

# 万家瑞兴灵活配置混合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: 万家基金管理有限公司**  
**基金托管人: 上海银行股份有限公司**  
 二零一七年九月

## 重要提示

万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2016年6月4日经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1147号文注册募集,基金合同生效日为2016年7月23日。

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作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,投资人在投资本基金前,应仔细阅读基金合同、本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立、谨慎决策。投资人所持有的基金份额享有基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金在投资运作过程中可能面临各种风险,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,基金管理人在基金管理中投资于证券基金中的中高风险、中高风险收益品种,投资人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。基金管理人提醒投资者基金投资的“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。

本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它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。  
 本招募说明书所载基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是确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,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并视同《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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。  
 本招募说明书所载内容截止日为2017年7月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日(财务数据未经审计)。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称: 万家基金管理有限公司  
 住所: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)  
 办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)  
 法定代表人: 方一天  
 成立日期: 2002年08月23日  
 批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字【2002】44号  
 经营范围: 基金募集;基金销售;资产管理和中国证监会许可的其他业务  
 组织形式: 有限责任公司  
 注册资本: 壹亿元人民币  
 存续期间: 持续经营  
 联系人: 兰剑  
 电话: 021-38909626 传真: 021-38909627  
 2、主要人员情况  
 1.基金管理人董事会成员  
 董事长方一天先生,大学本科学历,先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职,2014年10月加入万家基金管理有限公司,2014年12月起任公司董事,2015年2月至2016年7月任公司总经理,2016年7月起任公司董事长。  
 董事莫永春先生,政治经济学硕士学位,曾任新疆自治区党委政策研究室科长,新疆通宝投资有限公司总经理,新疆对外经济集团总经理,新疆天山股份有限公司董事,现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。  
 董事袁西存先生,中共党员,研究生,工商管理学硕士,曾任莱钢集团财务部部长、副部长,齐鲁证券有限责任公司计划财务部总经理,现任中泰证券股份有限公司财务总监。  
 董事经晓云女士,中国民主建国会会员,研究生,工商管理学硕士,曾任上海财政证券公司市场管理部经理,上海证券有限责任公司经纪管理部副总经理、总经理,上海摩根基金管理有限公司副总经理。2016年7月加入万家基金管理有限公司,2016年7月起任公司董事、公司总经理。  
 独立董事黄磊先生,中国民主建国会会员,经济学博士,教授,曾任贵州财经学院财政金融系教师,山东财经大学金融学院院长、山东省政协常委,现任山东财经大学资本市场研究中心主任、山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员、教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。  
 独立董事张伏波先生,经济学博士,曾任上海申航厂料员,浙江省经济建设投资公司副经理,国泰君安证券股份有限公司总裁助理,兴安证券有限责任公司副总经理,上海证券有限责任公司副总经理、海证期货有限公司董事长、亚太资源有限公司董事,现任玖嘉化工(集团)有限公司董事局副主席。  
 独立董事朱小能先生,中共党员,哲学博士,教授,曾任华东理工大学商学院讲师、中央财经大学中国金融发展研究院硕士生导师、副教授、博士生导师,上海财经大学金融学院副教授、博士生导师,现任上海财经大学金融学院教授、博士生导师。  
 2.基金管理人监事会成员  
 监事会主席李润起先生,硕士学位,经济师。曾任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行项目部经理,新疆国际实业股份有限公司证券事务代表,现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。  
 监事张浩先生,中共党员,管理学博士,先后任职于山东东银投资管理有限公司、山东省国有资产控股有限公司、巨能资本管理有限公司。现任巨能资本管理有限公司董事长。  
 监事李丽女士,中共党员,硕士,中级讲师,先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起加入本公司,现任公司综合管理部总监。  
 监事陈广益先生,中共党员,硕士学位,先后任职于苏州市对外贸易公司、兴业全球基金管理有限公司,2005年3月起任职于万家基金管理有限公司,现任公司总经理助理、基金运营部总监。  
 监事尹丽霞女士,中共党员,硕士,先后任职于申银万国期货有限公司、东海南货有限责任公司、万家共赢资产管理有限公司。2017年4月起加入本公司,现任公司综合管理部副总监。  
 3.基金管理人高级管理人员  
 董事长: 方一天先生(简介请参见基金管理人董事会成员)  
 总经理: 经晓云女士(简介请参见基金管理人董事会成员)  
 副总经理: 李杰先生,硕士研究生,1994年至2003年任职于国泰君安证券,从事行政管理、机构客户开发等工作;2003年至2007年任职于兴安证券,从事营销管理工作;2007年至2011年任职于齐鲁证券,任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入本公司,曾任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理,2013年4月起任公司副总经理,2014年10月至2015年2月担任公司总经理。  
 副总经理: 黄海先生,先后在上海德锦投资有限责任公司、上海申银万国证券研究所有限公司、华宝信托有限责任公司、中银国际证券有限责任公司工作,历任项目经理、研究员、投资经理、投资总监等职务。2015年4月进入万家基金管理有限公司任投资总监职务,负责公司投资管理等工作,2017年4月起任公司副总经理。  
 督察长: 兰剑先生,法学硕士,律师,注册会计师,曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作,2006年10月进入万家基金管理有限公司工作,2015年4月起任公司督察长。  
 4.本基金基金经理简历  
 莫海波,投资研究部总监,MBA,2010年进入财富证券责任有限公司,任分析师、投资经理助理;2011年进入中银国际证券有限责任公司基金,任分析师,环保行业研究员、策略分析师、投资经理。2015年3月加入本公司,现任投资研究部总监、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观策略多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。  
 李文宾,2010年7月至2014年4月在中银国际证券有限责任公司工作,担任研究员职务。2014年5月至2015年11月在华泰资产管理有限责任公司工作,担任研究员职务。2015年11月进入我公司工作,现任万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家康债债券型证券投资基金、万家泰安债券型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理。  
 高源,2006年10月至2007年3月在光大证券股份有限公司研究所工作,担任研究员;2007年4月至2010年6月在安信证券股份有限公司工作,担任研究部高级研究员;于2010年7月至2014年7月在申万菱信基金管理有限公司工作,先后担任投资管理部高级研究员、基金经理等职。2017年4月进入我公司工作,现任万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。  
 历任基金经理:  
 高翰臣,本基金成立时起至2015年12月任本基金基金经理。  
 5.投资决策决策委员会成员  
 (1) 权益投资决策委员会  
 主任: 黄海  
 委员: 莫海波、李文宾、白宇、冯勇、叶勇  
 莫海波先生,投资研究部总监,基金经理。  
 李文宾先生,研究总监助理,基金经理。  
 白宇先生,交易部总监。  
 冯勇先生,量化投资部总监,基金经理。  
 叶勇先生,权益投资部二部总监。  
 (2) 固收投资决策委员会  
 主任: 方一天  
 委员: 陈广益、唐俊杰、苏谋东、白宇、熊义明  
 莫海波先生,公司副总经理,投资总监。  
 莫海波先生,投资研究部总监,基金经理。  
 李文宾先生,研究总监助理,基金经理。  
 白宇先生,交易部总监。  
 叶勇先生,量化投资部总监,基金经理。  
 唐俊杰先生,固定收益部副总监,基金经理。  
 苏谋东先生,固定收益部副总监,基金经理。

白宇先生,交易部总监。  
 熊义明先生,首席宏观分析师。  
 6.上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

1.基本情况  
 名称: 上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)  
 住所: 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: 金煜  
 成立时间: 1995年12月29日  
 组织形式: 股份有限公司(中外合资、上市)  
 注册资本: 人民币60.0445亿元  
 存续期间: 持续经营  
 基金托管业务批准文号: 中国证监会 证监许可[2009]814号  
 托管部门联系人: 阚珂  
 客服电话: 96579或4008-888-998  
 网址: www.96579.com  
 (37) 中国银联网络服务有限公司  
 客服电话: 400-910-1166  
 网址: www.cicc.com.cn  
 (38) 中信建投证券股份有限公司  
 客服电话: 96587或400-888-8108  
 网址: www.cs108.com.cn  
 (39) 中信证券(山东)有限责任公司  
 客服电话: 96548  
 网址: www.citics.com  
 (40) 中信证券(天津)有限公司  
 客服电话: 96568  
 网址: www.cs.citic.com  
 (41) 中信期货有限公司  
 客服电话: 400-990-8826  
 网址: www.citics.com  
 (42) 上海长盛基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-820-2899  
 网址: www.richfund.com  
 (43) 兴业证券股份有限公司  
 客户服务电话: 96562  
 网址: www.xyzq.com.cn  
 (44) 申万宏源证券有限公司  
 客服电话: 96523或400-889-5523  
 网址: www.swhys.com.cn  
 (45) 申万宏源西部证券有限公司  
 客户服务电话: 400-800-0662  
 网址: www.hysec.com  
 (46) 北京恒天明泽基金销售有限公司  
 客服电话: 4008980618  
 网址: www.chtfund.com  
 (47) 东吴证券股份有限公司  
 客服电话: 96330  
 网址: http://www.dwzq.com.cn/  
 (48) 中航证券有限公司  
 客服电话: 96335  
 投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅基金管理人的网站公告。网上交易网址: https://trade.wjasset.com/

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

1.直销机构  
 本基金直销机构为万家基金管理有限公司以及该公司的网上交易平台。  
 住所、办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)  
 法定代表人: 方一天  
 联系人: 张婉璐  
 电话: 021-38909721  
 传真: 021-38909798  
 客户服务热线: 400-888-0800; 96538转6  
 投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅基金管理人的网站公告。网上交易网址: https://trade.wjasset.com/

### 2. 非直销销售机构

(1) 上海银行股份有限公司  
 住所: 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: 金煜  
 客户服务热线: 96564  
 网址: www.bankofshanghai.com  
 (2) 浙江同花顺基金销售有限公司  
 客服电话: 4008-773-772  
 网址: http://fund.10jqka.com.cn  
 (3) 上海天天基金销售有限公司  
 客服电话: 400-1818-138  
 网址: www.1234567.com.cn  
 (4) 北京广盈多策略投资咨询有限公司  
 客户服务电话: 400-068-1176  
 网址: www.jimubox.com  
 (5) 国金证券股份有限公司  
 客户服务电话: 400-660-0109  
 网址: www.gjzq.com.cn  
 (6) 上海好买基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-700-9665  
 网址: www.showbuy.com  
 (7) 大泰金石投资管理有限公司  
 客户服务电话: 021-22679822  
 网址: www.dtfortune.com  
 (8) 上海利得基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-067-6266  
 网址: http://m.laofund.com  
 (9) 嘉亚正行(上海)基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-821-5399  
 网址: www.noah-fund.com  
 (10) 珠海盈米财富管理有限公司  
 客户服务电话: 020-89620066  
 网址: www.yingmi.com  
 (11) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
 客户服务电话: 400-166-1188  
 网址: http://8lj.com.cn/  
 (12) 杭州数米基金销售有限公司  
 客户服务电话: 400-076-6123  
 网址: www.fund123.com  
 (13) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司  
 客服电话: 400-8909-998  
 网址: www.jnlc.com  
 (14) 和讯信息科技有限公司  
 名称: 中国证劵登记结算有限责任公司  
 注册资本: 6.6亿元  
 注册地址: 北京市西城区太平桥大街17号  
 组织形式: 有限责任公司  
 营业期限: 长期  
 客服电话: (010) 58598839  
 传真: (010) 58598834  
 三、出具法律意见书的律师事务所  
 名称: 北京大成(上海)律师事务所  
 住所: 上海大成中报城中路501号15、16层  
 经办律师: 夏火山、华涛  
 电话: (021) 3872 2416  
 传真: (021) 5878 2866  
 联系人: 华涛  
 四、审计基金财产的会计师事务所  
 名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
 住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室(邮编: 100738)  
 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼(邮编: 200120)  
 联系电话: (021) 22828888  
 传真: (021) 22290000  
 联系人: 汤骏  
 经办注册会计师: 汤骏

## 二、基金登记机构

名称: 中国证劵登记结算有限责任公司  
 注册资本: 6.6亿元  
 注册地址: 北京市西城区太平桥大街17号  
 组织形式: 有限责任公司  
 营业期限: 长期  
 客服电话: (010) 58598839  
 传真: (010) 58598834  
 三、出具法律意见书的律师事务所  
 名称: 北京大成(上海)律师事务所  
 住所: 上海大成中报城中路501号15、16层  
 经办律师: 夏火山、华涛  
 电话: (021) 3872 2416  
 传真: (021) 5878 2866  
 联系人: 华涛  
 四、审计基金财产的会计师事务所  
 名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
 住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室(邮编: 100738)  
 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼(邮编: 200120)  
 联系电话: (021) 22828888  
 传真: (021) 22290000  
 联系人: 汤骏  
 经办注册会计师: 汤骏

## 第四部分 基金名称

万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

## 第五部分 基金的风险类型

基金类别: 混合型  
 基金运作方式: 契约型开放式  
 基金存续期间: 不定期  
 本基金投资于具有成长潜力的上市公司,以获取资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。

## 第六部分 基金的投资目标

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票的(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市)的股票)、债券(含中小企业私募债券、证券公司短期公司债券)、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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)。  
 本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的30%-95%,其中,基金持有全部权证的市值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需缴纳的交易所保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券; 股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

## 第七部分 基金的投资策略

一、资产配置策略  
 基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极

主动性的投资管理策略,通过定性分析与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品种价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利机会。在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。

二、股票投资策略  
 本基金主要投资于具有较高成长性且估值有吸引力的公司股票。本基金从定性及定量两个方面来把握投资对象的特征:

(1) 定性方面  
 具有良好的公司治理结构,信息透明,注重公众股东利益和投资者关系;具有优秀、较为稳定的管理层,管理规范先进,能适应不断发展的公司规模;财务透明、清晰,资产质量及财务状况较好;在生产、技术、市场、政策环境等经营层面具有一方面或几方面竞争优势;有清晰的增长战略,并与其现有的竞争优势相符合。

(2) 定量方面  
 已具备历史成长性,历史每股主营业务收入、EPS等财务指标具有增长性;未来成长性持续,预期每股主营业务收入增长率和预期EPS增长率等指标高于行业平均水平;

为达精选目的,本基金结合定量分析和定性分析,构建过模型动态建立和维护核心股票库,从而精选出具有较高成长性且估值有吸引力的公股票进行投资标的,同时将风险管理意识贯穿于股票投资过程中,对投资标的进行持续严格的跟踪和评估。

三、权证投资策略  
 本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可授权品种的价格、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规范投资流程,追求稳定的风险调整后收益。

四、普通债券投资策略  
 在债券投资组合,本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上,对影响个别债券定价的主要因素,包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、规模、合约等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

五、中小企业私募债券投资策略  
 本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别注重中小企业私募债券的信用风险和流动性管理,本着风险调整后收益最大化的原则,确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例,保证本基金相对安全和资产流动性,以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中,将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响,分散投资,确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性;同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素,并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券进行深入研究,由债券研究员根据公司内部《信用评级管理办法》对中小企业私募债券的信用风险和投资价值进行分析并给出内部信用评级和投资评级。本基金投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券;对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券,禁止进行投资。

六、资产支持证券投资策略  
 本基金机会资产支持证券综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等投资策略,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。

七、证券公司短期公司债券投资策略  
 本基金在对证券公司短期公司债券特点和发行信用公司基本面进行深入分析研究的基础上,通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其投资价值;采用多种定价模型以及研究人员对证券公司基本面等不同变量的研究确定其投资价值。投资综合实力较强的证券公司发行的短期公司债券,获取稳健的投资回报。

八、股指期货投资策略  
 在股指期货投资上,本基金以避险保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中,将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究股指期货市场的发展趋势,运用定价模型进行合理估值,谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调仓投资组合仓位,以降低组合风险、提高组合的运作效率。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率\*60%+中证全债指数收益率\*40%  
 沪深300指数是由上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,覆盖了沪深市场六成左右市值,具有良好的市场代表性和市场流动性。沪深300指数与市场整体表现具有较高的相关性,且指数历史表现强于市场平均收益水平,具有良好的投资价值。该指数由中证指数公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护,编制方法的透明度高,具有独立性。中证全债指数是中证指数公司的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,具有很高的代表性。综合考虑基金资产配置与市场收益代表性等因素,

本基金选用沪深300指数和中证全债指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、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的业绩基准时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整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。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金,属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

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。  
 基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月19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。

本投资组合报告所载数据截至2017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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	897,982,056.66	90.32
2	其中:股票	897,982,056.66	90.32
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	95,058,363.59	9.66
11	其他资产	1,442,620.13	0.11
12	合计	994,183,040.38	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	20,118,277.38	2.05
B	采矿业	24,347,800.00	2.47
C	制造业	120,328,721.30	12.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	286,406,168.24	28.94
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,737,040	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	10,898,322.50	1.10
J	金融业	93,585,033.33	9.48
K	房地产业	328,300,972.62	32.97
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		897,982,056.66	91.01

## 2.2 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股票投资组合。

## 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	600340	华鲁恒升	2,713,321	91,113,318.18	9.23
2	601997	招商银行	4,123,984	66,368,287.04	6.62
3	001979	招商蛇口	2,981,100	63,676,286.00	6.46
4	002594	奥翔药业	5,870,789	97,044,687.43	9.87
5	600481	龙元建设	4,942,689	49,516,160.27	5.05
6	600088	华泰证券	4,077,280	45,825,627.20	4.64
7	600048	保利地产	4,207,321	41,966,390.37	4.26
8	601688	中国国贸	4,162,966	40,491,004.40	4.10
9	002047	宝通软件	3,810,213	32,620,340.32	3.30
10	300197	银汉生态	2,466,200	32,606,261.20	3.30

## 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

## 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

## 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投资。

## 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

9.1 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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策  
 本基金本报告期末未持有股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
 10.1 本期国债期货投资政策  
 本基金本报告期末未持有国债期货。

10.2 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合约。

10.3 本期国债期货投资评价  
 本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11. 投资组合报告附注

11.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金