

A96 信息披露 | Disclosure

（上接A95版）

客服电话:95662
网址:www.xyqzq.com.cn
19、中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:宋明
电话:010-66664540
传真:010-66668990
客服电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn
20、中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:010-85130688
传真:010-65182261
客服电话:400-8888-108
网址:www.csc108.com
21、中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人:姜晓林
联系人:刘晓明
电话:0631- 89606165
传真:0632- 85022605
客服电话:95648
网址:www.zxwt.com.cn
22、中信证券股份有限公司
住所: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
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
联系人:郑慧
电话:010-6083 8888
传真:010-6083 6029
客服电话:95648
网址:www.cs.citic.com
23、中国期货交易所
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
联系人:刘宏莹
电话:010-60833754
传真:0755-83201097
客服电话:400-990-8826
网址:www.citicfc.com
24、平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层(518048)
法定代表人:刘世安
联系人:周一涵
电话:021-38637436
传真:021-58991896
客服电话:956511-8
网址:stock.pingan.com
25、国金证券股份有限公司
住所:四川省成都市东城根上街95号
办公地址:四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧婧
电话:028-86690057
传真:028-86690126
客服电话:95310
网址:www.gjzq.com.cn
26、华龙证券股份有限公司
住所:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号19楼
联系人:范坤
电话:0931-4890208
传真:0931-4890628
客户服务电话:95368
网址:www.hlzq.com
27、华金证券股份有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层
联系人:郑姬
电话:021-20665746
客户服务电话:4008211357
网址:www.huajinsc.com
28、阳光人寿保险股份有限公司
住所:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝明门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人:李科
客户服务电话:95610
网址:fund.sinosig.com
29、上海量基基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:单丙辉
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客户服务电话:400 820 2899
网址:www.erichfund.com
30、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:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
传真:0671-26898533
客户服务电话:400 076 6123
网址:www.fund123.cn
31、深圳众禄基金销售股份有限公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-12698533
客户服务电话:400 076 6123
网址:www.fund123.cn
32、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
办公地址:上海市浦东新区浦东大道903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-20613999
传真:021-68698916
客户服务电话:400 700 9665
网址:www.ehowbuy.com
33、上海天天基金销售有限公司
住所: 浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号302座39楼
法定代表人:其实
联系人:彭远芳
电话:021-5450998-2010
传真:021-64385308
客户服务电话:400 1818 188
网址:www.1234567.com.cn
34、北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:宋丽冉
电话:010-62020088
传真:010-62020355
客户服务电话:400 888 6661
网址:www.mylfund.com
35、北京钱景基金销售有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:申泽源
电话:010-67418813
传真:010-57669671
客服电话:400 678 5095
网址:www.niuji.net
36、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市朝阳区宣武门外大街10号住胜广场中央办公楼东翼7层727室
法定代表人:杨鑫
联系人:张燕
电话:010-58325388-1588
传真:010-58325262
客服电话:400-166-1188
网址:8.jrj.com.cn
37、浙江同花顺基金销售有限公司
住所:杭州市文二西路1号903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:刘晓峰
联系电话:0571-88911818
传真:0571-88910240
客服电话:4008-773-772
网址:www.5ifund.com
38、上海利得基金销售有限公司
住所:上海宝山区蕴川路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:李兴春

联系人:赵沛然
电话:021-50683533
传真:021-50683633
客服电话:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn
39、北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市北京经济技术开发区安达北路10号5层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁煜
联系人:马鹏程
联系电话:13501068175
传真:010-56810623
客服:4008980618
网址:www.chtfund.com
40、上海陆金所基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
联系电话:021-20665952
传真:021-62206653
客服:4008219031
网址:www.lufunds.com
41、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222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
联系人:牛亚楠
联系电话:010-65951887
传真:010-65951887
客服:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
42、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区昆明路608号北美广场B座12楼
法定代表人:汪静波
联系人:李娟
联系电话:021-38509735
传真:021-38509777
客服:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
43、上海凯石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
联系人:葛佳蕊
联系电话:021-63333389
传真:021-63332523
客服:4000179000
网址:www.lingxianfund.com
44、珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:北京市海淀区西坝河大街1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:李孟军
联系电话:020-89629012
传真:020-89629011
45、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
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁瑛明
联系人:朱海娟
联系电话:021-20324158
传真:021-20324199
客服电话:400-828-2266
网址:www.dtfunds.com
46、海根基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
联系电话:021-80133597
传真:021-80133413
客服电话:400-808-1016
网址:www.fundhaiyin.com
47、上海联泰资产管理有限公司
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:燕斌
联系人:陈东
联系电话:021-52622063
传真:021-52975270
客服电话:4000-466-788
网址:www.66zichan.com
48、乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
住所:北京市海淀区长安门内大街11号楼7层7117室
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人:王兴吉
联系人:高晋超
联系电话:010-62062880
传真:010-82057741
客服:400-088-8080
网址:www.qiandaojr.com
49、北京肯特瑞财富投资管理有限公司
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十八号院京东集团总部
法定代表人:江卉
联系人:万蓉
电话:18910325400
传真:010-89189289
客户服务电话:个人业务:95118 , 400 098 8511 企业业务:400 088 8816
网址:fund.jd.com
50、上海煜煜基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
联系人:李鑫
电话:021-66370077
传真:021-65085991
客户服务电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn
51、东方财富(北京)信息科技股份有限公司
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:吴雪秀
联系人:徐越
电话:010-88312877
传真:010-88312099
客服电话:400-001-1566
网址:www.yiliuifu.com
52、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8层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋明
电话:010-88066632
传真:010-63136184
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
53、嘉实财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10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
联系人:余永健
电话:010-86090750
传真:010-86090738
客户服务电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
54、上海中正达广基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
联系人:戴瑛薇
电话:021-33768132
传真:021-33768132*902
客户服务电话:400-6767-523
网址:www.zsdwealth.cn
55、武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市汉阳区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋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栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:孔繁
电话:027-87006003*8020
传真:027-87006010
客户服务电话:400-027-9899
网址:www.buyfunds.com
56、济安财险(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环中路4号楼404室4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
联系人:李海燕
电话:010-65309516
传真:010-65306969
客服电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
57、金惠家保险代理有限公司
住所:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
办公地址:北京市朝阳区门外大街18号丰联广场A座1009
联系人:胡明哲
电话:15810201340
传真:028-62825388
客服电话:400-8867333
网址:www.jhhome.com

58、天津市凤凰财富基金销售有限公司
住所:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
办公地址:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
联系人:孟媛媛
电话:18920017760
传真:022-23297967
客户服务电话:400-706-6890
网址:www.ftcfj.com
59、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
联系人:徐江
电话:18940800358
客服电话:400-0411-001
网址:www.haojiyoujin.com
60、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1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
联系人:衡欢
电话:18576351064
客服电话:400-159-9288
网址:danjuanapp.com
61、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:胡洪军
联系人:黄鹏
电话:18521505916
客服电话:400-876-5716
网址: www.cmiwm.com
62、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:南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道1号
法定代表人:王峰
联系人:马庆达
电话:17626038752
客服电话:025-66969699
网址:www.snjjjin.com
63、奕丰金融服务(深圳)有限公司
住所:深圳市福田区深湾合作项目前海一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:T'EO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客户服务电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(三)份额登记机构
名称:东方基金集团有限责任公司
住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人:崔伟
联系人:李进康
电话:010-66295874
传真:010-66576880
网址:www.orient-fund.com或www.dfs888.com
(四)律师事务所和经办律师
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
联系人:刘焕志
电话:010-52682888
传真:010-52682999
经办律师:刘焕志、孙艳利
(五)会计师事务所和经办注册会计师
名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市南京东路61号4楼
办公地址:北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层
法定代表人:朱建弟
联系人:朱钢梅
电话:010-68296868
传真:010-88210608
经办注册会计师:朱钢梅、高慧丽
五、基金名称和基金类型
(一)本基金名称:东方人工智能主题混合型证券投资基金
(二)本基金类型:混合型证券投资基金
(三)基金运作方式:契约型、开放式
六、基金的投资目标和投资方向
(一)投资目标
在严格控制风险的前提下,通过深入研究人工智能主题相关行业,挖掘具备成长潜力的上市公司,结合积极主动的资产配置,力争获得基金的长期稳定增值。

(二)投资范围
本基金的投资范围为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(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、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等)、可转换债券、可交换债券、分离交易的可转换债券)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货、国债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:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,投资于人工智能主题证券投资基金资产占非现金基金资产的比例不低于80%;投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易所保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人根据法律从法规的规定或在履行适当程序后对上述资产配置比例进行适当调整。

七、基金的投资策略

(一)类别资产配置策略

本基金根据各类资产的市场趋势和收益风险水平进行分析,对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整,采用多因素分析框架,综合考虑宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等进行基金的大类资产配置。

(二)股票投资策略

本基金灵活运用多种投资策略,多维度分析股票的投资价值,围绕人工智能主题,充分挖掘市场中潜在的投资机会,实现基金的投资目标。
1、人工智能主题界定:
本基金定义的“人工智能”是指以大数据为基础,借助智能化芯片,采用深度学习等算法,模拟人的某些思维过程和智能行为,并能够在此基础上对人类智能进行延伸与扩展。具体的人工智能相关行业包括但不限于大数据、云计算、云存储、机器学习、机器视觉、人脸识别、语音语义识别、智能芯片等细分领域。在当前科技创新引领实体经济转型升级的潮流中,人工智能已成为国际竞争的新焦点、经济发展的新引擎,随着《新一代人工智能发展规划》的发布,人工智能正式上升为国家战略。

根据我国部署人工智能的战略目标和总体规划,本基金投资的人工智能相关行业:(1)人工智能基础行业:我国发展人工智能具有良好基础,数据与硬件是构建人工智能体系的基础,数据部分主要包括大数据、云计算、互联网、通信、数据平台等领域,硬件部分主要包括传感器、芯片、存储、硬件模组等领域。

(2)人工智能核心行业:算法与技术是发展人工智能的关键,这两者的结合对人工智能的进步起到决定性的作用,相关领域包括核心算法、核心算力、计算智能、感知智能、认知智能等。

(3)人工智能应用行业:人工智能发展到目前,已与国防、经济、社会生活深度融合,并在相关领域率先落地,这些与人工智能紧密结合的领域有助于进一步提升公共安全保障能力、提高相关产业风险防范与管控能力、为社会生活提供更加便捷高效的智能服务。与人工智能应用相关的行业包括AI+安防、AI+金融、AI+汽车、AI+互联网、AI+教育、AI+医疗、AI+养老等。

2、个股投资策略
本基金管理人结合案头分析与上市公司实地调研,对列入研究范畴的股票进行全面系统性地分析和评价,建立本基金的备选股票库。主要通过成长性、盈利能力、估值水平、发展潜力等方面考察股票的投资可行性。

(1)成长能力较强:本基金认为,企业以往的成长性能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力,因此,本基金利用主营业务收入增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率指标来考量公司的历史成长性,作为判断公司未来成长性的依据。

主营业务收入增长率是考察公司成长性最理想的指标,主营业务收入的增长所隐含的往往是企业市场份额的扩大,体现公司未来盈利潜力的提高,盈利稳定性的加大,公司未来持续成长能力的提升。本基金主要考察上市公司最新报告期的主营业务收入与上年同期的比较,并与同行业公司比较。

净利润是一个企业经营的最终成果,是衡量企业经营效益的主要指标,净利润的增长反映的是公司的盈利能力和盈利增长情况。本基金主要考察上市公司最新报告期的净利润与上年同期的比较,并与同行业公司比较。

经营性现金流量反映的是公司的营运能力,体现了公司的偿债能力和抗风险能力。本基金主要考察上市公司最新报告期的经营性现金流量与上年同期的比较,并与同行业相比较。

(2)盈利质量较高:本基金利用总资产报酬率、净资产收益率、盈利现金比率(经营现金净流量/净利润)指标来考量公司的盈利能力和质量。

总资产报酬率是反映企业资产综合利用效果的核心指标,也是衡量企业总资产盈利能力的重要指标;净资产收益率反映企业利用股东资本盈利的效率,净资产收益率较高且保持增长的公司,能为股东带来较高回报。本基金考察上市公司过去两年的总资产报酬率和净资产收益率,并与同行业平均水平进行比较。

盈利现金比率,即经营现金净流量与净利润的比值,反映公司本期经营活动产生的现金净流量与净利润之间的比率关系。该比率越大,一般说明公司盈利质量就越高。本基金考察上市公司过去两年的盈利现金比率,并与同行业平均水平进行比较。

此外,本基金还将关注上市公司盈利的构成、盈利的主要来源等,全面分析其盈利能力和质量。

(3)未来增长潜力强:公司未来盈利增长的预期决定股票价格的变化。因此,在关注上市公司历史成长性的同时,本基金尤其关注其未来盈利增长潜力。本基金将对上市公司未来一至三年的主营业务收入增长率、净利润增长率进行预测,并对其可能性进行判断。

(4)估值水平合理:本基金将根据上市公司所处的行业、采用市盈率、市净率等估值指标,对上市公司股票价值进行动态评估,分析该公司的股价是否处于合理的估值区间,以规避股票价值被过分高估所隐含的投资风险。

三、类资产配置策略

根据资产的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素,本基金将市场主要细分为一般债券(含国债、央行票据、政策性金融债等)、信用债券(含地方政府债券、公司债券、企业债券、非政策性金融债、短期融资券、超短期融资券、次级债券、资产支持证券等)、附权债券(含可交换债券、可转换债券、分离交易的可转换债券、含回售及赎回选择权的债券等)三个子市场。在大类资产配置的基础上,本基金将通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析,在目标久期控制及期限结构配置基础上,采取积极投资策略,确定类属资产的最优配置比例。

2、久期调整策略

本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因子的分析判断,形成对

未来市场利率变动方向的预期,进而主动调整所持有的债券资产组合的久期,以达到增加

收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时,本基金将延长所持有的债券组合的久期,从而可以在市场利率下降时获得债券价格上升所产生的资本利得;反之,当预期市场总体利率水平上升时,则缩短组合久期,以避免债券价格下降带来的资本损失,获得较高的再投资收益。

3、期限结构策略

在目标久期确定的基础上,本基金将通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期,调整组合的期限结构策略,适当的采取子弹策略、哑铃策略、梯式策略等,在短期、中期、长期债券间进行配置,以从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。当预期收益率曲线变陡时,采取子弹策略;当预期收益率曲线变平时,采取哑铃策略;当预期收益率曲线不变或平行移动时,采取梯形策略。

(四)权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型,深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化,寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,谨慎投资,追求较稳定的当期收益。

(五)资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(六)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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。

(七)国债期货投资策略

本基金对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为目的。结合国债市场交易情况和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值操作,获取超额收益。

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证人工智能主题指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%

本基金主要围绕“人工智能”主题进行投资,投资于“人工智能”主题的证券资产占非现金基金资产的占比不低于90%;考虑到本基金的投资范围以及投资比例,将中证人工智能主题指数收益率乘以80%的权重;银行活期存款利率(税后)反映出本基金投资现类资产以达到获得持续稳定收益的目的,故将银行活期存款利率(税后)配以20%的权重。

若未来法律法规发生变化,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,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致,并按照监管部门要求履行适当程序后,适当调整业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高等风险水平的投资品种。

十、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。

基金托管人根据本基金合同规定,已复核了本投资组合报告中的财务指标、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止至2019年3月31日(财务数据未经审计)。

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	107,211,366.17	74.95
	其中:股票	107,211,366.17	74.95
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:买入返售金融资产-买断金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,487,424.43	24.95
8	其他资产	226,360.09	0.16
9	合计	143,105,150.69	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	1,698,812.28	1.40
B	采矿业	505,714.00	0.47
C	制造业	83,777,521.11	44.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,738,626.36	3.07
E	建筑业	1,715,166.48	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	3,456,511.96	2.89
H	住宿和餐饮业	11,128,063.69	9.16
J	金融业	22,105,761.00	18.26
K	房地产业	5,101,627.28	4.26
L	租赁和商务服务业	736,494.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	520,729.60	0.43
O	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,460,104.64	2.03
S	综合	-	-
	合计	107,211,366.17	89.10

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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	000430	招商局	39,459	4,396,051.32	4.11
2	000033	美的集团	89,300	4,361,589.00	3.99
3	002049	紫光国微	84,300	3,796,028.00	3.52
4	600000	中国平安	152,500	3,778,856.00	3.51
5	600000	招商银行	210,700	3,691,464.00	3.44
6	601788	光大证券	280,300	3,688,748.00	3.43
7	000001	平安银行	263,000	3,638,316.00	3.40
8	601010	光大银行	886,400	3,634,240.00	3.39
9	601318	中国平安	47,000	3,623,700.00	3.38
10	000853	顺络电子	312,497	3,434,638.25	3.25

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。

#####