

信息披露 Disclosure

招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

(二零一五年第二号)

招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2013年11月4日《关于同意招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1400)号准公开发行。本基金的基金合同于2014年6月20日正式生效。本基金为契约型开放式。

重要提示
投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。
本招募说明书所载内容并不预示其未来表现。
本招募说明书摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额后,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额期间其行为本身即表明其自愿接受并承认基金合同、并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人了解基金份额持有人的权利和义务,应仔细阅读基金合同。
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。
本更新招募说明书所载内容截止日为2015年9月20日,有关财务和业绩表现数据截止日同为2015年6月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

一、基金管理人
(一)基金管理人概况
名称:招商基金管理有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立日期:2002年12月27日
法定代表人:肖光华
办公地址:深圳深南大道7088号招商银行大厦28楼
电话:(0755) 83195666
传真:(0755) 832078374
联系人:魏思斯
注册资本:人民币2亿元
股权结构情况如下:
招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会证监基金字[2002]100号文批准设立,是中国第一家中外合资基金管理公司,由中国招商证券股份有限公司、ING Asset Management B.V.(荷兰资管)、中国平安人寿保险股份有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司共同出资组建,经中国证监会及并经中国证监会批准,公司的注册资本已经由人民币一亿元(RMB1,000,000.00元)增加为人民币二亿元(人民币RMB210,000,000元)。
2007年6月,经公司董事会并经中国证监会批复同意,招商银行股份有限公司受让中国平安人寿保险股份有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司及招商证券股份有限公司分别持有的公司10%、10%、10%及3.4%的股权(以下简称“股权转让”),上述股权转让完成后,招商基金管理有限公司的股东及股权结构为:招商银行股份有限公司持有公司全部股权的33.4%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的33.3%,

2013年8月,经公司董事会审议通过,并经中国证监会证监许可[2013]1074号文批复同意,荷兰资管(ING Asset Management B.V.)将其持有的招商基金管理有限公司1.6%股权转让给招商银行股份有限公司,1.1%股权转让给招商证券股份有限公司,上述股权转让完成后,招商基金管理有限公司的股东及股权结构为:招商银行股份有限公司持有全部股权的95%,招商证券股份有限公司持有全部股权的4.5%。
公司主要股东招商银行股份有限公司成立于1987年4月8日,总行设在深圳,业务以国内市场为主,招商银行于2002年4月9日在上海证券交易所上市(股票代码:600036)。2006年9月22日,招商银行在香港联合交易所上市(股票代码:3968)。
招商证券股份有限公司是百年招商局金融企业,经过多年创新发展,已成为拥有证券业务牌照的上市券商。2009年11月,招商证券在上海证券交易所上市(代码:000999)。
公司本着“长期、稳健、优良、专业”的经营理念,力争成为客户推崇、股东满意、员工热爱,并具有国际竞争力的专业化资产管理公司。

(二)主要人员情况
1.基金管理人董事、监事及其他高级管理人员介绍:
李卫,工商管理硕士,高级会计师。1997年6月加入招商银行股份有限公司,曾任行长助理、上海分行行长、副行长,现任执行董事、党委副书记、常务副行长兼财务负责人。现任公司董事长。
邓力,美国纽约州立大学,获经济学博士学位。2001年加入招商证券,期间于2004年1月至2005年9月被中国证监会借调至南方证券接管中心工作,参与南方证券的清算;在加入招商银行前,曾在美国纽约花旗银行从事风险管理工作,现任招商证券股份有限公司副总裁,分管风险管理、公司财务、清算及培训工作,中国证券业协会财务与风险控制委员会副主任。现任公司副董事长。
金旭,女,北京大学硕士研究生。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年1月在北京信安基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年6月在摩根全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年6月至2014年12月任国泰基金管理有限公司总经理。2015年1月加入招商基金管理有限公司,现任公司副总经理、董事。

李健江,男,经济学博士,教授、博士生导师。历任吉林大學经济学院副院长、德国不莱梅大学客座教授、美国印第安纳大学经济系高级访问学者。现任吉林大學经济学院院长、金融学院院长、社会科学学部学术委员会主任、美国研究所所长、兼任中国世界经济学会副秘书长、中国经济学会副秘书长、吉林省经济学会专家教学指导委员会委员、中共吉林省委决策咨询委员会委员、吉林省政府决策咨询委员会委员等。现任公司独立董事。
王莉,女,高级经济师。毕业于中国人民解放军外国语学院,历任中国人民解放军昆明军区三部战士、助理研究员;国务院科技干部局二处干部;中信公司财务部国际金融市场主管,银行部资金处副处长;中信银行郑州分行办公室主任;资本市场部总经理。现任招商基金管理有限公司董事、监事会主席。
蔡建基,男,毕业于香港理工大学(现为香港理工大学)会计系。历任香港毕马威会计师事务所审计部经理、经理,毕马威会计师事务所上海办事处执行合伙人,毕马威华振会计师事务所上海首席合伙人,毕马威华振会计师事务所华东区首席合伙人。现为香港会计师公会资深会员、上海市静安区政协委员、上海市静安区IYBW华侨联合总会名誉主席。兼任中国石化上海石油化工股份有限公司等三家香港上市公司的非执行董事。现任公司独立董事。
孙继,男,新加坡籍,经济学博士。1980年至1991年先后就读于北京大学、复旦大学、William Paterson College and Arizona State University并获得学士、工商管理硕士和经济学博士学位。曾任新加坡南洋理工大学商学院助理教授,厦门大学管理学院与会计学院院长及特聘教授,上海交通大学高级访问金融专家,现任复旦大学管理学院特聘教授和财务金融系主任。兼任上海交通大学、中国金融交易所和上海期货交易所博士后工作站导师,科技部重点科研院所中小型科技企业创新融资平台项目负责人。现任公司独立董事。
张卫华,女,1981年07月——1988年08月,曾在江苏省连云港市汽车运输公司财务部部门任职;1983年11月——1988年08月,任中国旅行连云港分行外汇会计部主任;1988年08月——1994年11月,历任招商银行总行国际部、会计部主任、证券业务部总经理助理;1994年11月——2006年02月,历任招商银行、国通证券股份有限公司总助理兼稽核审计部总经理;2006年03月——2009年04月,任招商证券股份有限公司稽核监察部总监;2009年04月起任招商证券股份有限公司合规总监。现任公司监事会主席。

周松,男,武汉大学世界经济专业硕士研究生。1997年2月加入招商银行,1997年2月至2006年6月历任招商银行总行计划资金部副经理、总经理助理、副总经理,2006年6月至2007年7月任招商银行总行计划财务部副总经理,2007年7月至2009年7月任招商银行武汉分行副行长。2008年7月至2010年6月任招商银行总行计划财务部副总经理(主持工作)。2010年6月至2012年9月任招商银行总行计划财务部总经理。2012年9月至2014年6月任招商银行总行财务总监兼总行计划财务部总经理。2014年6月至2014年12月任招商银行总行财务总监兼总行资产负债管理部总经理。2014年12月起任招商银行总行同业金融部副董事长兼总行资产管理部总经理。现任公司监事。
罗敏,女,厦门大学经济学硕士。1996年加入招商证券股份有限公司历任投行部专员,先后担任项目经理、高级经理、业务主管;2002年起参与招商基金管理有限公司筹建,公司成立后先后担任基金业务高级经理、产品研发部高级经理、副总裁、总监,现任产品运营官兼市场推广部总监、公司监事。
肖月,女,中山大学国际工商管理硕士;2001年加入美的集团股份有限公司任Oracle ERP系统实施顾问;2006年5月至2006年12月在睿德咨询咨询有限公司咨询顾问;2006年12月至2011年2月于怡安翰威特咨询有限公司任咨询总监;2011年2月至2014年3月任倍智人才管理咨询有限公司首席运营官;任招商基金管理有限公司人力资源部总监、公司监事,兼任招商财富资产管理有限公司董事。
李杨,中央财经大学经济学硕士。2002年加入招商基金,历任基金核算部高级经理、副总监、总监,现任产品一部总监、公司监事。

钟文岳,男,厦门大学货币银行学硕士。1992年7月至1997年4月于中国农业银行总行投资公司任福建(集团)公司国际业务部经理;1997年4月至2000年1月于申银万国证券股份有限公司任江西营业部总经理;2000年1月至2001年1月任厦门海发投资有限公司总经理;2001年1月至2004年1月任深圳二十一世纪风险投资

资产公司副总经理;2004年1月至2008年11月任新江南投资有限公司副总经理;2008年11月至2015年6月任招商银行股份有限公司资产管理部副总经理;2015年6月加入招商基金管理有限公司,现任副总经理。

沙晓,男,中国国籍,中欧国际工商学院EMBA,曾任教于南京熊猫电子集团,任设计师;1998年3月加入原君安证券南京营业部交易部,任经理助理;1999年11月加入中国平安保险(集团)股份有限公司资金运营中心基金投资部,从事交易及证券研究工作;2000年11月加入宝盈基金管理有限公司基金投资部,任交易主管;2008年2月加入国泰基金管理有限公司量化投资事业部,任投资总监、部门总经理;2015年6月加入招商基金管理有限公司,现任公司副总经理。
欧志明,男,华中科技大学经济学及法学双学士,投资经济硕士;2002年加入广发证券深圳业务总部任证券投资部客户经理;2003年4月至2004年7月于广发证券总部任风险控制部从事风险管理经理工作;2004年7月加入招商基金管理有限公司,兼任法律合规部高级经理、副总监、总监、督察长,应中国证监会、董事会秘书,兼任招商财富资产管理有限公司董事。

潘禹西,男,硕士。1998年加入大鹏证券有限责任公司法律部,负责法务工作;2001年10月加入天同基金管理有限公司监察稽核科,任主管;2003年2月加入中国证券监督管理委员会深圳监管局,历任副主任科员、主任科员、副处长及处长;2015年6月加入招商基金管理有限公司,现任督察长。

二、本基金基金经理介绍
基金经理简历如下:
何文娟,男,中国国籍,管理学硕士。2007年7月加入招商基金管理有限公司,曾任交易部研究员,专户资产投资部研究员,助理投资经理、投资经理,先后从事股票和债券投资、债券及新股研究、投资组合的投资管理等工作,现任招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。(管理期限:2014年4月3日至至今)及丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。(管理期限:2014年6月12日至至今)。
本基金历任基金经理包括:自一凡先生,管理时间为2014年3月20日至2014年12月31日,梁先生,管理时间为2014年4月8日至2015年8月14日。

三、投资决策委员会成员
公司的投资决策委员会由如下成员组成:总经理金旭,总经理助理兼全球量化投资部负责人吴武祥,总经理助理兼投资管理二部负责人杨晓,总经理助理兼投资管理三部负责人王波宏,交易部总监刘勇。
4.上述人员之间均不存在亲属关系。
二、基金托管人
(一)基金情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾玖亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟玖佰玖拾玖元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[1998]24号
客服电话:信息揭露联系人:王永民
托管部电话:95566
传真:(010) 66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作经验,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、OFII、ROFII、ODI、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等7类齐全、产品丰富的托管业务体系。中国银行凭借丰富的经验,风险防范等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。
截至2015年6月30日,中国银行已托管382只证券投资基金,其中境内基金366只,ODI基金26只,涵盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构
(一)基金代销机构
1、直销机构:招商基金管理有限公司
招商基金客户服务中心电话:400-887-9555(免长途费)
招商基金网上交易平台
交易网站:www.cmfchina.com
客服电话:400-887-9555(免长途费)
网址:(0755) 83195018
传真:(0755) 83199059
联系人:李海
招商基金战略客户部
地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座2层西厨 207-219单
电话:(010) 66290540
联系人:刘超
招商基金机构理财部
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦22楼
电话:(0755) 83190452
联系人:刘刚
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号中国银大厦1601室
电话:(021) 68899166-116
联系人:秦向东
地址:北京市朝阳区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座2层西厨 207-219单
电话:(010) 83064741
联系人:张腾
招商基金直销交易服务电话
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23层招商银行基金市场服务部客户服务中心
电话:(0755) 83196360
备用传真:(0755) 83199266
联系人:贺军豪
2、代销机构:中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
电话:95566
传真:(010) 66594853
3、代销机构:招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建强
电话:(0755) 83198888
联系人:邓奕鹏
4、代销机构: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
法定代表人:姜建清
电话:(010)-66107914
联系人:杨希
5、代销机构:中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:刘士余
电话:95598
传真:(010) 85110929
6、代销机构:中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝内大街18号中信大厦C座
法定代表人:常振明
电话:95555
传真:(010) 65550827
联系人:康懿然
7、代销机构:交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路189号
法定代表人:牛锡明
电话:(021) 58781234
传真:(021) 58409483
联系人:张宏基
8、代销机构:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
电话:(021) 58870011
传真:(021) 68909016
联系人:刘宁
9、代销机构:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法人代表:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
联系人:刘宁
10、代销机构:上海浦东资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法人代表:郭坚
电话:(021)-20665652
传真:(021)-22066633
联系人:卢博宇
11、代销机构:杭州未来基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路2号
法人代表:陈广挺
电话:0571-28829790
联系人:李旻
12、代销机构:上海爱基金销售有限公司
注册地址:上海市静安区南京西路560号1206室
法人代表:汪静波
电话:400-821-5399
传真:(021) 38609777
联系人:方成
13、代销机构:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4楼E49室
法人代表:杨文斌
电话:(021) 58870011
传真:(021) 68909016
联系人:张凯
14、代销机构:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法人代表:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
联系人:刘宁
15、代销机构:上海浦东新区陆家嘴东路1333号14楼09单元
法人代表:郭坚
电话:(021)-20665652
传真:(021)-22066633
联系人:卢博宇
16、代销机构:上海聚源投资管理有限公司
注册地址:上海自由贸易区福泰路277号3层310室
成立时间:2002年12月27日
电话:(0755) 83196446
传真:(0755) 83196435
联系人:宋宇彬
17、代销机构:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021) 51150298
传真:(021) 51150398
经办律师:刘佳、张兰
联系人:刘佳
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法定代表人:董建伟
电话:(0755)-8246 9000
传真:(0755)-8246 9000
经办注册会计师:王国辉、黄小樱
联系人:蔡正軒
四、基金的名称:招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金
五、基金类型:契约型开放式
六、基金的投资目标:本基金通过执行与投资标的相匹配的资产配置策略来控制基金的风险程度,在精选个股、个股的基础上迅速集中投资,在控制风险的前提下力争在每个业绩考核周期为投资者带来持续收益。
七、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A股股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(含中小企业私募债)、资产支持证券、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。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
本基金投资于股票的比例为基金净值的3%-9%,投资于证券的比例为基金净值的0%-3%,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券、股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。
八、基金的业绩比较基准
本基金以获取绝对收益为投资目的。在投资策略上,本基金从两个层次进行,首先进行大类资产配置,采取与投资收益相挂钩的资产配置策略,从而有效控制基金净值的下行风险;其次在从定性和定量两个方面,通过深入的基本面研究分析,精选在业绩考核周期内具有获取绝对收益潜力的个股和个股,构建投资组合和债券组合。
(一)资产配置策略
本基金主要投资于国内依法发行上市A股股票、债券(含中小企业私募债)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货、基金及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
表1-2 资产配置比例表

资产类别	资产配置比例	资产配置范围
股票等权益类资产	0%	0%-9%
债券和货币市场工具等固定收益资产	5%	100%

12. 代销机构:中国银河证券股份有限公司
注册地址: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:陈共炎
电话:(010) 66566450
传真:(010) 66566890
联系人:宋明
13. 代销机构:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:范华华
电话:(021)-38676666
传真:(021)-38670666
联系人:胡敏
14. 代销机构:申万宏源证券股份有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
电话:(021)-33388824
联系人:曹静
15. 代销机构:财富证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心5楼
法定代表人:蔡兵一
电话:(0731) 4403139
传真:(0731) 4403439
联系人:郭娜
16. 代销机构:国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅政路13号
电话:(0755)83709360
传真:(0755)83704850
联系人:李孟宇
17. 代销机构:华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:杨秀义
电话:(010)-65566100
传真:(010)-65566153
联系人:李慧灵
18. 代销机构:华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:李工
电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
联系人:甘霖
19. 代销机构:中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科技中一路99号高新科技园大厦7层B、8层
法定代表人:黄扬斌
电话:(0755)-8257068
传真:(0755)-82940611
联系人:罗艺琳
20. 代销机构:广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江东路5号广州国际金融中心19、20层
法定代表人:邱二波
电话:(020)-88836999
传真:(020)-88836634
联系人:林洁茜
21. 代销机构:东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
电话:(021)-20333333
传真:(021)-50498861
联系人:王一菲
22. 代销机构:渤海证券股份有限公司
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:王春峰
招商基金直销交易服务电话
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23层招商银行基金市场服务部客户服务中心
电话:(0755) 83196360
备用传真:(0755) 83199266
联系人:贺军豪
22. 代销机构:中国中投证券有限公司
注册地址:北京市西城区福远路与福中街交界交处世纪财富中心A栋第18层-21层及第40层01-02,03,05,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23单元
法定代表人:龙梅芳
电话:(0755)-82023442
传真:(0755)-82026339
联系人:刘刚
24. 代销机构:海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
电话:(021)-58882213
传真:(010)-83211673
25. 代销机构:大同证券有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城国际21层
电话:(0351)-4130322
传真:(0351)-4130322
27. 代销机构:上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法人代表:其实
电话:400-1818-188
传真:(021)-64605308
联系人:潘世强
28. 代销机构:杭州未来基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路2号
法人代表:陈广挺
电话:0571-28829790
联系人:李旻
29. 代销机构:诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市金山区漕渡路金桥社区7650号206室
法人代表:汪静波
电话:400-821-5399
传真:(021) 38609777
联系人:方成
30. 代销机构:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4楼E49室
法人代表:杨文斌
电话:(021) 58870011
传真:(021) 68909016
联系人:张凯
31. 代销机构:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法人代表:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
联系人:刘宁
32. 代销机构:上海浦东新区陆家嘴东路1333号14楼09单元
法人代表:郭坚
电话:(021)-20665652
传真:(021)-22066633
联系人:卢博宇
33. 代销机构:上海聚源投资管理有限公司
注册地址:上海自由贸易区福泰路277号3层310室
成立时间:2002年12月27日
电话:(0755) 83196446
传真:(0755) 83196435
联系人:宋宇彬
34. 代销机构:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021) 51150298
传真:(021) 51150398
经办律师:刘佳、张兰
联系人:刘佳
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

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	601985	中国核电	9,631,000	126,877,200.21	1.17
2	300483	龙溪股份	233,326	12,477,304.08	0.19
3	300047	天源超声	343,265	11,965,040.00	0.11
4	300034	天孚通信	148,344	11,385,042.26	0.11
5	300046	九鼎泰丰	243,340	11,380,177.80	0.11
6	200443	金富时代	65,698	9,971,324.66	0.09
7	020217	东信和平	299,749	8,669,007.00	0.08
8	000719	大通银行	377,326	8,436,590.00	0.08
9	300436	光大宽频	47,297	7,006,620.00	0.07
10	601028	华轮科技	700,000	6,832,000.00	0.06

4. 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	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	502,956,000.00	4.69
其中:政策性金融债	502,956,000.00	4.69	
4	企业债券	52,329,000.00	0.49
5	企业中期票据	-	-
6	可转债	1,963,699.72	0.02
8	其他	-	-
9	合计	567,247,699.72	5.19

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权证投资明细

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	150211	15附营11	2,500,000	260,875,000.00	2.34
2	150206	15附营6	2,000,000	201,840,000.00	1.87
3	140230	14附营30	500,000	50,560,000.00	0.47
4	1403044	14金证固债	200,000	21,049,000.00	0.20
5	1403232	14申银固债	100,000	10,542,000.00	0.10

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
1) 报告期末本基金持有的股指期货合约和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
2) 本基金投资股指期货的资金占基金资产净值比例和投资政策
本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易,以管理市场风险和调

节股票仓位为主要目的。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1) 本期国债期货交易政策
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
2) 报告期末本基金持有的国债期货合约和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
3) 本期国债期货交易投资情况
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
11. 投资组合报告附注
1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
2) 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名单。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须事先入库再买入。
3) 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	289,885.40	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	10,004,222.10	
5	应收申购款	496,493.46	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	10,789,671.04	

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300043	龙溪股份	20,477,304.08	0.19	自限售锁定期
2	300047	天源超声	12,315,049.40	0.11	非限售锁定期
3	300094	大智慧	11,965,040.00	0.11	自限售锁定期
4	300046	九鼎泰丰	11,389,178.00	0.11	自限售锁定期
5	300443	金富时代	9,971,324.66	0.09	自限售锁定期
6	200436	东信和平	6,669,007.00	0.07	自限售锁定期
7	020209	东信和平	6,026,000.00	0.06	非公开发行

十一、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。本基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准标准差	1-3	2-4
2014/03/20至2014/12/31	7.00%	0.20%	4.69%	0.02%	2.31%	0.18%
2015/01/01至2015/06/30	8.60%	0.11%	2.73%	0.02%	5.80%	0.09%
基金成立以来至2015/06/30	16.03%	0.18%	7.42%	0.02%	8.68%	0.16%

注:本基金合同生效日为2014年3月20日
十二、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. (基金合同)生效后与基金相关的信息披露费用;
4. (基金合同)生效后与基金相关的会计审计费、律师费、仲裁费和诉讼费;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金的证券交易费用;
7. 基金的银行汇划费用;
8. 证券账户开户费用;
9. 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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.5%÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后,由基金托管人复核后于次月首日起2-5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、公休假等,支付日期顺延。
2. 基金托管人的托管费
本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后,由基金托管人复核后于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。上述“一、基金费用”中除第3-9项费用,根据有关法律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。

下列不计入基金费用的项目
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)费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调低基金管理费率、基金托管费率等费率,需召开基金份额持有人大会审议;调高基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额