

信诚至选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要

(2018年第1次更新)

基金管理人:中信保诚基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
重要提示
信诚基金管理有限公司经中国证监会批准于2006年9月30日注册成立。因业务发展需要,经国家工商总局核准,公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”(以下简称“我司”),并由上海市工商行政管理局于2017年12月18日被发新的营业执照。

根据《中华人民共和国合同法》第七十六条的规定,合同当事人名称变动不影响合同义务的履行。本次我司名称变更后,以“信诚基金管理有限公司”或“中信保诚基金管理有限公司”签署的法律文件(包括但不限于合同、公告等,以下简称“原法律文件”)不受任何影响,我司将按照约定履行权利和义务。如原法律文件对生效条件、有效期限进行特别说明的,以原法律文件的说明为准。

信诚至选灵活配置混合型证券投资基金经2016年8月20日中国证监会证监许可[2016]1966号文予募集注册。

基金管理人应当充分了解基金定期定额投资和零存零取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单可行的投资方式,但不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效替代方式。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能使其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存零取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单可行的投资方式,但不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效替代方式。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险、估值风险,也包括流动性风险、特有风险及其他风险等风险。

本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

投资有风险,投资人在认购(或申购)本基金时应仔细阅读本招募说明书,全面认识本基金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,自主做出投资决策,自行承担投资的风险,投资人应当通过本基金管理人或销售机构购买本基金,各销售机构的具体名称见基金管理人公告以及基金管理人网站发布的销售机构的相关公告。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金的投资业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,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人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策 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。

本招募说明书所载数据截止日期为2018年5月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:中信保诚基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人:张翔燕
成立时间:2006年9月30日
批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】142号

注册资本:贰亿元人民币
电话:(021)68649788
联系人:唐世春
股权结构:

股东	出资额 (万元人民币)	出资比例 (%)
中信银行有限责任公司	9800	49
英国保诚集团控股有限公司	9800	49
中国苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合计	20000	100

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员
张翔燕女士,董事长,工商管理硕士。历任中信银行总行综合计划部总经理,中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业部副总经理,中信证券股份有限公司副总经理、中信建投证券股份有限公司风险管理部总经理、中信控股有限责任公司副总裁、中国中信集团有限公司业务协同副主任、中信银行有限责任公司董事长。现任中信保诚基金管理有限公司董事长。

王亚刚先生,董事,工商管理硕士。历任中信银行有限责任公司综合管理部总经理、中信银行部总经理、总经理助理、董事会秘书、副总经理。现任中信银行有限责任公司副总经理、董事会秘书、周有业务审查委员会主任兼天津信唐货币经纪有限责任公司董事长。

Guy Robert STRAPP先生,董事,澳大利亚籍,商科学士。历任瀚亚投资(香港)有限公司首席执行官,美国保诚集团亚洲区资产管理兼瀚亚投资、瀚亚(新加坡)有限公司首席执行官,后任瀚亚投资集团首席执行官兼瀚亚投资(香港)有限公司首席执行官、瀚亚投资管理(上海)有限公司董事。

魏秀彬女士,董事,新加坡籍,工商管理硕士。历任施罗德国际商业银行东南亚区域合规经理、施罗德投资管理(新加坡)亚太地区风险及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官、瀚亚投资管理(上海)有限公司监事。

吕海先生,董事,总经理,工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司(中信证券股份有限公司的全资子公司,2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并)总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理有限公司副总经理。现任中信保诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

孙卿麟先生,独立董事,美国籍,商科学士。历任安永会计师事务所(香港)资产管理审计团队亚太区联合负责人、安永会计师事务所(旧金山)美国西部资产管理审计团队领导等职。现任LitationTrusteeTrustee受任人,NipponWealth Bank独立董事,Ironwood Institutional Multi Strategy Fund LLC和Ironwood Multi Strategy Fund LLC独立董事。

夏庆东先生,独立董事,经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部处长、安永华明会计师事务所高级经理、北京天华会计师事务所首席合伙人。现任致衡会计师事务所管委会副主席。

杨思群先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财经经济研究所副研究员,现任清华大学经济管理学院经济学院副教授。

注:原“英国保诚集团亚洲区总部基金管理部”自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资,其旗下各公司名称亦从该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

2.基金管理人监事会成员

於乐女士,执行董事,经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行资产管理部主管、通用电气金融服务(中国)有限公司人力资源经理。现任中信保诚基金管理有限公司首席人力资源经理。

3.经营管理层人员情况

张翔燕女士,董事长,工商管理硕士。历任中信银行总行综合计划部总经理,中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业部副总经理,中信证券股份有限公司副总经理、中信建投证券股份有限公司风险管理部总经理、中信控股有限公司副总裁、中国中信集团有限公司业务协同副主任、中信银行有限责任公司副董事长。现任中信保诚基金管理有限公司董事长。

吕海先生,董事,总经理,工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司(中信证券股份有限公司的全资子公司,2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并)总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理有限公司副总经理。现任中信保诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

桂思聪先生,副总经理,工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计员、中乔威诚汤达广告有限公司财务总监,德国莱默斯银行上海分行财务经理,中信保诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任中信保诚基金管理有限公司风险控制总监、首席财务官,中信信诚资产管理有限公司(中信保诚基金管理有限公司之子公司)董事。

唐世春先生,副总经理,法学硕士。历任北京天平律师事务所律师、国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书、中信保诚基金管理有限公司督察员兼基金董事会秘书、中信信诚资产管理有限公司副董事。现任中信保诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

4.督察长

周浩先生,督察长,法学硕士。历任中国证券监督管理委员会主任科员、公职律师、副调研员,上海航运产业基金管理有限公司合规总监、国联安基金管理有限公司督察长。现任中信保诚基金管理有限公司督察长、中信信诚资产管理有限公司董事。

5.基金经理

魏海先生,经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司,担任研究部分析师;于东方证券有限责任公司,担任研究所所长助理;于上海申银万国证券研究所,历任宏观策略部副总监、金融工程部总监;于平安资产管理有限责任公司,担任量化投研部总经理;于中信证券股份有限公司,担任研究所金融工程部总监。2015年6月加入中信保诚基金管理有限公司,担任量化投资总监。现任信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金基金(DOP)、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永赢一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法策略股票证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

6.投资决策委员会成员

胡皓女士,总经理助理、副首席投资官、特定资产投资管理总监;
王亚刚先生,副投资决策总监、基金经理;
董皓先生,交易总监;
张光成先生,股票投资总监、基金经理;
王睿先生,研究副总监、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
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:北京市东城区朝门北大街9号

法定代表人:李庆萍
成立时间:1987年4月20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函[1987]14号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]126号

联系人:中信银行资产托管部
联系电话:4006800000
传真:010-85230024
客服电话:96558
网址:bankcredit.com

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理外汇汇兑;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务;保险兼业代理业务(有效期至2017年09月08日)。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)。

中信银行(601998.SH,0908.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中最早设立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以创建中国现代金融史上多个“第一”而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场的改革中逐渐成长壮大。于2005年8月,正式更名“中信银行”。2006年12月,以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年,成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的战略合作关系。2007年8月4日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所金融市场的改革中逐渐成长壮大。于2005年8月,正式更名“中信银行”。2009年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的有效性予以肯定。

(二)主要人员情况

孙德顺先生,现任中信银行执行董事、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6月至2016年7月任本行常务副行长;2014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月起担任本行党委常委;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理副副总裁兼交通银行北京分行党委书记、行长;2006年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长;1994年6月至2006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、数额中心(北京)等单位工作。期间,1995年12月至2005年11月在中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1999年1月至2004年4月曾兼任在中国工商银行数额中心(北京)总经理;1991年4月至1994年5月就职于中国人民银行,孙先生拥有十多年年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学,获经济学硕士学历。

张强先生,中信银行副行长、分管托管业务。张先生自2010年9月起担任本行副行长。此前,张先生于2006年4月至2010年3月任本行行长助理,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2008年1月至2008年4月任本行总行营业部副总经理、常务部总经理和总经理;1990年9月至2000年1月先后在本行总行、济南分行和青岛分行工作,曾任总行信贷部副经理、总经理、分行副行长和行长。1990年9月至今,张先生一直为工商银行、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(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。

杨帆先生,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专业。曾就职于中国人民银行四川信管处、中国工商银行四川信管处。1997年加入中信银行,担任任中信银行成都分行信託部总经理、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、中信银行四川分行党委书记、行长、总行资产管理部总经理。

(三)基金托管人中信银行经中国证监会监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2017年末,中信银行已托管144只公开募集证券投资基金,以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、ODII等其他托管资产,托管总规模达到8,065亿元人民币。

(四)基金托管人的内部控制制度

1.内部控制目标。强化内部控制,确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行;建立完善的规章制度和操作规程,保证基金托管业务持续、稳健发展;加强稽核检查,建立有效的风险控制系统,及时有效地发现、分析、控制和避免风险,确保基金财产安全,维护基金份额持有人利益。

2.内部控制组织结构。中信银行总行设立了风险管理委员会,负责全行的风险控制制度和风险防范工作;托管部内设内控合规岗,专门负责托管业务内部风险控制,对基金托管业务的各个环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核检查。

3.内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定,以控制风险和防范基金托管业务风险为主线,制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一系列规章制度,涵盖证券投资基金托管业务的各个环节,保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4.内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等,从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展;建立了安全保管基金财产的物资条件,为业务运行所实行封闭管理,在重要部门岗位设立了安全保护区,安装了录像、录音监控系统,保证基金信息的安全;建立了严密的内部控制防线和业务授权管理制度,确保所托管的基金财产独立运行;营造良好的内部控制环境,开展多种形式的持续培训,加强职业道德教育。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定,对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用计提、应收益到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中载誉的基金业绩数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为或违规事项未能在规定时间内纠正的,基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1.直销机构

中信保诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

2.其他销售机构

(1)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区川北路190号2号楼2楼
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座
法定代表人:其实
电 话:021-54666626
传 真:021-54666601
公司网址:www.1234567.com.cn
客服电话:400-1818-188

(2)天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

3.基金销售机构

办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李德修
http://www.wanjiawealth.com
具体名称详见基金销售机构公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更其上述销售机构,并及时公告。

二、登记机构

名称:中信保诚基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人:张翔燕
客服电话:400-6660066
联系人:金苏琴
电话:021-68649788

3.出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
联系人:廖海、刘佳
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
联系人:刘佳

四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区南汇路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:赵钰

经办注册会计师:薛竞、赵钰
五、基金的名称
信诚至选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

六、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

七、投资组合

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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货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,基金管理人将在履行适当程序后,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0%—95%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;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,基金保留的现金或投资于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%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

八、资产的投资策略

1.资产配置策略

本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场投资环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益性的前提下,动态优化调整权益类、固定收益类等各类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

2.股票投资策略

在股票资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合;自上而下地研判行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地研判个股的竞争力、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合研判,严选安全边际较高的个股。

3.债券投资策略

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及投资级基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。

4.证券公司短期公司债券投资策略

本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析,结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等因素综合评价结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

5.资产支持证券投资策略
本基金将深入分析资产支持证券的基础资产、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还等要素和评级报告。本基金将在基本分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的投资组合进行信用跟踪,信用跟踪、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取收益证券化策略、信用利差曲线策略、提前利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。

基金管理人运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的风险管理。

七、权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证证券的研究进行基本面分析及估值的基础上,结合权证波动率等参数,运用期权定价模型,确定其合理公允价值,构建交易组合。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,本基金可以相应调整和相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

本基金是一只灵活配置混合型基金,该业绩比较基准可以较好地衡量本基金的投资业绩。

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的业绩比较基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召集基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金基金。

本基金的投资品种及数量符合招募说明书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据基金合同的约定,于2018年4月20日复核了本招募说明书中的投资组合信息,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合的财务数据截至至2018年3月31日

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	60,591,596.08	9.83
	其中:股票	60,591,596.08	9.83
2	固定收益投资	547,537,150.10	88.80
	其中:债券	547,537,150.10	88.80
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,143,164.56	0.19
7	其他资产	7,329,587.02	1.19
8	合计	616,611,496.66	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	777,600.00	0.13
C	制造业	22,813,746.11	3.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

F	建筑业	1,521,014,000	0.25
F	批发和零售业	474,002,287	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	4,415,368,000	0.72
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	29,063,967,000	4.72
K	房地产业	1,525,900,000	0.25
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	60,591,596.08	9.84

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	-	-
B	采矿业	777,600.00	0.13
C	制造业	22,813,766.11	3.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,521,014.00	0.25
F	批发和零售业	474,002.27	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	4,415,368.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	29,063,967.00	4.72
K	房地产业	1,525,900.00	0.25
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	卫生健康和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
8	合计	60,591,596.08	9.84

8	601318	中国平安	40,000	2,612,400.00	0.42
9	601166	兴业银行	149,700	2,498,493.00	0.41
10	601988	中国银行	633,100	2,488,063.00	0.40

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	国债	1,000,100.00	0.16
2	金融债	24,550,000.00	3.99
3	金融固定收益	20,144,000.00	3.27
4	中期票据	-	-
5	可转债	621,060.10	0.10
6	同利存单	471,219,000.00	76.53
7	其他	-	-
8	合计	547,537,150.10	88.92

1	国家债券	30,003,000.00	4.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,000,100.00	0.16
	其中：政策性金融债	1,000,100.00	0.16
4	企业债券	24,550,000.00	3.99
5	企业短期融资券	20,144,000.00	3.27
6	中期票据	-	-
7	可转债	621,050.10	0.10
8	同业存单	471,219,000.00	76.53