融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016年第1号)

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
日　　期:二〇一六年六月

重要提示

本基金经中国证监会2014年7月1日证监许可【2014】642号文准予注册募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。中国证监会对本基金募集的准予注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、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,由于基金投资人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。

投资有风险,投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。投资者购买本基金份额的行为视为同意基金合同的约定。

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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2016年6月25日,有关财务数据截止日为2016年6月30日,本招募说明书中的财务数据未经审计。

一、基金合同生效日

2014年12月25日

二、基金管理人

(一)、基金管理人概况

名称:融通基金管理有限公司
注册地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
设立日期:2001年5月22日
法定代表人:高峰
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
电话:(0755)26947517
联系人:赖亮亮

目前公司股东及出资比例为:新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司(Nikko Asset Management Co.,Ltd.)40%。

(二)、主要人员情况

1、现任董事情况

董事长高峰先生,金融学博士,现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事,平安证券投行部副总经理,北京远略投资咨询有限公司总经理,深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月起至今,任公司董事长。

独立董事杜婕女士,经济学博士,民进会员,注册会计师,现任吉林大学经济学院教授。历任电力部第一工程局一处主管会计,吉林大学教师、讲师、教授。2011年1月至今,任公司独立董事。

独立董事田利辉先生,金融学博士后、执业律师,现任南开大学金融发展研究院教授。历任密歇根大学戴维德森研究所博士后研究员、北京大学光华管理学院副教授、南开大学金融发展研究院教授。2011年1月至今,任公司独立董事。

独立董事施天涛先生,法学博士,现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012年1月至今,任公司独立董事。

董事马金声先生,高级经济师,现任新时代证券股份有限公司名誉董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、主任,金银管理司司长,中国农业发展银行副行长,国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长,华林证券有限责任公司党委书记。2007年1月至今,任公司董事。

董事黄庆华先生,工科学士,现任上海宜利实业有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。历任上海宜利实业有限公司投资管理部经理助理、新时代证券股份有限公司经纪事业部综合管理处主管。2015年2月至今,任公司董事。

董事David Semaya(薛迈雅)先生,教育学硕士,现任日兴资产管理有限公司执行董事长,三井住友信托银行有限公司顾问。历任日本美林副总,纽约美林总监,美林投资管理有限公司首席运营官、代表董事和副总、代表董事和主席,巴克莱全球投资者日本信托银行有限公司总裁及首席执行官,巴克莱全球投资者(英国)首席执行官,巴克莱集团、财富管理(英国)董事及总经理。2015年6月至今,任公司董事。

董事Allen Yan(颜锡廉)先生,工商管理硕士,现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通国际资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司(美国波士顿)分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今,任公司董事。

董事孟朝霞女士,经济学硕士,现任融通基金管理有限公司总经理。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2015年2月至今,任公司董事。

2、现任监事情况

监事刘宇先生,金融学硕士、计算机科学硕士,现任公司监察稽核部总经理。历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015年8月起至今,任公司监事。

3、公司高级管理人员情况

董事长高峰先生,简历同上。

总经理孟朝霞女士,经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2014年9月至今,任公司总经理。

常务副总经理Allen Yan(颜锡廉)先生,工商管理硕士。历任富达投资公司(美国波士顿)分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2011年3月至今,任公司常务副总经理。

副总经理刘晓玲女士,金融学学士。历任博时基金管理有限公司零售业务部渠道总监,富国基金管理有限公司零售业务部负责人,泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监。2015年9月起至今,任公司副总经理。

督察长涂卫东先生,法学硕士。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司公务员,曾在中国证监会法律部和基金监管部工作,曾是中国证监会公职律师。2011年3月至今,任公司督察长。

4、基金经理

(1)现任基金经理情况

蒋秀蕾先生,中国药科大学药物化学硕士、中药药理学学士,9年证券投资从业经历,具有基金从业资格。历任朗生医药(深圳)有限公司产品经理、招商证券研发中心研究员、嘉联融丰投资有限公司投资经理。2009年2月加入融通基金管理有限公司,历任研究策划部行业研究员、行业组长,2012年9月6日起至今任"融通医疗保健行业混合型证券投资基金"基金经理,2014年12月25日起至今任"融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金"基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司公募基金投资决策委员会成员:投资总监商小虎先生,研究策划部总经理、基金经理邹曦先生,权益投资部总经理、基金经理刘格菘先生,基金交易部总经理谭奕舜先生,风险管理部总经理马洪元先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一)、基金托管人基本情况

1、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:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:洪渊

2、主要人员情况

截至2016年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工198人,平均年龄30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。

3、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、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2016年3月,中国工商银行共托管证券投资基金555只。自2003年以来,本行连续十一年获得香港《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49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。

四、相关服务机构

(一)、销售机构

1、直销机构情况

(1)融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务深圳小组
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
邮政编码:518053
联系人:张里程
电话:(0755)26948050
客户服务中心电话:400-883-8088(免长途通话费用)、(0755)26948088

(2)融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务北京小组
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241-1243单元
邮政编码:100140
联系人:魏艳薇
电话:(010)66190989

(3)融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务上海小组
办公地址:上海市世纪大道8号国金中心汇丰银行大楼6楼601-602
邮政编码:200120
联系人:高松
联系电话:(021)38424984

(4)融通基金管理有限公司网上直销
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
邮政编码:518053
联系人:殷洁
联系电话:(0755)26947856

2、代销机构:

(1)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
联系电话:010-6610-8608

(2)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
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:周慕冰
电话:(010)85109619
传真:(010)85108557
客服电话:95599

(3)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
客户服务电话:95533
网址:http://www.ccb.com

(4)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com

(5)中国邮储银行(仅代销前端)
注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法人代表:李国华
网址:www.psbc.com

(6)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路168号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:范一飞
联系人:汤征程
开放式基金咨询电话:021-962888
网址:www.bankofshanghai.com

(7)渤海银行股份有限公司
办公地址:天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:刘宝凤
联系人:王宏
电话:022-58316666
客服电话:4008888811
网址:www.cbhb.com.cn

(8)交通银行股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
客服电话:95559
联系人:曹榕
电话:(021)58781234
网址:http://www.bankcomm.com/

(9)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
联系人:林爽
联系电话:(010)66045608
客服电话:(010)66045678

(10)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人:陈洪生
联系人:李智磊
联系电话:0592-3122679
传真:0592-3122701
客服热线:0592-3122716
公司网站:www.xds.com.cn

(11)深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:(0755)33227950

(12)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区娥山路613号6幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人:其实
联系人:高莉莉、刘若云
电话:(021)54509988

(13)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
法定代表人:张跃伟
联系人:吕彗
电话:(021)58788678

(14)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
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-88911818-8001
客服电话:95525

(15)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
法定代表人:闫振杰
联系人:王婉秋
电话:010-62020088
客服电话:400-888-6661

(16)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19层
法定代表人:冯修敏
电话:021-33323999
传真:021-33323830
联系人:陈云卉
客服热线:400-820-2819
公司网站:www.fund.bundtrade.com

(17)深圳富济财富管理有限公司
办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
电话:0755-83999907
联系人:马力佳
公司网站:www.jinqianwo.cn

(18)上海陆金所资产管理有限公司(仅代销前端)
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
电话:021-20665952
客户服务电话:4008219031
公司网站:www.lufunds.com

(19)宁波银行股份有限公司
办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号24层
法定代表人:陆华裕
客户服务电话:95574
联系人:邱脜
电话:0574-87050397

(20)苏州银行股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市工业园区钟园路728号
办公地址:江苏省苏州市工业园区钟园路728号
法定代表人:王兰凤
传真:0512-69868370
联系人:葛晓亮
电话:0512-69868519
客服热线:96067
网址:www.suzhoubank.com。

(21)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人:杨懿
电话:010-83363101
传真:010-58325282
联系人:文雯
客服热线:400-166-1188
公司网站:http://8.jrj.com.cn/

(22)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人:汪静波
电话:021-38509735
传真:021-38509777
联系人:李娟
客服热线:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com

(23)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-20213600
传真:021-68596916
联系人:张茹
客服热线:400-700-9665
公司网站:www.ehowbuy.com

(24)上海利得基金销售有限公司
注册地址: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:沈继伟
电话:021-50583533
传真:021-50583633
联系人:曹怡晨
客服热线:400-067-6266
公司网站:http://a.leadfund.com.cn/

(25)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号1幢A2008室
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:段京璐
电话:010-88312877
传真:010-88312099
客户服务电话:400-001-1566
网址:www.yiliucaifu.com

(26)北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址: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
电话:010-57418813
传真:010-57569671
联系人:崔丁元
客服热线:4008936885
公司网站:www.qianjing.com

(27)珠海盈米财富管理有限公司(仅代销前端)
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
电话:020-89629099
传真:020-89629011
联系人:黄敏嫦
客服热线:020-89629066
公司网站:www.yingmi.cn

(28)奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路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路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
电话:0755-8946 0500
传真:0755-2167 4453
联系人:叶健
客服热线:400-684-0500
公司网站:www.ifastps.com.cn

(29)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:万建华
联系人:芮敏祺
传真:(021)38676161
客服电话:4008888666

(30)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:何如
联系人:李颖
电话:(0755)82130833
客服电话:95536

(31)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市江汉区新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:奚博宇
电话:(021)68751860
客服电话:95579或4008-888-999

(32)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2-6层
法定代表人:陈有安
联系人:邓颜
电话:(010)66568450
客服电话:4008-888-8888

(33)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
联系人:范超
电话:(0551)65161821
客服电话:96518,400-80-9651

(34)第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
联系人:吴军
电话:(010)23838750
客服电话:4008881888

(35)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:杨树财
联系人:安岩岩
电话:(0431)85096517
客服电话:4006000686

(36)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人:曾小普
联系人:俞驰
电话:(0791)86283080
客服电话:400822211

(37)新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法人代表:刘汝军
联络人:田芳芳
电话:(010)83561072
客服电话:400-698-9898

(38)太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
法定代表人:李长伟
联系人:谢兰
电话:(010)88321613
客服电话:4006-650-999

(39)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86690057
联系人:刘婧漪
客服电话:4006-600109

(40)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
电话:(010)63080994
联系人:鹿馨方
客户服务电话:400-800-8899

(41)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人:李梅
电话:(021)33389888
联系人:曹晔
客服热线:95523或4008895523

(42)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:许建平
联系人:李巍
电话:010-88085858
客户服务电话:400-800-0562

(43)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:丁学东
电话:010-85679888-6035
联系人:秦朗
客服电话:4009101166

(44)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943511
联系人:黄蝉君
客服热线:95565、400-8888-111

(45)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
联系人:许梦园
电话:(010)85130236
客服电话:400-8888-108

(46)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号3楼
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨
电话:(021)22169081
传真:(021)22169134
客服热线:400-8888-788,10108998,95525

(47)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
电话:021-20315255
联系人:马晓男
客服电话:95538

(48)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:余维佳
电话:023-63786141
联系人:张煜
客服电话:4008096096

(49)中信证券股份有限公司
注册地址: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:深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
法定代表人:王东明
传真:(010)84865560
联系人:侯艳红
电话:(010)60838995
客服热线:0755-23835888

(50)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法人代表:杨宝林
联系人:赵艳青
电话:(0532)85023924
客服电话:95548

(51)中信期货有限公司
注册地址: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:0755-82791065
联系人:吴川
客服热线:4009908826

(二)、登记机构

融通基金管理有限公司
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
设立日期:2001年5月22日
法定代表人:高峰
电话:0755-26948070
联系人:杜嘉

(三)、律师事务所

名称:广东嘉得信律师事务所
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201
办公地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201
法定代表人:闵齐双
联系人:崔卫群
经办律师:闵齐双 崔卫群
电话:075533382888(总机) 075533033096(直线) 13480989076
传真:075533033086

(四)、会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)
住所:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼(邮编:200021)
执行事务合伙人:李丹
联系人:俞伟敏
电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:陈玲、俞伟敏

五、基金的名称

融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

通过主要投资于健康产业的优质上市公司,同时通过合理的动态资产配置,在合理控制投资风险的基础上,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的长期收益。

八、基金的投资方向

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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等),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)。

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:股票投资占基金资产的比例为0%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于健康产业相关上市公司的证券资产的比例不低于非现金基金资产的80%。

九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,规避系统性风险。

在资产配置中,本基金主要考虑宏观经济指标,包括PMI水平、GDP增长率、M2增长率及趋势、PPI、CPI、利率水平与变化趋势、宏观经济政策等,来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向。

在经济周期各阶段,综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析,本基金对大类资产进行配置的策略为:在经济的复苏和繁荣期超配股票资产;在经济的衰退和政策刺激阶段,超配债券等固定收益类资产,力争通过资产配置获得部分超额收益。

2、股票投资策略

(1)健康产业的界定

主要包括传统医疗产业、健康管理与促进、健康保险以及相关服务,涉及药品、医疗器械、医疗服务、保健用品、保健食品、健身产品、养老地产、医疗信息化等多个与健康、养老紧密相关的生产和服务领域,包括:

1)以药品、医疗器械、医疗服务、医疗商业为主的传统医疗产业。

2)以健康理疗、康复调理、生殖护理、美容化妆为主体的健康产业。

3)以保健食品、功能性饮品、健康用品产销为主体的保健品产业。

4)以个性化健康检测评估、咨询顾问、体育休闲、中介服务、保障促进和养生文化机构等为主体的健康管理产业。

5)以医药健康产品终端化为核心驱动而崛起的中转流通、专业物流配送为主体的新型健康产业。

6)以医院信息管理系统、临床信息管理系统和公共卫生信息化为主体的医疗信息化产业。

7)以满足老年人养老及配套需求而设计、开发的养老地产及医院建设等相关的健康产业。

本基金所指的健康产业包括:(1)按照《申银万国行业划分标准》定义的申万医药生物一级行业,包括化学制药、中药、生物制品、医药商业、医疗器械和医疗服务6个二级子行业;(2)当前主营业务提供的产品或服务隶属于健康产业的公司;(3)当前非主营业务提供的产品或服务隶属于健康产业,且未来这些产品或服务有望成为主要收入或利润来源的公司。

如果申万研究调整或停止行业分类,或者基金管理人认为有更适当的健康产业划分标准,基金管理人有权对健康产业的界定方法进行变更并及时公告。

(2)从企业生命周期模型角度精选股票

企业发展通常遵循生命周期模型,在不同阶段会对应其股票的不同投资特征和属性。我们认为处于成长和成熟阶段的股票符合本基金的投资理念和目标,我们将采用企业生命周期模型来精选该类股票。

(3)上市公司基本面因素

主要包括但不限于:公司人力(战略管理、人才优势)、公司财力(财务能力、经营业绩)、公司物力(技术优势、产品优势、创新能力)、公司相对优势(相对于行业内其他公司的独特和领先之处)、公司销售与渠道能力。通过精选以上综合评价较高的公司进行投资。

(4)估值与风险

选取估值较低或合理的股票,估值因子包括:市盈增长比率(PEG)、市盈率(PE)、市净率(PB)、市销率(PS)、市现率(PCF)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT),通过绝对及相对估值模型,并结合对股票的走势和风险研究,确定股票的投资价值。

3、债券投资策略

在债券投资上,我们贯彻"自上而下"的策略,采用三级资产配置的流程。

(1)久期管理

根据对利率趋势的判断以及收益率曲线的变动趋势确定各类债券组合的组合久期策略。

(2)类属配置与组合优化

根据品种特点及市场特征,将市场划分为企业债、银行间国债、银行间金融债、可转换债券、央行票据、交易所国债六个子市场。在几个市场之间的相对风险、收益(等价税后收益)进行综合分析后确定各类别债券资产的配置。具体而言考虑市场的流动性和容量、市场的信用状况、各市场的风险收益水平、税收选择等因素。

(3)通过因素分析决定个券选择

从收益率曲线偏离度、绝对和相对价值分析、信用分析、公司研究等角度精选有投资价值的投资品种。本基金财产力求通过绝对和相对定价模型对市场上所有债券品种进行投资价值评估,从中选择暂时被市场低估或估值合理的投资品种。

本基金重点关注:期限相同或相近品种中,相对收益率水平较高的券种;到期期限、收益率水平相近的品种中,具有良好流动性的券种;同等到期期限和收益率水平的品种,优先选择高票息券种;预期流动性将得到较大改善的券种;公司成长性良好的可转债品种;转债条款优厚、防守性能较好的可转债品种。

4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为优化基金资产的风险收益特征,有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:申万医药生物行业指数收益率×70%+中债综合(全价)指数收益率×30%

选择该业绩比较基准的理由主要如下:

1、申万医药生物行业指数对健康产业股票具有较强的代表性,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

2、中债综合(全价)指数能够较好的反映债券市场变动的全貌,适合作为本基金债券投资的比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制这些指数或更改指数名称,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

如果今后法律法规发生变化,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,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

十一、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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于2016年7月26日复核了本报告中的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2016年6月30日。本报告中所列财务数据未经审计。

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	154,352,910.85	71.91
	其中:股票	154,352,910.85	71.91
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	59,763,415.48	27.84
8	其他资产	536,241.26	0.25
9	合计	214,652,567.59	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	117,870,643.96	55.66
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	36,482,266.89	17.23
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	154,352,910.85	72.89

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1)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	000638	万方发展	600,005	14,190,118.25	6.70
2	002675	东诚药业	250,000	11,632,500.00	5.49
3	300238	冠昊生物	250,000	10,970,000.00	5.18
4	603368	柳州医药	120,000	10,418,400.00	4.92
5	300109	新开源	149,910	9,519,285.00	4.50
6	300273	和佳股份	440,000	8,426,000.00	3.98
7	300289	利德曼	500,080	7,481,196.80	3.53
8	300233	金城医药	280,000	7,249,200.00	3.42
9	600056	中国医药	440,000	6,978,400.00	3.30
10	002653	海思科	400,059	6,408,945.18	3.03

(2)报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

(2)本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	462,835.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,741.72
5	应收申购款	70,664.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	536,241.26

(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

(i)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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000638	万方发展	14,190,118.25	6.70	重大事项停牌

(ii)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

十三、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。

自基金合同生效以来,本基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较如下:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2014年12月25日(基金合同生效日)起至2014年12月31日	0.70%	0.10%	-0.39%	0.86%	1.09%	-0.76%
2015年度	38.53%	2.85%	41.25%	1.87%	-2.72%	0.98%
2016年1月1日起至2016年6月30日	-18.78%	2.41%	-11.71%	1.63%	-7.07%	0.78%

十四、基金的费用概览

(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师费、律师费和诉讼费;
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、银行账户维护费用;