

中银智能制造股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第2号)

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
 二〇一七年八月

重要提示

本基金经2015年6月4日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1109号文募集注册。基金合同于2015年6月19日生效。

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。中国证监会不对基金的投资价值或市场前景等作出实质性判断或者保证。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者在认购(或申购)基金前应认真阅读本招募说明书基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,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,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人及基金销售机构在基金募集实施过程中产生的基金管理风险,基金投资过程中产生的操作风险,因收支违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特有风险,等等。本基金投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发生主体信用资质恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法及时出售所持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金的特有风险详见招募说明书“风险提示”章节。

本基金为股票型证券投资基金,属于高风险和高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。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前,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本更新招募说明书所载内容截止日为2017年6月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月31日(财务数据未经过审计)。本基金托管人中信银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金合同生效日

2015年6月19日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况
 公司名称:中银基金管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼
 法定代表人:白志中
 设立日期:2004年8月12日
 电话:(021)38834989
 传真:(021)68872488
 联系人:高爽
 注册资本:1亿元人民币
 股权结构:

股东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币8360万元	83.6%
贝莱德投资管理(英国)有限公司	相当于人民币1660万元美元	16.6%

(二)主要人员情况

1.董事会成员
 白志中(BAI Zhizhong)先生,董事长,国籍:中国,上海交通大学工商管理专业硕士,高级经济师。历任中国银行山西省分行综合计划处处长及办公室主任,中国银行宁夏回族自治区分行行长、党委书记,中国银行广西壮族自治区分行行长、党委书记,中国银行广东省分行行长、党委书记等职。现任中银基金管理有限公司董事长。

李道坚(LI Daojian)先生,董事,国籍:中国,清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年11月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司,历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。具有17年基金行业从业经验。

王超(WANG Chao)先生,董事,国籍:中国,美国Fordham大学工商管理硕士,现任中国银行总行人力资源部副总经理。历任中国银行总行人力资源部经理,高级经理、主管,中国银国际银行负责总行人力资源部总经理,总行人力办公室负责人、董事会秘书等职。

宋福宁(SONG Funing)先生,董事,国籍:中国,厦门大学经济学硕士,经济师,历任中国银行福建省分行资金计划处外汇交易科科长、资金计划处副处长、资金业务部负责人、资金业务部总经理,中国银行总行金融市场总部助理总经理,中国银行总行投资银行与资产管理助理总经理等职。现任中国银行投资银行与资产管理部助理总经理。

曾仲斌(Paul Tsang)先生,董事,国籍:中国,为贝莱德亚太区首席风险管理总监、董事总经理,负责领导亚太区的风险管理工作,同时担任贝莱德亚太区执行委员会成员。曾先生于2015年6月加入贝莱德。此前,他曾担任摩根士丹利亚洲首席风险管理总监,以及亚太区执行委员会成员,带领独立的风险管理团队,专责管理摩根士丹利在亚洲各投资范围的市场、信贷及营运风险,包括机构销售及交易(股票及固定收益)、资本市场、投资管理、风险管理及财富管理工具业务。曾先生过去亦曾于美林的市场风险管理团队效力九年,并曾于瑞银的利率衍生工具交易/结构部工作两年。曾先生现为中国清华大学及北京大学的风险管理客座讲师。他拥有美国威斯康辛大学麦迪逊分校工商管理学士学位,以及宾夕法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士学位。

荆新(JING Xin)先生,独立董事,国籍:中国,现任中国人民大学商学院副院长、会计学教授、博士生导师,先后曾担任,兼任财政部中国会计准则委员会专家、中国会计学会理事、全国会计专业学位教指委副主任委员、中国青少年发展基金会监事、安泰科技股份有限公司独立董事、风神轮胎股份有限公司独立董事。曾任中国人民大学系副主任,中国人民大学审计处处长,中国人民大学商学院党委书记等职。

赵庆凯(ZHAO Xinge)先生,独立董事,国籍:中国,美国西北大学经济学博士,曾在美国康和玛莉学院商学院任教,并曾为美国投资公司协会(美国共同基金行业协会)等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教授长和金融MBA主任,并在中国多家上市公司和金融投资公司担任独立董事。

雷晓波(Edward Radcliffe)先生,独立董事,国籍:英国,法国INSEAD工商管理硕士。曾任百瓩技术有限公司总经理,目前仍担任该公司的咨询顾问。在此之前,曾任英国电信集团零售部副经理,理特伯思顾问公司董事、北京代表处首席代表、总经理,中英商会财务司库,英中贸易协会理事会成员。现任银领合伙人有限公司合伙人。

杜惠芬(DU Huifen)女士,独立董事,国籍:中国,山西财经大学会计学学士,美国俄克拉荷马梅达斯达经济学院工商管理硕士,澳大利亚国立大学高级访问学者,中央财经大学经济学博士。现任中央财经大学金融学院教授,兼任前时代信托股份有限公司独立董事。曾任山西财经大学讲师、山西财经大学金融学院副教授、中央财经大学独立学院(筹)教授、副院长、中央财经大学金融学院院长等职。

2.监事
 乐妮(YUE Ni)女士,职工监事,国籍:中国,工商管理硕士。曾分别在上海浦东发展银行、山西证券有限公司工作,友邦华泰基金管理有限公司工作。2006年7月加入中银基金管理有限公司,现任基金运营部总经理。具有16年证券从业年限,13年基金行业从业经验。

3.管理层成员
 李道坚(LI Daojian)先生,董事,执行总裁。简历见董事会成员介绍。
 欧阳向军(Jason X. OUYANG)先生,督察长,国籍:加拿大,中国证券投资基金业协会-沃顿商学院高级管理人员培训(Warnton-SAC Executive Program)毕业证书,加拿大西部大学伟廉商学院(Ivey School of Business, Western University)工商管理硕士(MBA)和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司,加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年,也曾任蔚深证券有限责任公司(现为证券)研究发展中心总经理,融通基金管理有限公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦国际金融系国际金融金融教研室主任、讲师。
 张家文(ZHANG Jiawen)先生,副执行总裁,国籍:中国,西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长,苏州分行风险管理处处长,苏州分行工业园区支行行长,苏州分行副行长,党委书记。
 陈军(CHEN Jun)先生,副执行总裁,国籍:中国,上海交通大学工商管理硕士,美国伊利诺伊大学金融学硕士。2004年加入中银基金管理有限公司,历任基金运营、权益投资部总经理,助理执行总裁。

杨军(YANG Jun)先生,副执行总裁,国籍:中国,统计学硕士。曾任中国银行总行金融市场部主管。2012年加入中银基金管理有限公司,曾任资深投资经理。

4.基金部
 王伟(WANG Wei)先生,中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP),工学硕士。2010年加入中银基金管理有限公司,曾任研究员、基金运营经理。2015年2月至今任中银美丽中国基金基金经理,2015年3月至今任中银中小盘基金基金经理,2015年6月至今任中银优选基金基金经理,2015年6月至今任中银智能制造基金基金经理。具有7年证券从业年限,具备基金从业资格。

5.投资决策委员会成员的姓名及职务
 主席:李道坚(执行总裁)
 成员:陈军(副执行总裁)、杨军(副执行总裁)、奚鹏洲(固定收益投资部总经理)、李建(权益投资部总经理)
 列席成员:欧阳向军(督察长)
 6.上述人员之间均不存在近亲属关系。
 三、基金托管人
 (一)基金托管人情况
 1.基本情况
 名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)
 住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
 办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
 法定代表人:李庆萍
 成立时间:1987年4月7日
 组织形式:股份有限公司
 注册资本:489.35亿元人民币
 存续期间:持续经营
 批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办发[1987]14号
 基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号
 联系人:中信银行资产托管部
 联系电话:010-89936330
 传真:010-85230024
 客服电话:95558
 网址:bankcredit.com

2.主要人员情况
 孙德顺先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行(国际)董事长。此前,孙先生于2014年5月至2016年7月任本行常务副行长;2011年3月起任本行执行董事;2011年12月至2014年5月任本行副行长;2011年10月起任本行党委副书记;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理总部总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长;2005年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长;1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心(北京)等单位工作。期间,1995年12月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1995年1月至2004年4月曾兼任中国工商银行数据中心(北京)总经理;1981年1月至1984年5月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学,获经济学硕士学位。

张强先生,中信银行副行长、分管托管业务。张先生自2010年3月起任本行副行长。此前,张先生于2006年4月至2010年3月任本行行长助理,党委委员,期间,2006年4月至2007年3月曾兼任总行公司银行部总经理。张先生于2000年1月至2006年4月任本行总行运营部副经理、常务副总经理和总经理;1990年9月至2000年1月先后在本行信贷部、济南分行和青岛分行工作,曾任总行信贷部副经理、助理、分行副行长和行长。自1990年9月至今,张先生一直为本行服务,在中国银行业拥有近三十年从业经历。张先生为高级经济师,先后

于中南财经大学(现中南财经政法大学)、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生,现任中信银行资产托管部总经理,硕士研究生学历,高级经济师,教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997年加入中信银行,相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长,总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行沈阳分行党委书记、行长,总行行政管理部总经理。

四、相关服务机构

(一)基金发售机构
 1.直销机构
 中银基金管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼
 法定代表人:白志中
 电话:(021)38834989
 传真:(021)68872488
 1)中银基金管理有限公司直销柜台
 地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
 客户服务电话:021-3883 4788, 400-888-5566
 电子信箱:clientservice@bocim.com
 联系人:董倩

2)中银基金管理有限公司电子直销平台
 本公司电子直销平台包括:
 中银基金官方网站(www.bocim.com)
 官方微信服务号(在微信中搜索公众公司“中银基金”并选择关注)
 中银基金官方APP客户端(在各大手机应用市场搜索“中银基金”下载安装)
 客户服务电话:021-3883 4788, 400-888-5566
 电子信箱:clientservice@bocim.com
 联系人:张磊

2.其他销售机构
 1)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
 办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
 法定代表人:田国立
 客户服务电话:95566
 联系人:陈洪源
 网址:http://www.boc.cn

2)交通银行股份有限公司
 注册地址:上海市银城中路189号
 办公地址:上海市银城中路189号
 法定代表人:牛锡明
 客户服务电话:95559
 联系人:曹楷
 网址:www.bankcomm.com

3)中信银行股份有限公司
 注册地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
 办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
 法定代表人:李庆萍
 客户服务电话:95558
 联系人:赵树林
 网址:htp://bank.citic.com

4)中国民生银行股份有限公司
 注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
 办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
 法定代表人:洪崎
 客户服务电话:95568
 联系人:姚婕英
 公司网站: http://www.cmbc.com.cn

5)兴业银行股份有限公司
 注册地址:福州市湖东路154号中山大厦
 邮政编码:350003
 法定代表人:高建平
 联系人:李博博
 联系电话: 95561
 公司网址:http://www.cib.com.cn

6)上海陆金所资产管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
 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:胡学勤
 客服电话:4006219031
 联系人:李博宇
 公司网站:www.lufunds.com

7)上海天天基金销售有限公司
 注册地址:上海市徐汇区龙平南路88号金鹰(东方财富大厦)
 办公地址:上海市徐汇区龙平南路88号金鹰(东方财富大厦)
 法定代表人:其实
 客户服务电话:95021/4001818188
 联系人:王超超
 网址:http://fund.eastmoney.com/
 基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构
 名称:中银基金管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼
 法定代表人:白志中
 电话:(021)38834989
 传真:(021)68872488
 联系人:乐妮
 (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、孙睿
 联系人:孙睿
 (四)审计基金财产的会计师事务所
 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:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50层
 执行事务合伙人:吴港平
 电话:021-22288888
 传真:021-22280000
 联系人:海殷
 经办会计师:汤敏、许培菁

5.基金名称
 中银智能制造股票型证券投资基金
 六、基金的类型
 股票型证券投资基金
 七、基金的投资目标
 本基金通过挖掘中国经济结构转型、产业升级背景下,智能制造主题相关行业的投资机会,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

八、基金的投资范围
 本基金的投资对象是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)、权证、股指期货等权益类品种,债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、中期票据、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、企业债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、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。

本基金股票投资占基金资产的比例为80-96%,其中投资于智能制造主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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不低于基金资产净值的5%。本基金每个交易日日终扣除股指期货合约缴纳的交易所保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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,可以将其纳入投资范围。
 如果法律法规和中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

九、投资策略

(一)大类资产配置策略
 本基金将跟踪宏观经济增长率(包括GDP增长率、PMI、CPI、PPI走势、M2的绝对水平及同比增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来发展的方向,在此基础上对各类资产的风险和预期收益率进行分析和评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

(二)股票投资策略
 1.个股投资策略
 本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对智能制造主题相关的行业和股票的深入研究与分析,挖掘该类上市公司的投资价值,分享制造业升级中的投资机会。

(3)个股选择
 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择,对企业基本面和估值

水平进行综合的研判,精选优质个股。

定性分析是从竞争优势、市场前景以及治理结构等方面对上市公司进行基本面对评。竞争优势分析包括上市公司在市场优势、资源优势、产品优势等。市场前景分析包括市场的广度、深度、产业政策导向以及上市公司自身进行技术创新并拓展市场的潜力。治理结构分析包括对公司管理层、战略定位、管理制度、内部控制等方面的评价。

定量分析是利用公司的财务和运营数据对企业估值评价,主要包括对成长能力(收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等)、盈利能力(毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等)以及估值水平(市净率(PB)、市盈率(PE)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市销率(PS)、自由现金流贴现、企业价值/EBITDA等)等指标的考察。

(三)债券投资策略
 在大量资产配置的基础上,本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和品种配置等积极投资策略,把握债券市场投资机会,实施积极主动的组合管理,以获取稳健的投资收益。

1.久期管理
 本基金将在对国内宏观经济要素变化趋势进行分析判断的基础上,通过有效控制风险,基于对利率水平的预期和混合型基金中债券投资相对被动的特点,进行以“目标久期”为中心的资产配置,以收益性和安全性为导向配置债券组合。

2.期限结构配置
 由于期限不同,债券对市场利率的敏感程度也不同,本基金将结合对收益率曲线变化的预测,采取下面的几种策略进行期限配置:首先采取主动型策略,直接进行期限结构配置,通过分析和情景测试,确定长期、中期、短期三种债券的投资比例。然后与数量化方法相结合,结合对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用不同投资组合中债券的期限结构配置。

3.确定类资产配置
 确定类资产配置是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等因素基础上,进行类属的配置,优化组合收益。

4.个债选择
 本基金在综合考虑上述配置原则基础上,通过对个体券种的价值分析,重点考察各券种的收益率、流动性、信用评级等因素,选择相应的最优投资组合。本基金还将采取积极主动的策略,针对市场定价失误和回购套利机会等,在确定存在超额收益的情况下,积极把握市场机会。本基金在已有组合基础上,根据对未来市场预期的变化,持续运用上述策略对债券组合进行动态调整。

5、中小企业私募债券投资策略
 中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的非中小企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市公司,企业管理制度和治理结构弱于普通上市公司,信息披露情况相对滞后,对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司,且定向发行方式限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券投资将重点关注信用风险和流动性风险。本基金采取自下而上的方法建立适合中小企业私募债券的信用评级体系,对个券进行信用分析,在信用风险可控的前提下,追求合理回报。本基金根据内部的信用评级方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良,估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。

(四)资产支持证券投资策略
 本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响,同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响,在严格控制信用风险暴露程度的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

(五)衍生品投资策略
 1.股指期货投资策略
 本基金将根据股指期货的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。基金管理人将充分考慮股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

2.权证投资策略
 权证为基金辅助性投资工具。在进行权证投资时,基金管理人将对权证定价的证券基本面研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特征,通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考量权证资产收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

十、业绩比较基准
 本基金的业绩比较基准为:中证装备产业指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
 中证装备产业指数是中证产业指数之一,反映沪深A股中装备产业公司股票的整体表现。全部样本由中证800样本中装备产业的个股组成,采用派许加权方法,按照样本股的调整股本为权重加权计算。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围全面,具有广泛的代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期)等,能够较好地反映中国债券市场整体价格水平和变动趋势,适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

如果今后证券市场有其他代表性更强,或者指数编制单位停止编制该指数,或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,基金管理人可以根据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况在履行适当的程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整,而无须召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照,不决定也不必然反映本基金的投资绩效。

十一、风险收益特征
 本基金为股票型证券投资基金,属于高风险和高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

十二、投资组合报告
 本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人——中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月4日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。

(一)报告期末按行业分类的股票投资组合
 2.1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	110,112,814.29	4.42
B	采矿业	85,438,405.60	3.43
C	制造业	1,330,586,292.11	53.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,289,373.13	1.82
E	建筑业	157,128,194.41	6.31
F	批发和零售业	27,241,746.00	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	38,005,323.54	1.53
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	104,205,406.00	4.18
J	金融业	116,437,376.55	4.67
K	房地产业	50,349,859.60	2.02
L	租赁和商务服务业	63,367,171.27	2.54
M	科学研究和技术服务业	77,636.96	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	217,568.36	0.01
O	原辅服务业、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	52,349.81	0.00
S	综合	--	--
合计		2,128,510,512.28	86.45

(二)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	000915	山东华特	2,854,148	111,168,986.70	4.48
2	000711	滨盛科技	3,578,577	110,112,814.29	4.42
3	600619	贵州茅台	263,136	97,901,624.96	3.83
4	002350	三花智控	8,616,627	96,307,737.87	3.83
5	600114	东信软件	4,437,358	88,548,444.00	3.55
6	600887	伊利股份	4,437,262	83,908,624.42	3.27
7	601689	保利集团	2,441,148	79,567,033.32	3.19
8	000039	中集集团	4,926,526	79,317,068.60	3.18
9	600225	中国石化	13,713,490	78,715,432.60	3.16
10	600885	宏发股份	2,060,325	74,831,004.00	3.00

(三)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	149,450,000.00	6.00
其中:政策性金融债	149,450,000.00	6.00	
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	同业拆借	--	--
9	其他	--	--
10	合计	149,450,000.00	6.00

(四)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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160212	16国开12	1,000,000	99,800,000.00	4.01
2	160217	16国开17	500,000	49,650,000.00	1.99

(六)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