年6月30日。
本基金合同生效日为2017年2月27日,基金合同生效以来基金业绩业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:
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