

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

（2016年第2号）

基金管理人：中金基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二〇一六年十二月

重要提示

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请于2015年1月28日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]144号《关于准予中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，并于2015年4月21日经中国证监会证券投资基金监管部部函[2015]1048号《关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2015年4月21日生效。

本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。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

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，投资人根据所持的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值。因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。本基金以市场中性价为主要投资策略，通过量化选股和同时构建多头与空头进行对冲的方式实现策略，因此除面临市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、技术风险、合规性风险等一般混合型基金风险外，还包括本基金特有的风险。首先，本基金的市场中性策略不能确保完全剥离股票市场的系统性风险；其次，本基金的主要投资工具股指期货还可能引发基差风险、杠杆风险、保证金不足风险、平仓风险、对手方风险等；若本基金在开放期发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延缓支付的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时获得赎回款项的风险。

投资有风险，投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本基金根据1/申购金额适用不同的1/申购费率，根据持有期限适用不同的赎回费率。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩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。

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。本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2016年10月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际中心17层
法定代表人：林寿康
成立时间：2014年2月10日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监许可〔2014〕97号
组织形式：有限责任公司
注册资本：2亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：张翌
联系电话：010-63211122
公司的股权结构如下：

| 股东名称 | 持股比例 |
|--------------|------|
| 中国国际金融股份有限公司 | 100% |

（二）主要人员情况

1.基金管理人董事会成员
林寿康先生，董事长，货币经济学博士。历任国际货币基金组织国际部经济学家；香港金融管理局货币管理高级经理；德意志银行兼管公司新兴市场部经济学家；中国信达资产管理公司国际部副主任。现任中国国际金融股份有限公司投资管理业务负责人、董事总经理。

刘魏女士，董事，金融学硕士。历任大连北方会计师事务所会计师；香港何福麟会计师事务所审计师；北京通成推广有限公司财务部经理；北京盛智尚有限公司财务咨询顾问；中国国际金融股份有限公司公司稽核部负责人。现任中国国际金融股份有限公司资金部负责人。

孙菁女士，董事，管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副总经理、公司管理部副总经理、运营支持部执行总经理及负责人等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。

张春先生，独立董事，经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大学卡尔森管理学院金融系终身教授；中欧国际工商学院金融和会计系首席教授、系主任、副教授长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长。

颜羽女士，独立董事，经济法学硕士、EMBA硕士研究生。历任云南政法干部管理学院教师；四通集团法务部法律咨询副主任；海南律师事务所律师；嘉和律师事务所合伙人。现任嘉源律师事务所创始合伙人。

张龙先生，独立董事，博士。历任内蒙能源控股有限公司总经理，现任中宝睿信投资有限公司董事长、中国建设银行独立董事。

2.基金管理人监事

夏静女士，执行监事，数学理学硕士。历任普华永道（深圳）咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制部服务经理；中国国际金融股份有限公司公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司风险管理部负责人。

3.基金管理人高级管理人员

林寿康先生，董事长，货币经济学博士。简历同上。
孙菁女士，总经理，管理学硕士。简历同上。
杜李卿女士，副总经理，经济学学士。历任中国国际金融股份有限公司运营支持部执行总经理、财务部负责人；北电网络（中国）有限公司财务管理部；摩托罗拉（中国）电子有限公司财务人员等职务。现任中金基金管理有限公司副总经理。

沈芸女士，督察长，法学硕士。历任中国建设银行（深圳分行）内部律师；深圳证券交易所高级经理；瑞银集团（香港）董事；中国国际金融股份有限公司合规管理部合规律师、副总经理。现任中金基金管理有限公司督察长。

4.本基金基金经理

李云祺先生，工学硕士。历任摩根士丹利信息技术（上海）有限公司固定收益部分析员、经理；中国国际金融股份有限公司证券投资策略部、高级经理。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。

5.投资决策委员会成员

郭尧钰先生，工商管理硕士。历任宁波梅海炼化投资经理；华泰证券项目经理；德恒证券高级经理；华策投资有限公司投资副经理；招商基金管理有限公司投资管理经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

石玉女士，管理学硕士。历任天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员；中国国际金融股份有限公司高级研究员、投资经理助理、投资经理。现任中金绝对收益策略型证券投资基金、中金现金管家货币市场基金基金经理。

李云祺先生，工学硕士。历任摩根士丹利信息技术（上海）有限公司固定收益部分析员、经理；中国国际金融股份有限公司证券投资策略部、高级经理。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：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
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿仟零玖拾柒万肆仟捌佰陆拾元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田青
联系电话：(010)6759 5096
中国建设银行成立于1964年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年末，本集团资产总额18.35万亿元，较上年增长9.59%；客户贷款和垫款总额10.49万亿元，增长10.67%；客户存款总额13.67万亿元，增长6.96%。净利润2,289亿元，增长0.28%；营业收入6,062亿元，增长6.09%，其中，利息净收入增长4.65%，手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%，加权平均净资产收益率17.27%，成本收入比26.98%，资本充足率15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合柜面数量达1.45万个，综合营销团队2.15万个，综合柜员占比达到

88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达96.58%，较上年提升7.55个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等多种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张，消费交易额222万亿元。多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万亿元以上的私人银行客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销3,316亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模7,177亿元，增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利、里昂清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及《香港企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、OFI托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管部上海办公中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观明，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务和个人银行业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供持续优质的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金个人账户、QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末，中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

（1）直销柜台
名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际中心17层
法定代表人：林寿康
电话：010-63211122
传真：010-66159121
联系人：张翌
客户服务电话：400-868-1166
网站：www.ciccifund.com
（2）网上直销
交易系统：中金基金网上直销系统
直销系统网址：https://trade.ciccifund.com/etrade
2.其他销售机构
（1）中国建设银行股份有限公司
住所：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
网站：www.ccb.com
联系人：王琳
（2）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市朝阳区门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：王学东
电话：010-65051166
传真：010-65058065
联系人：杨涵宇
网站：www.cicccom.cn
（3）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十

十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：周杨
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客服电话：95536
网站：www.guosen.com.cn
（4）中泰证券有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889185
客服电话：95538
网站：www.qizao.com.cn
（5）平安银行股份有限公司
客服电话：95511转3
网站：bank.pingan.com
（6）中国光大银行股份有限公司
客服电话：95595
网站：www.cebbank.com
（7）上海浦东发展银行股份有限公司
客服电话：4008219031
网站：www.lufunds.com
（8）华西证券股份有限公司
注册地址：成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址：成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人：杨炯洋
联系人：周志杰
电话：028-86135991
传真：028-86157275
公司网站：www.hx168.com.cn
客服电话：95584
（9）北京乐融多源投资咨询有限公司
北京乐融多源投资咨询有限公司(亦沐基金)
客服电话：400-068-1176
网站：www.bocm.com.cn
（10）交通银行
交通银行股份有限公司
地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客服电话：95559
网站：www.bankcomm.com
（11）中国银行
中国银行股份有限公司
地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客服电话：95566
网站：www.boc.cn
（12）平安证券
平安证券股份有限公司
地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：周-国
客服电话：95511转8
网站：stock.pingan.com

（13）恒天明泽

北京恒天明泽基金销售有限公司
地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层
法定代表人：李悦
客服电话：4007868868
网站：www.chtfund.com
（14）汇成基金
北京汇成基金销售有限公司
客服电话：400-619-9059
网站：www.fundzone.cn
（15）伯嘉基金
武汉市伯嘉基金销售有限公司
客服电话：400-027-9899
网站：www.buyfunds.cn
其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布变更或新增销售机构的公告。

（二）登记机构

名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际中心17层
法定代表人：林寿康
电话：010-63211122
传真：010-66155573
联系人：白娜
（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：吕红安冬
联系人：安冬
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层
办公地址：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层
执行事务合伙人：邹俊
电话：010-85085000
传真：010-85185111
签字注册会计师：程海良、李咏
联系人：程海良

四、基金的名称

中金基金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金。

五、基金的类型与运作方式

（一）基金的类型
混合型发起式证券投资基金。

（二）基金的运作方式
契约型，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式

六、基金的投资目标

本基金灵活运用多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值，以期实现超越业绩比较基准的绝对收益。

七、基金的投资方向

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具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。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票）、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金权益类资产头寸的价值占本基金权益类资产头寸的价值比例范围在90%—120%之间。其中：权益类资产头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类资产工具中的合约价值；权益类资产头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类资产工具中的合约价值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。开放期内，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，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。

本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

待本基金参与融资融券和转融通业务及投资其他品种（包括但不限于期权、收益互换等）的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务、转融通业务及投资其他品种，以提高投资效率及进行风险管理，届时本基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。

八、基金的投资策略

本基金采用市场中性价策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。其中，市场中性价策略包括量化选股策略和期货对冲策略两大策略。

（一）量化选股

本基金的最小化选股模型在注重基本面研究的同时，结合多种统计量化策略，主要包括多因子模型和统计套利模型。

（二）多因子模型

本基金的多因子选股策略秉承价值投资和技术投资相结合的理念，不但将可能影响股价并且具有经济意义的基本面指标纳入因子汇总，包括盈利能力、价值、成长性、规模等基本因素；同时也关注市场短期的波动指标，包括交易动、持仓量、成交量、期现价差、不同期限的动量趋势、强弱指标、超买超卖、反转策略等技术因子。通过对因子的量化分析和综合评价，精选最能体现该因子因子的个股构建多因子组合。

（三）统计套利模型

本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内各个个股之间的稳定性关系，估计其概率分布并确定该分布的极端区域。由于市场进入这些极端区域后价格不能长久维持，可以借助计算机快速捕捉市场进入这些极端区域的机会，挑选历史上大概率偏离市场的股票进行组合，试图以较高的成功概率进场套利。统计套利是将套利建立在历史数据进行分析统计的基础之上，估计相关变量的概率分布，并结合基本数据进行分析用以指导套利交易。相较于无风险套利，统计套利增加风险，但是可获得的套利机会将多于无风险套利。

（四）事件驱动模型

本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件以及对过往事件的数据跟踪，获取事件影响所导致的超额投资回报。事件驱动模型的事件”是指具有较为明确的时间和内容，能够对部分投资人的投资行为产生一定的影响，从而决定股价短期波动的因素。

（五）期货对冲策略

本基金的对期货对冲策略包含了对冲策略、期现套利策略和择时策略。

（六）对冲策略

（1）对冲策略
本基金将按照现货头寸和股票特性，使用量化方法剥离并测算整体的市场风险，进而动态调整期货对冲的数量，以达到对冲市场风险。

（七）期现套利策略

当期合约的基差变化达到一定要求时，本基金进行期现头寸的调整，赚取基差收益；当期货合约跨期基差合理时进行期货换仓，获得跨期套利收益。

（八）择时策略

通过对历史数据的研究，给出对市场涨跌判断的择时信号，根据信号的强弱增加或减少整体的仓位，或者增减用于对冲的股指期货合约的头寸。择时依据包括长期的宏观经济指标、市场资金面基本信息、中期的市场情绪和指数的形态，以及短期技术指标超买超卖判断下一步涨跌走势。

（九）其他对冲工具的运用

（1）其他对冲工具的运用
基金经理会密切关注市场的发展和最新对冲工具的出现，适时运用其他的对冲工具进行合理对冲。

（二）其他策略

（1）债券投资策略
在债券投资方面，本基金将深入研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系，采取利率策略、信用策略、相对价值策略以及正逆回购进行杠杆操作等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡带来的投资机会，实现组合增值。

（三）衍生品投资策略

在严格遵守证监会及相关法律法规规定和控制基金下行风险的前提下，本基金将合理利用股指期货、权证等衍生品工具，通过量化方法挖掘可能的套利机会。在严格控制风险的基础上，提高基金资产的投资收益。

基金管理人建立了股指期货投资决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策

流程和风险控制等制度并经董事会批准。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款收益率。
在每个封闭期首日至下一个开放期的最后一日，上述“一年期银行定期存款收益率”指当封闭期首日（若为首个封闭期，则为基金合同生效日）中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准利率。

如果相关法律法规发生变化，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，经基金管理人与基金托管人协商，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，无须召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值。因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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法律责任。
基金托管人根据本基金合同规定，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2016年9月30日，报告期间为2016年7月1日至2016年9月30日。本报告财务数据未经审计。

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 | 20,586,176.75 | 15.53 |
| | 其中：股票 | 20,586,176.75 | 15.53 |
| 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 | 107,509,637.24 | 81.07 |
| 8 | 其他资产 | 4,501,679.71 | 3.39 |
| 9 | 合计 | 132,607,493.70 | 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境内股票投资组合

| 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 | 72,589.50 | 0.06 |
| B | 采矿业 | 441,389.26 | 0.34 |
| C | 制造业 | 12,709,609.82 | 9.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 416,449.40 | 0.32 |
| E | 建筑业 | 568,336.08 | 0.43 |
| F | 批发和零售业 | 704,414.04 | 0.54 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 108,335.72 | 0.08 |
| H | 住宿和餐饮业 | 58,075.55 | 0.04 |
| I | 信息传输、软件和信息技术业 | 1,355,041.80 | 1.03 |
| J | 金融业 | 1,730,395.31 | 1.32 |
| K | 房地产业 | 1,176,825.79 | 0.90 |
| L | 租赁和商务服务业 | 477,776.87 | 0.36 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 368,430.51 | 0.28 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 29,683.34 | 0.02 |
| 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 | 310,761.74 | 0.24 |
| S | 综合 | 68,074.02 | 0.06 |
| | 合计 | 20,586,176.75 | 15.71 |

（2）报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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 | 300274 | 阳光电源 | 54,723 | 639,711.87 | 0.49 |
| 2 | 600433 | 冠豪高新 | 73,723 | 617,061.51 | 0.47 |
| 3 | 600277 | 亿利洁能 | 95,500 | 603,560.00 | 0.46 |
| 4 | 002396 | 星网锐捷 | 28,936 | 570,039.20 | 0.43 |
| 5 | 002093 | 国脉科技 | 49,248 | 557,979.84 | 0.43 |
| 6 | 000587 | 金洲慈航 | 32,135 | 489,094.70 | 0.37 |
| 7 | 600623 | 华鲁集团 | 24,991 | 471,080.35 | 0.36 |
| 8 | 002332 | 仙乐制药 | 35,400 | 440,022.00 | 0.34 |
| 9 | 601668 | 中国医药 | 71,007 | 438,113.19 | 0.33 |
| 10 | 002118 | 紫鑫药业 | 26,137 | 412,180.49 | 0.31 |