（上接B109版）

网址:http://www.zxwt.com.cn
（75）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
办公地址:北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元
法定代表人:李长伟
联系人:唐昌田
传真:010-88321763
客户服务电话:4006650999
网址:www.tpyzq.com
（76）第一创业证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
联系人:吴军
传真:0755-25838701
客服电话:95358
网址：www.firstcapital.com.cn
（77）北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:盛海娟
电话：010-57418813
传真:010-57569671
客户服务电话：400-893-6885
网址：www.qianjing.com
（78）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（入驻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道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人：陈广浩
电话：0755 8946 0500
传真：0755 2167 4453
客户服务电话:400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
（79）珠海盈米财富管理有限公司
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
联系人:钟琛
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
（80）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21&28层
法定代表人:蒋煜
联系人:蒋宸
电话:010-58170911
传真:010-58170800
客户服务电话:400 818 8866
网址:http://fund.shengshiview.com/
（81）上海基煜基金销售有限公司
注册地址： 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人：蓝杰
电话：021-65370077-220
传真：021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网址：www.jiyufund.com.cn
（82）深圳前海京西票号基金销售有限公司
注册地址：甚至是前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区海德一道88号中州控股中心A座1606
法定代表人：吴永宏
联系人：邹冲
电话：15920063836
客户服务电话:400-800-8668
网址:www.ph6.com
（83）南京途牛金融信息服务有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人:宋时琳
联系人：贺杰
电话：18551612276
传真：025-86853960
客户服务电话:4007-999-999转3
网址:http://jr.tuniu.com/
（84）北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系人：李瑞真
电话：010-56282140
传真：010-62680827
客户服务电话：400-619-9059
网址：www.fundzone.cn
（85）北京格上富信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:曹庆展
电话：010-85932450
传真：010-65983333
客户服务电话：400-066-8586
网址：www.igesafe.com
（86）北京广源达信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区宏泰东街浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
联系人：王英俊
电话：010-52798634
传真：010-82055860
客户服务电话：400-623-6060
网址：www.niuniufund.com
（87）上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
联系人：沈杰
电话：021-5132 7185
传真：021-5071 0161
客户服务电话:400-821-0203
（88）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:李悦
联系人：张晔
电话：010-56642600
传真：010-56642623
客户服务电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com
（89）天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人:丁东华
联系人：郭宝亮
电话:010-59287061
传真:010-59287825
客户服务电话：400-111-0889
网址:www.gomefund.com
（90）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人：姜焕洋
电话：0411-88891212
传真：0411-84396536
客户服务电话：400-0411-001
网址：www.taichengcaifu.com
（91）金惠家保险代理有限公司
注册地址:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
办公地址:北京市朝阳门外大街18号丰联广场A座1009
法定代表人：夏予柱
联系人：胡明哲
电话：15810201340
传真：028-62825327
客户服务电话：400-8557333
网址：www.jhjfund.com
（92）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李昭琛
联系人：吴翠
电话：010-60619607
传真：8610-62676582
客户服务电话：010-62675369
网址：www.xincai.com
（93）徽商银行股份有限公司
注册地址:合肥安庆路79号天徽大厦A座
办公地址:合肥安庆路79号天徽大厦A座
法定代表人:李宏鸣
联系人:叶卓伟
电话：0551-62667635
传真：0551-62667684
客户服务电话:96588
网址:www.hsbank.com.cc
（94）天津银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区友谊路15号
办公地址:天津市河西区友谊路15号
法定代表人：袁福华
联系人：李岩
电话：022-28405684
传真：022-28405631
客户服务电话:4006960296
网址:www.bank-of-tianjin.com.cn
（95）云南红塔银行股份有限公司
注册地址:云南省玉溪市东风南路2号
办公地址:云南省玉溪市东风南路2号
法定代表人:旃绍平
联系人:常奕潍
电话:0877-2060607
传真:0877-2061603
客户服务电话:0877-96522
网址:http://www.yxccb.com.cn
（96）江苏紫金农村商业银行股份有限公司
注册地址：南京市建邺区梦都大街136号
办公地址：南京市建邺区梦都大街136号
法定代表人:张小军
联系人：游丹
电话：025-88866645
传真：025-88866724
客户服务电话:025-96008
网址：http://www.zjrcbank.com
（97）富滇银行股份有限公司
注册地址:昆明市拓东路41号
办公地址:昆明市拓东路41号
法定代表人:夏蜀
联系人：杨翊琳
电话：0871-63140324
传真：0871-63194471
客户服务电话:400-88-96533
网址：www.fudian-bank.com
（98）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
联系人:朱瑞良
电话:0512-69868364
传真:0512-69868370
客户服务电话:96067
网址:www.suzhoubank.com
（99）华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯阳
联系人:金达勇
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
客户服务电话:4008888818
网址:http://www.hx168.com.cn
（100）大同证券有限责任公司
注册地址:山西省大同市大北街13号
办公地址:太原市长治路111 号山西世贸中心A 座F12、F13
法定代表人:董祥
联系人:薛津
电话:0351-4130322
传真:0351-4192803
客户服务电话:4007121212
（101）江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张宇宏
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务电话:4006662288
网址:http://www.jhzq.com.cn
（102）大有期货有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
法定代表人:沈众辉
电话:0731-84409000
传真:0731-84409009
客户服务电话:4006-365-058
网址:www.dayouf.com
（103）弘业期货股份有限公司
注册地址：南京市中华路50号弘业大厦
办公地址:南京市中华路50号弘业大厦
法定代表人：周剑秋
电话:025-52278870
传真:025-52313068
联系人：孙朝旺
客户服务电话:400-828-1288
网址:www.ftol.com.cn
（104）上海通华财富资产管理有限公司
注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址：上海市浦东新区金桥路28号新金桥大厦5楼
法定代表人：周盛
联系人：金昌明
联系电话:021-61766938
客服电话：400-669-5156
网址:https://www.tonghuafund.com
（105）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部A座
法定代表人：江卉
联系人：万容
电话：010-89188345
传真：89189566
客户服务电话：个人业务:95118 企业业务:400 088 8816
网址:http://fund.jd.com
（106）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋玥
电话：010-88066632
传真：010-88066214
客户服务电话：400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
（107）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区望京阜通东大街 望京SOHO T3 A座 19层
法定代表人：钟斐斐
联系人：戚晓强
电话：010-61840688
传真：010-61840699
客户服务电话：4000618518
网址：https://danjuanapp.com
（108）广发证券股份有限公司
注册地址:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址： 广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
客户服务电话:95575或致电各地营业网点
网址:http://www.gf.com.cn/
（109）中原银行股份有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大厦
办公地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大厦
法定代表人：窦荣兴
联系人：牛映雪
电话：0371-85517710
传真：0371-85519869
客户服务电话：95186
网址：www.zybank.com.cn
（110）济安财富（北京）基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话： 010-65309516
传真： 010-65330699
客户服务电话： 400-673-7010
网址：www.jianfortune.com
（111）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁顾明
联系人：赵明
电话：021-20324155
传真：021-20324199
客户服务电话：400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
（112）上海挖财金融信息服务有限公司
注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址： 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：胡燕亮
联系人:樊晴晴
电话：021-50810687
传真：021-58300279
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。
（二）基金登记机构
名 称:工银瑞信基金管理有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
注册登记业务办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层
法定代表人:郭特华
全国统一客户服务电话:400-811-9999
传 真:010-66583100
联系人:朱辉毅
（三）律师事务所及经办律师
名 称:北京市天元律师事务所
住 所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
负责人:朱小辉
电 话:010-57763888
传 真:010-57763777
经办律师:吴冠雄、李晗
（四）会计师事务所及经办注册会计师
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号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:李慧明,王珊珊
联系电话:（010）58152145
传真:（010）58114645
联系人:王珊珊

四、基金的名称

工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的投资目标

紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,积极选择深度受益的新兴蓝筹股票,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,力争获取超越业绩比较基准的收益。

七、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交易的股票（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）、权证、股指期货、债券（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金,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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为80%-95%,其中,投资于本基金界定的新蓝筹主题股票占非现金资产的比例不低于80%。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。

如法律法规或中国证监会允许，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。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上,采用动态调整策略,在市场上涨阶段中,适当增加权益类资产配置比例,在市场下行周期中,适当降低权益类资产配置比例,力求实现基金财产的长期稳定增值,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。

2、股票选择策略

（1）新蓝筹主题的界定

本基金“新蓝筹”主题的界定为:以下四类上市公司的股票。

A.行业发展状况良好,企业处于成长阶段或成熟阶段的早期,市场竞争能力强，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于GDP 增长率的新兴蓝筹上市公司;B.企业盈利能力较强,主营业务盈利水平较高;财务管理能力较强,现金收支安排有序,资产盈利水平较高;主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性的蓝筹上市公司;C.企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势,有良好的市场知名度和较好的品牌效应的行业龙头上市公司;D .已实施改革方案,或具有改革预期的传统蓝筹公司。

未来随着企业转型，新蓝筹主题股票的识别及认定也会随之调整。如因基金管理人界定新蓝筹主题的方法调整或者上市公司经营发生变化不再属于本基金管理人所界定的新蓝筹主题的、本基金持有的新蓝筹主题股票的比例低于非现金基金资产的80%,本基金将在三十个工作日之内进行调整。

（2）股票选择

本基金投资从经济增长的长期规律出发,结合我国最新的经济发展战略和经济结构调整方向,采取自下而上的价值型投资策略,通过定性分析与定量分析相结合的办法,以“新蓝筹”资本增值型投资为主导,非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景。本基金对市场运行特征进行跟踪,选取在行业中已处于龙头地位且具备长期核心竞争优势、持续稳定成长性、估值相对合理和价值稳定成长的新蓝筹主题优质上市公司的股票进行重点投资。

1）定性分析

本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据,主要包括以下几个方面:

A.公司的竞争优势:重点考察公司的市场优势,在细分市场是否占据领先位置,是否具有品牌号召力或较高的行业知名度等;资源优势,包括是否拥有独特优势的物资或非物质资源,比如市场资源、专利技术等;产品优势,包括是否拥有对产品的定价能力等以及其他优势;

B.公司治理评估:本基金认为具有良好公司治理机制的公司具有以下几个方面的特征:①公司治理框架保护并便于行使股东权利,公平对待所有股东；②尊重公司相关利益者的权利；③公司信息披露及时、准确、完整;④公司董事会勤勉、尽责,运作透明;⑤公司股东能够对董事会成员施加有效的监督,公司能够保证外部审计机构独立、客观地履行审计职责。不符合上述治理准则的公司,本基金将给予其较低的评级。

C.公司的盈利模式:对企业盈利模式的考察重点关注企业盈利模式的属性以及成熟程度,考察核心竞争力的不可复制性、可持续性、稳定性;

2）定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析,以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。包括:成长性指标（收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等）、财务指标（毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等）、估值指标（PE、PEG、PS等）。

3、股指期货投资策略

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析,发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点,采用股指期货在短期内取代部分现货,获取市场敞口,投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时,为避免市场冲击,提前建立股指期货多头头寸,然后逐步买入现货并解除股指期货多头,当完成现货建仓后将股指期货平仓;空头套期保值指当基金需要卖出现货时,先建立股指期货空头头寸,然后逐步卖出现货并解除股指期货空头,当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中,将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合beta的稳定性,精细化确定投资方案比例。

4、债券投资策略

本基金在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

(1)利率策略

研究GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,综合宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断,可以制定出组合的目标久期,预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期,以规避债券价格下降的风险和资本损失,获得较高的再投资收益;预期市场利率将下降时,提高组合的久期,在市场利率实际下降时获得债券价格上升的收益,并获得较高利息收入。

(2)信用策略

根据国民经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景,发行人业务发展状况,企业市场地位,财务状况,管理水平,债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用级别,确定债券的信用风险利差与投资价值。

(3)债券选择与组合优化

本基金将根据债券市场情况，基于利率期限结构及债券的信用级别,在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上,评估债券投资价值,选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合,并根据市场变化情况对组合进行优化。

(4)可转换债券投资

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点,是本基金的重要投资对象之一。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,以合理价格买入并持有。

5、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证,或者本基金在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合,力求取得最优的风险调整收益。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

九、基金的业绩比较基准

1、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

80%×沪深300指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。

2、选择理由

沪深300指数是由中证指数有限公司编制,由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成，综合反映了沪深A股市场整体表现。中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场,成份券种包括除资产支持债和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

本基金是股票型证券投资基金,股票投资比例为80-95%,本基金对沪深300指数和中债综合财富指数分别赋予80%和20%的权重符合本基金的投资特性。

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,经与基金托管人协商一致,本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合的报告期为2017年10月1日起至12月31日止（财务数据未经审计）。

1.1 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	327,934,770.41	81.33
	其中:股票	327,934,770.41	81.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,706,700.00	5.14
	其中:债券	20,706,700.00	5.14
	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	1,994,211.96	0.49
8	其他资产	52,598,161.65	13.04
9	合计	403,233,844.02	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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	-	-
B	采矿业	24,440,069.55	6.09
C	制造业	117,025,322.26	29.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	6,090,304.00	1.52
F	批发和零售业	22,833,843.30	5.69
G	交通运输、仓储和邮政业	19,190,545.06	4.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.01
J	金融业	102,721,683.12	25.62
K	房地产业	25,750,180.97	6.42
L	租赁和商务服务业	9,800,243.20	2.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
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	327,934,770.41	81.78

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

1.3 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	600036	招商银行	679,879	19,730,088.58	4.92
2	601939	建设银行	1,954,279	15,008,862.72	3.74
3	600176	中国巨石	912,160	14,859,086.40	3.71
4	002024	苏宁云商	1,102,300	13,547,267.00	3.38
5	600030	中信证券	743,100	13,450,110.00	3.35
6	601166	兴业银行	749,700	12,737,403.00	3.18
7	601766	中国中车	1,015,000	12,291,650.00	3.07
8	600887	伊利股份	380,000	12,232,200.00	3.05
9	000651	格力电器	273,500	11,951,950.00	2.98
10	002142	宁波银行	670,122	11,934,872.82	2.98

1.4 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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,960,000.00	4.98
	其中:政策性金融债	19,960,000.00	4.98
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）	746,700.00	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,706,700.00	5.16

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

1.5 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

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	170204	17国开04	200,000	19,960,000.00	4.98
2	128024	宁行转债	7,467	746,700.00	0.19

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 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投资，也无期间损益。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

1.10.2 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投资，也无期间损益。

1.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的投资决策程序说明:

中信证券

本报告期，本基金持有中信证券，其发行主体（以下简称“该公司”）在司度（上海）贸易有限公司从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下,为其提供融资融券服务,涉嫌违反《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。中国证监会拟决定对该公司责令改正,给予警告,没收违法所得并处罚款,并对直接负责的主管人员给予警告,并处以罚款。

该公司为不符合要求的投资者账户开通全国股转系统合格投资者权限,且未如实上报违规开户情况。全国中小企业股份转让系统对该公司采取责令改正的自律监管措施。

该公司北京好运街营业部未经审批同意擅自发布宣传推介材料,宣传推介材料部分表述片面强调收益,违反了《关于加强证券经纪业务管理的规定》第一条、第二条的规定,深圳证监局责令该公司立即改正,并对该公司采取责令增加内部合规检查次数的监督管理措施。

本基金对相关股票的投资主要基于监管处罚和管理层变动已经基本落地、基本面竞争优势仍较强,同时估值回落到历史较低水平具有吸引力,投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

1.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	57,590.40
2	应收证券清算款	51,227,176.08
3	应收股利	-
4	应收利息	489,870.11
5	应收申购款	823,525.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,598,161.65

1.11.4 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。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金合同生效日为2015年8月6日,基金合同生效以来（截至2017年12月31日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率①	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
2015.8.6-2015.12.31	1.70%	0.27%	-1.65%	1.89%	3.35%	-1.62%
2016年	4.62%	1.26%	-8.44%	1.12%	13.06%	0.14%
2017年	30.17%	0.62%	17.22%	0.51%	12.95%	0.11%
自基金合同生效日起至今	38.50%	0.91%	5.56%	1.10%	32.94%	-0.19%

2、本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较:

（2015年8月6日至2017年12月31 日）



注:1、本基金基金合同于2015年8月6日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产占基金资产的比例为80%-95%,其中,投资于本基金界定的新蓝筹主题股票占非现金资产的比例不低于80%。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。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、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、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、期货交易费用;

（7）基金的银行汇划费用;

（8）基金的相关账户的开户及维护费用;

（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。

2、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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,,基金托管人于次月前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、公休日等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,,基金托管人于次月前2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第（3）-（9）项费用”,根据有关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。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

（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。

4、基金管理费和基金托管费的调整

在法律法规允许的条件下,基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率和基金托管费率,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金对申购设置级差费率，投资者在一天之内如有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金的申购费率如下表所示:

基金的申购费率结构

费用种类	申购金额（M）	费率
申购费	M<100万	1.5%
	100万≤M<300万	1.0%
	300万≤M<500万	0.8%
	500万≤M	按笔收取,1,000元/笔

注:M为申购金额

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费