汇添富科技创新灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2020年4月14日更新)

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示

汇添富科技创新灵活配置混合型证券投资基金(基金简称:汇添富科技创新混合;A类份额基金代码:007355;C类份额基金代码:007356;以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会证监许可2019年4月4日【2019】641号文注册募集。本基金基金合同于2019年5月6日正式生效。

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。

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,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险。投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券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,由于基金投资者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基金管理风险,本基金的特定风险等等。

本基金更新招募说明书"基金的投资"章节中有关"风险收益特征"的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行"销售适当性风险评价",不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的基金产品"风险等级评价"与"基金的投资"章节中"风险收益特征"的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

本基金为混合型基金,其预期风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点(以下简称"港股通机制")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")的,会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,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。

本基金投资国内上市的科创板股票,会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括科创板上市公司股价波动较大的风险(科创板对个股每日涨跌幅限制为20%,且新股上市后的前5个交易日不设置涨跌幅限制,股价可能表现出比A股其他板块更为剧烈的波动)、科创板上市公司退市的风险(科创板执行比A股其他板块更为严格退市标准,且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节,可能会对基金净值产生不利影响)、科创板股票流动性较差的风险(由于科创板投资门槛高于A股其他板块,整体版块活跃度可能弱于A股其他版块;科创板机构投资者占比较大,版块股票存在一致性预期的可能性高于A股其他版块,在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的可能)、本基金投资集中度相对较高的风险(本基金主要投资科技创新主题股票,该类股票的商业模式、盈利模式等可能存在一定的相似性,因此,持仓股票股价存在同向波动的可能,从而产生对基金净值不利的影响)等。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新,同时对基金管理人、基金托管人、财务数据和净值表现等其他信息一并更新,更新所载内容截止日为 2020年4月14日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日。

一、基金管理人

一、基金管理人简况
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼20楼
法定代表人:李文
成立时间:2005年2月3日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监基金字[2005]5号
注册资本:人民币13272.4224万元
联系人:李鹏
联系电话:(021)28932888
股东名称及其出资比例:

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

二、主要人员情况
1、董事会成员

李文先生,2015年4月16日担任董事长。国籍:中国,厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长,汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长,中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副行长、副局长,中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长,东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理,稽核总部总经理,东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理,汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生,2016年11月20日担任董事。国籍:中国,上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理,上海上报资产管理有限公司董事长,上海文化产权交易所股份有限公司董事长,上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记,上海机械进出口(集团)有限公司副总裁,上海市对外经济贸易委员会科技进口处副处长,上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长,上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任,上海国际集团有限公司行政管理总部总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长,上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生,2018年3月21日担任董事。国籍:中国,上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理,东航集团财务有限责任公司副总经理,国泰人寿保险有限责任公司副总经理,东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

张晖先生,2015年4月16日担任董事,总经理。国籍:中国,上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理,汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师,富国基金管理有限公司研究主管和基金经理,汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监,曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生,2015年4月16日担任独立董事。国籍:中国香港,厦门大学经济学博士,加拿大Saskatchewan大学工商管理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计员,五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多分所审计员,厦门大学会计师事务所副主任会计师,厦门大学经济学院讲师、副教授,伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者,美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者,加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授(tenured),香港大学商学院访问教授,香港浸会大学商学院会计与法律系教授,博导,系主任。

杨燕青女士,2011年12月19日担任独立董事,国籍:中国,复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑,第一财经研究院院长,国家金融与发展实验室特邀高级研究员,上海政协委员,《第一财经日报》创始编委之一,第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人,《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进(Shangjin Wei)先生,2020年1月9日担任独立董事,国籍:美国,加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授,世界银行顾问,国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

2、监事会成员

任瑞良先生,2004年10月20日担任监事,2015年6月30日担任监事会主席。国籍:中国,大学学历,会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生,2015年9月8日担任监事。国籍:中国,硕士研究生,注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员,金信证券规划发展部总经理助理、秘书处副主任(主持工作),东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生,2015年6月30日担任监事,国籍:中国,国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司,东航集团财务有限责任公司。

王静女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部,东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监,汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生,2013年8月8日担任职工监事,国籍:中国,北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司,泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

张晖先生,2015年6月25日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

雷继明先生,2012年3月7日担任副总经理。国籍:中国,工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理,中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

娄焱女士,2013年1月7日担任副总经理。国籍:中国,金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作,负责投资银行、证券投资研究,以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

袁建军先生,2015年8月5日担任副总经理。国籍:中国,金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理,汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理,并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生,2017年3月3日担任副总经理。国籍:中国,武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长,厦门建行信用卡部副处长、处长,厦门建行信息技术部处长,建总行北京开发中心负责人,建总行信息技术管理部副总经理,建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任,建总行信息技术管理部资深专员(副总经理级)。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生,2015年6月25日担任督察长。国籍:中国,上海财经大学经济学博士,历任上海证监局主任科员、副处长,上海农商银行同业金融部副总经理,汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

马翔先生,国籍:中国,清华大学工学硕士。9年证券从业经验。2011年加入汇添富基金任行业分析师,2016年3月11日至今任汇添富民营活力混合基金的基金经理,2019年5月6日至今任汇添富科技创新混合基金的基金经理,2020年3月19日至今任汇添富盈安混合基金的基金经理。

刘江先生,国籍:中国,清华大学工学硕士,德国亚琛工大工学硕士,9年证券从业经验。2011年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任医药行业分析师,2015年6月18日至今任汇添富医疗服务混合基金的基金经理,2017年8月16日至今任添富全球医疗混合(QDII)基金的基金经理,2018年7月5日至今任添富3年封闭配售混合(LOF)基金的基金经理,2018年8月8日至今任添富创新医药混合基金的基金经理,2019年5月6日至今任汇添富科技创新混合基金的基金经理。

5、投资决策委员会

主席:袁建军先生(副总经理)

成员:韩贤旺先生(首席经济学家)、王栩(总经理助理,权益投资总监)、陆文磊(总经理助理,固定收益投资总监)、劳杰男(研究总监)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人: 陈四清
注册资本:人民币35,640,625.7089万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2019年9月,中国工商银行资产托管部共有员工208人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2019年9月,中国工商银行共托管证券投资基金1006只。自2003年以来,本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的68项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

一、基金份额销售机构
(1)直销机构
1)汇添富基金管理股份有限公司直销中心
住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室
办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932893
传真:(021)50199035或(021)50199036
联系人:陈卓膺
客户服务电话:400-888-9918(免长途话费)
网址:www.99fund.com
邮箱:guitai@htffund.com
2)汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统(trade.99fund.com)
(2)代销机构
本基金的代销机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并在基金管理人网站公示。
二、登记机构
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室
办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932888
传真:(021)28932876
联系人:韩从慧
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
经办律师:黎明、陈颖华
联系人:陈颖华
四、审计基金财产的会计师事务所
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号东方广场安永大楼17层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
邮政编码:100738
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:010-58153000
传真:010-85188298
业务联系人:徐艳
经办会计师:徐艳、许培菁

四、基金的名称

本基金名称:汇添富科技创新灵活配置混合型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为混合型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,在科学严格管理风险的前提下,重点投资于科技创新相关的优质上市公司,谋求基金资产的中长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以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相关规定)。本基金还可根据法律法规参与融资。

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:股票资产占基金资产的比例为0%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%);每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的保证金以后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。本基金投资于科创主题的证券资产占非现金基金资产的比例不低于80%。

八、基金的投资策略

本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略主要用于挖掘股票市场中与科技创新相关的优质上市公司。

1、资产配置策略

本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素(其中,基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据;政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策;市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场P/E与历史平均水平的偏离程度等),结合全球宏观经济形势,研判国内外经济的发展趋势,并在严格控制投资组合风险的前提下,确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具、金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。

本基金的股票投资比例主要依据股票基准指数整体估值水平在历史数据中的分位值排位,相应调整股票仓位,有效控制下行风险。其中,股票基准指数为中国战略新兴产业成份指数,估值水平主要使用股票基准指数的市销率PS(TTM)。如果由于申购赎回、市场波动等原因致使股票类资产的投资比例连续5个工作日不符合目标配置要求,基金管理人应在第5个工作日当日起10个工作日内使基金的股票投资比例达到下述约定:

市销率区间	股票资产占基金资产的比例(S)
中国战略新兴产业成份指数市销率处于历史的前25%分位	0%≤S<50%
中国战略新兴产业成份指数市销率处于历史的后10%分位	50%<S≤95%
其他	30%<S≤85%

注:

1、历史的前25%分位指将中国战略新兴产业成份指数历史市销率PS(TTM)从大到小进行排序,排位在该数列的前25%;

2、历史的后10%分位指将中国战略新兴产业成份指数历史市销率PS(TTM)从大到小进行排序,排位在该数列的后10%。

本基金将科学把握建仓节奏,遵守投资策略,适时控制仓位,力求通过仓位控制进一步降低基金资产收益的波动性。如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、或者市场上出现更加适合用于本基金上述策略的指数出现或随着市场环境、相关政策的不断变化,上述策略或使用的基准指数不再适用,在履行适当程序后,本基金将根据实际情况进行相应调整并及时公告。

2、个股精选策略

(1)科技创新相关公司范畴的界定

本基金所指科技创新主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求的科技创新,主要投资于包括符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高,属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业,属于互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合等方面的科技创新上市公司。

本基金将重点关注以下六大领域:

①新一代信息技术领域,主要包括半导体和集成电路、电子信息、下一代信息网络、人工智能、大数据、云计算、新兴软件、互联网、物联网和智能硬件等;

②高端装备领域,主要包括智能制造、航空航天、先进轨道交通、海洋工程装备及相关技术服务等;

③新材料领域,主要包括先进钢铁材料、先进有色金属材料、先进石化化工新材料、先进无机非金属材料、高性能复合材料、前沿新材料及相关技术服务等;

④新能源领域,主要包括先进核电、大型风电、高效光电光热、高效储能及相关技术服务等;

⑤节能环保领域,主要包括高效节能产品及设备、先进环保技术装备、先进环保产品、资源循环利用、新能源汽车整车、新能源汽车关键零部件、动力电池及相关技术服务等;

⑥生物医药领域,主要包括生物制品、高端化学药、高端医疗设备与器械及相关技术服务等。

⑦符合科创板定位的其他领域。

同时,本基金对科技创新主题的产业发展进行密切跟踪,随着市场环境、相关政策的不断变化,相关主题的上市公司的范围也会相应改变。履行适当程序后,本基金将根据实际情况调整相关主题概念和投资范围的认定。

(2)股票库的构建

1)初选股票库的构建

本基金对初选股票库的构建,是在科技创新相关上市公司的范畴,过滤掉明显不具备投资价值的股票。剔除的股票包括法律法规和本基金管理人制度明确禁止投资的股票、筹码集中度高且流动性差的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等。

同时,本基金将密切关注股票市场动态,根据实际情况调整初选股票库。

2)核心股票库的建立

在初选股票库的基础上,本基金将结合定量评估、定性分析和估值分析来综合评估备选公司的投资价值,精选公司治理优良、竞争优势突出、行业前景光明、基本面良好、盈利稳定增长、估值合理,且与科技创新相关的上市公司。具体而言,主要考虑以下几方面因素:

①治理结构、公司管理层和财务状况评价

本基金主要从股东结构和激励约束机制两方面对公司治理进行分析。股东结构主要从股东背景、股权变更情况、关联交易、独立性等方面予以考察,激励约束机制则从股权激励、管理层与股东利益的一致性等方面考察。

本基金将致力于寻找中国优秀的企业家以及其管理的企业。优秀的企业家具备出色的经营才能,而且怀着清晰、长期的愿景,充满激情,不懈努力,执行力强。

本基金投资标的的财务状况应当健康和稳健。通过对目标企业的资产负债、损益、现金流量的分析,评估企业盈利能力、营运能力、偿债能力及增长能力等财务状况。

②企业竞争优势评估

企业竞争优势评估主要从生产、市场、技术和政策环境等四方面进行分析。生产优势集中体现在能以相对更低的成本为顾客提供更好的产品或服务。市场优势主要表现在产品线、营销渠道及品牌竞争力三方面。技术优势从专利权及知识产权保护、研究开发两方面考察。政策环境主要关注所在行业是否符合国家产业政策的方向。

③行业背景和商业模式分析

本基金主要从行业集中度和行业地位两方面对行业背景进行分析,优选具有较好的行业集中度及行业地位,并具备独特核心竞争优势的企业。企业所在行业有一定的集中度,其主导产品的市场份额高于市场平均水准,而且在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等一个或数个方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的优势。

优秀的商业模式通常有以下两种:第一,较强的定价能力,在行业地位领先且稳固,对上下游具有较强的议价能力,能够通过不断提升产品价格或降低成本以提高盈利能力,即使在宏观经济向下的阶段,能够通过控制产量等方式延缓甚至避免价格的下跌;第二,扩张成本低,即利润增长对资本的需求和依赖较低,表现在财务数据上就是净资产收益率高,很少或者几乎不需要股权融资就可以实现较高增长,最好商业模式能够较快复制,能够以较快的速度形成规模效益。

3)估值精选

当选择出具有上述特征的企业后,本基金将根据企业所在行业所适用的估值指标进行价值评估,选择股价没有充分反映其长期投资价值的标的,权衡风险收益特征后,构建投资组合。

(3)科创板上市股票的投资策略

考虑到科创板与A股其他版块的差异,对于科创板上市的股票,本基金除按照上述"自下而上"的个股精选策略,还将多维度分析公司科技创新能力,具体包括研发投入绝对额及营收占比,研发人员数量、单人产出和人均薪酬,研发团队组织模式和激励方式等,重点考察公司能否通过持续不断的研发投入,构建商业模式护城河,和竞争对手拉开差距,是否积极应对产业变化趋势,提前进行研发储备和产品布局,以求持续成长并创造股东回报;同时,也会考量股票自身的流动性,决定个股在组合中的比例;考虑不同行业股票的成长驱动力不同,均衡配置各行业的资产比重。

考虑到科创板允许暂未盈利的公司上市,本基金将以发展眼光看待科创板企业未来的成长,评估其在销产品的增长速度,既有客户或业务流水的货币化能力,所获专利的变现价值,研发团队的成果转化能力和扩张能力等。同时,根据不同的商业模式,将采用不同的估值方法衡量公司合理定价,包括市盈率、市销率、市净率、EV/FCFF、EV/GMV、EV/EBITDA、研发管线未来现金流折现、有效客户价值估值等。

对于拥有成熟产品的公司,本基金将评估其在销产品销售额和盈利额的增长速度,采用市盈率对公司进行估值,考察公司的市盈率和增速是否匹配。对于有大量客户而尚未商业化变现的企业,本基金将考虑其客户未来变现能力。一般情况下,将根据客户未来的变现能力进行现金流折现衡量当前企业价值。对于业务流水(GMV)快速增长而还没有进行货币化的公司,将采用P/GMV的方法进行估值。对于企业专利,将分析该专利未来可能形成的产品,评估其稳态销售额以及盈利水平,进行现金流贴现。高技术高研发投入的公司,将考察单个研发人员对应的市值,与同行上市公司进行比较,并评估其偏差的合理性。对于有多条业务线的上市公司,将会对其产品线进行分拆估值。

(4)香港联合交易所上市股票的投资策略

考虑到香港股票市场与 A 股股票市场的差异,对于香港联合交易所上市的股票,本基金除按照上述"自下而上"的个股精选策略,还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为,以及世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素,精选符合本基金投资目标的香港联合交易所上市公司股票。

3、债券投资策略

本基金的债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性,在深入分析宏观经济、货币政策以及市场结构的基础上,灵活运用各种消极和积极策略。

消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。利率免疫策略就是构造一个恰当的债券组合,使得利率变动导致的价格波动风险与再投资风险相互抵消。这样无论市场利率如何变化,债券组合都能获得一个比较确定的收益率。

积极债券投资的目标是利用市场定价的无效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益。本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。利率期限结构描述了债券市场的平均收益率水平以及不同期限债券之间的收益率差别,它决定于三个要素:货币市场利率、均衡真实利率和预期通货膨胀率。在深入分析利率期限结构的基础上,本基金将运用利率预期策略、收益率曲线追踪策略进行积极投资。

4、资产支持证券投资策略

本基金将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。

5、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人股指期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

6、股票期权投资策略

基金管理人在进行股票期权投资前将建立股票期权投资决策小组,负责股票期权投资管理的相关事项。

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人股票期权投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种,本基金将在履行适当程序后,纳入投资范围并制定相应投资策略。

7、融资投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券及转融通业务法律法规的实施进展,待基金参与融券及转融通业务的相关规定颁布后,将在届时相应法律法规的框架内,制订符合本基金投资目标的投资策略。同时结合对融券及转融通的研究,在充分考虑风险和收益特征的前提下,谨慎进行投资。

8、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在追求基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的中长期稳定增值。

九、基金的业绩比较基准

中国战略新兴产业成份指数收益率*60%+中债综合财富指数收益率*30%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10%

选择该业绩比较基准,是基于以下因素:

1、中国战略新兴产业成份指数是由中证指数有限公司编制,选取节能环保、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造、新能源产业、新材料产业、新能源汽车、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的100家上市公司,采用自由流通股本加权方式,以反映中国战略新兴产业上市公司的走势,市场代表性较强,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

2、恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的 50家上市公司股票为成分股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数;

3、中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券,综合反映了债券市场整体价格和回报情况;

4、基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。

本基金将投资港股通标的股票,将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、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年03月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自2019年05月06日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§1 投资组合报告

1.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	901,271,243.88	93.18
	其中:股票	901,271,243.88	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	963,577.80	0.10
	其中:债券	963,577.80	0.10
	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	54,309,026.86	5.61
8	其他各项资产	10,720,870.23	1.11
9	合计	967,264,718.77	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币72,783,325.34元,占期末净值比例7.62%。

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	-	-
C	制造业	513,924,095.35	53.77
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	21,372,114.86	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,739,147.56	20.06
J	金融业	2,296,038.98	0.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,978,760.00	2.09
M	科学研究和技术服务业	28,643,209.24	3.00
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	44,623,230.51	4.67
R	文化、体育和娱乐业	5,904,744.00	0.62
S	综合	-	-
	合计	828,487,918.54	86.69

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	-	-
消费者非必需品	1,842,081.99	0.19
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	18,303,418.99	1.92
工业	-	-
信息技术	22,871,305.78	2.39
电信服务	29,766,518.58	3.11
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	72,783,325.34	7.62

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
(2)由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

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	300003	乐普医疗	1,580,846	52,294,385.68	5.47
2	300136	信维通信	1,145,800	51,996,404.00	5.44
3	603613	国联股份	662,283	50,114,954.61	5.24
4	603516	淳中科技	1,227,677	46,639,449.23	4.88
5	002044	美年健康	2,996,859	44,623,230.51	4.67
6	002353	杰瑞股份	1,206,051	44,575,644.96	4.66
7	603658	安图生物	424,943	40,956,006.34	4.29
8	600570	恒生电子	523,039	40,655,821.47	4.25
9	000063	中兴通讯	782,600	27,696,214.00	2.90
9	00763	中兴通讯	200,000	4,272,870.60	0.45
11	300285	国瓷材料	1,319,635	30,153,659.75	3.16
12	300773	拉卡拉	370,900	29,104,523.00	3.05
13	603259	药明康德	310,727	28,624,171.24	2.99
14	002938	鹏鼎控股	608,057	27,301,759.30	2.86
15	688023	安恒信息	173,176	24,244,640.00	2.54
16	00700	腾讯控股	71,500	24,056,530.21	2.52
17	002602	世纪华通	1,735,506	19,836,833.58	2.08
18	300369	绿盟科技	1,083,400	19,631,208.00	2.05
19	603489	八方股份	186,607	19,172,003.18	2.01
20	300207	欣旺达	979,160	19,113,203.20	2.00
21	002685	华东重机	2,784,052	18,875,872.56	1.98
22	00285	比亚迪电子	1,386,000	18,598,435.18	1.95
23	01951	锦欣生殖	1,942,000	18,126,681.60	1.90
24	300684	中石科技	690,620	17,921,589.00	1.88
25	002127	南极电商	1,231,800	13,438,938.00	1.41
26	300073	当升科技	486,100	13,270,530.00	1.39
27	002415	海康威视	394,400	12,912,656.00	1.35
28	603939	益丰药房	168,963	12,371,470.86	1.29
29	601965	中国汽研	1,480,800	12,261,024.00	1.28
30	603786	科博达	195,168	10,178,011.20	1.06
31	300212	易华录	289,300	9,674,192.00	1.01
32	002624	完美世界	215,284	9,502,635.76	0.99
33	002212	南洋股份	485,700	9,233,157.00	0.97
34	000026	飞亚达	811,600	9,000,644.00	0.94
35	300224	正海磁材	882,900	8,422,866.00	0.88
36	688058	宝兰德	74,667	7,403,979.72	0.77
37	002635	安洁科技	441,200	7,354,804.00	0.77
38	002027	分众传媒	1,044,700	6,539,822.00	0.68
39	002050	三花智控	341,900	5,925,127.00	0.62
40	300413	芒果超媒	168,900	5,904,744.00	0.62
41	00788	中国铁塔	3,706,000	5,709,988.37	0.60
42	300373	扬杰科技	209,600	3,605,120.00	0.38
43	300750	宁德时代	29,900	3,181,360.00	0.33
44	688006	杭可科技	75,523	3,000,528.79	0.31
45	02238	广汽集团	212,000	1,842,081.99	0.19
46	600584	长电科技	82,700	1,817,746.00	0.19
47	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.14
48	002925	盈趣科技	22,100	971,295.00	0.10
49	002099	海翔药业	134,300	956,216.00	0.10
50	002384	东山精密	41,200	953,780.00	0.10
51	300122	智飞生物	19,100	948,506.00	0.10
52	300601	康泰生物	10,700	939,353.00	0.10
53	300253	卫宁健康	62,100	930,258.00	0.10
54	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.10
55	300674	宇信科技	18,100	476,935.00	0.05
56	688116	天奈科技	15,113	460,493.11	0.05
57	688139	海尔生物	13,249	317,976.00	0.03
58	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.02
59	02269	药明生物	2,000	176,737.39	0.02
60	002970	锐明技术	787	96,478.33	0.01
61	600703	三安光电	4,900	89,964.00	0.01
62	688310	迈得医疗	3,276	88,845.12	0.01
63	603501	韦尔股份	600	86,040.00	0.01
64	688008	澜起科技	881	63,088.41	0.01
65	000977	浪潮信息	900	27,090.00	0.00
66	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
67	002967	广电计量	600	19,038.00	0.00
68	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
69	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002351	漫步者	59,880,654.59	6.27
2	300136	信维通信	57,605,139.73	6.03
3	603613	国联股份	52,500,726.17	5.49
4	000063	中兴通讯	51,352,720.06	5.37
5	300003	乐普医疗	51,277,186.74	5.37
6	603259	药明康德	49,904,554.76	5.22
7	603516	淳中科技	49,217,221.46	5.15
8	002044	美年健康	47,834,174.85	5.00
9	600570	恒生电子	47,334,276.87	4.95
10	600276	恒瑞医药	46,629,679.58	4.88
11	603986	兆易创新	46,222,547.60	4.84
12	300674	宇信科技	42,357,333.24	4.43
13	002353	杰瑞股份	42,041,177.46	4.40
14	000333	美的集团	41,089,448.96	4.30
15	603039	泛微网络	39,769,177.26	4.16
16	002938	鹏鼎控股	35,838,781.31	3.75
17	002475	立讯精密	35,391,802.83	3.70
18	300684	中石科技	35,154,936.76	3.68
19	600536	中国软件	34,180,856.00	3.58
20	603658	安图生物	34,125,226.40	3.57
21	00700	腾讯控股	34,103,079.09	3.57
22	600183	生益科技	33,882,181.72	3.55
23	00268	金蝶国际	33,583,076.40	3.51
24	603236	移远通信	33,163,423.04	3.47
25	002415	海康威视	32,488,382.18	3.40
26	603160	汇顶科技	30,789,010.00	3.22
27	00285	比亚迪电子	29,695,281.54	3.11
28	300073	当升科技	29,332,027.00	3.07
29	000938	紫光股份	28,613,303.56	2.99
30	603501	韦尔股份	28,139,108.00	2.94
31	02020	安踏体育	27,440,775.98	2.87
32	300579	数字认证	26,853,376.00	2.81
33	600588	用友网络	26,695,821.39	2.79
34	300413	芒果超媒	26,379,366.54	2.76
35	600519	贵州茅台	26,088,996.34	2.73
36	300285	国瓷材料	25,685,986.25	2.69
37	00788	中国铁塔	24,383,316.07	2.55
38	002876	三利谱	24,343,197.20	2.55
39	002602	世纪华通	24,256,666.73	2.54
40	300207	欣旺达	24,153,609.00	2.53
41	688023	安恒信息	23,420,454.48	2.45
42	601166	兴业银行	22,917,357.37	2.40
43	02269	药明生物	22,809,880.03	2.39
44	300383	光环新网	22,682,132.72	2.37
45	300773	拉卡拉	21,916,654.25	2.29
46	603489	八方股份	21,680,256.44	2.27
47	000786	北新建材	21,470,232.00	2.25
48	01951	锦欣生殖	21,379,583.79	2.24
49	600835	上海机电	20,371,141.00	2.13
50	300369	绿盟科技	20,344,418.80	2.13
51	01177	中国生物制药	19,956,337.42	2.09
52	603233	大参林	19,483,224.89	2.04

注:本项"买入金额"按买入成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002351	漫步者	73,249,043.88	7.66
2	600276	恒瑞医药	61,857,329.88	6.47
3	603986	兆易创新	50,121,263.93	5.24
4	600183	生益科技	41,744,734.60	4.37
5	000333	美的集团	41,555,482.76	4.35
6	002475	立讯精密	41,091,966.76	4.30
7	603236	移远通信	37,660,313.16	3.94
8	00268	金蝶国际	37,211,897.39	3.89
9	603039	泛微网络	36,281,656.61	3.80
10	000938	紫光股份	33,991,120.20	3.56
11	300674	宇信科技	33,618,205.00	3.52
12	603613	国联股份	32,711,732.79	3.42
13	603259	药明康德	32,624,224.22	3.41
14	603501	韦尔股份	32,602,222.65	3.41
15	600536	中国软件	31,705,404.00	3.32
16	600519	贵州茅台	30,801,014.44	3.22
17	603160	汇顶科技	30,592,218.26	3.20
18	02020	安踏体育	30,401,779.69	3.18
19	000063	中兴通讯	29,502,868.00	3.09
20	300579	数字认证	29,068,534.64	3.04
21	600588	用友网络	24,859,764.30	2.60
22	01177	中国生物制药	24,823,734.57	2.60
23	300383	光环新网	24,307,778.86	2.54
24	002876	三利谱	23,438,052.00	2.45
25	601166	兴业银行	22,980,093.00	2.40
26	02269	药明生物	22,842,172.93	2.39
27	600835	上海机电	22,326,081.96	2.34
28	002415	海康威视	22,166,209.83	2.32
29	000786	北新建材	22,130,001.80	2.32
30	300413	芒果超媒	21,234,829.45	2.22

注:本项"卖出金额"按卖出成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,406,691,334.37
卖出股票收入(成交)总额	1,726,709,150.84

注:本项"买入股票成本"和"卖出股票收入"均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	963,577.80	0.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	963,577.80	0.10

1.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019611	19国债01	9,630	963,577.80	0.10

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.9 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	404,173.32
2	应收证券清算款	10,282,734.50
3	应收股利	-
4	应收利息	33,962.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,720,870.23

1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

本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。

A类基金份额:

(一)本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	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)
2019年5月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日	23.48%	0.90%	9.00%	0.83%	14.48%	0.07%

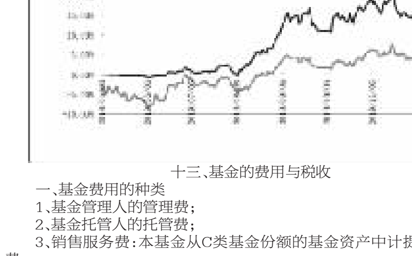
(二)自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图

C类基金份额:

(一)本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	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)
2019年5月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日	22.78%	0.90%	9.00%	0.83%	13.78%	0.07%

(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图



十三、基金的费用与税收

一、基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费:本基金从C类基金份额的基金资产中计提的销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券/期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的开户费用、账户维护费用;
10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用,包括证券组合费、交易征费、股份交收费、交易系统使用费、交易费等;
11、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.80%。

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.80%年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.80%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

上述"一、基金费用的种类"中第4-11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、对招募说明书更新部分的说明

(一)根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订,更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。
(二)针对"基金管理人"章节:更新了基金管理人的相关信息。
(三)针对"基金托管人"章节:更新了基金托管人的相关信息。
(四)针对"基金的投资"章节:更新了基金的投资组合报告。
(五)针对"基金的业绩"章节:更新了基金的业绩。
(六)针对"其他应披露事项"章节:更新了本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司
2020年4月14日