

(上接B26版)

(71)上海陆金所资产管理有限公司
 基金业协会备案编号: A6653
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼04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:陈振
 联系人:何霄
 电话:(021)20669592
 传真:(021)22666653
 客服电话:400-821-9031
 网站:lufund.com

(二)证券登记机构
 名称:长盛基金管理有限公司
 注册地址:深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼10D
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道256号华夏银行大厦14楼
 法定代表人:陈新
 电话:(010)82019988
 传真:(010)82255988
 联系人:魏斌
 (三)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:上海市浦东新区世纪大道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
 电话:(021)51151208
 传真:(021)51151098
 联系人:张兰
 经办律师:刘佳,张兰

(四)审计会计师事务所(含会计师事务所)
 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
 办公地址: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
 执行事务合伙人:吴港海
 电话:(010)58153000
 传真:(010)58188298
 经办注册会计师:汤尧,贺震
 联系人:贺震

五、基金的名称
 本基金名称为“陆金所陆金所灵活配置混合型证券投资基金”
六、基金的类型
 基金类型:契约型开放式
七、基金的投资目标
 本基金定位为“陆金所陆金所”安全相关主题股票,把握中国航天军工装备安全相关产业发展带来的投资机会,力求为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的长期资本增值。
八、基金的投资范围
 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股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的其他股票),权证,股指期货,债券,货币市场工具,资产支持证券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)。
 本基金投资于股票资产和债券资产的比例为60%-95%,其中投资于航天军工装备安全相关上市公司股票和债券的比例不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期在一年以内的政府债券,股指期货合约的投资比例符合相关法律法规的规定。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略
 本基金为主动管理型,基金管理人的投资研究体系,运用科学严谨、规范化的资产配置方法,灵活运用国内航天军工装备安全相关上市公司股票和债券,谋求基金资产的长期稳定增长。
 (一)大类资产配置
 本基金将主要考虑:(1)宏观经济指标,包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等;(2)微观经济指标,包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等;(3)市场指标,包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等;(4)政策因素,包括财政、货币、产业政策及其他与证券市场密切相关的各种政策。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

选择航天军工装备安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
 第一,将本空间中过去一年日均成交金额排名在后20%的股票剔除。第二,根据本基金航天军工装备安全相关上市公司的高频选进备选基金股票池。第三,对备选航天军工装备安全相关上市公司,具体从公司成本状况和股票估值两个方面进行筛选。
 1)公司成本状况分析
 A.经营状况分析
 对于航天军工装备安全相关概念上市公司,将重点关注:业绩成长性、技术密集、附加值高、成长空间,主要通过分析公司的研发投入、经营模式、公司治理、行业整合等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。
 B.财务状况分析
 本基金重点关注上市公司盈利能力、成长和股本扩张能力、持续经营能力、杠杆水平以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。
 2)股票估值分析
 通过对内估值、相对估值、收益价值等方面的研究,考察市盈率增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、自由现金流/市值(DCF)、市值/未来市场预期溢价等一系列估值指标,给出股票综合评价,从中选择估值水平相对合理的公司。
 本基金将结合公司状况以及股票估值分析的基本结论,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整航天军工装备安全相关主题股票池。基金管理人将根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
 (四)债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
 本基金通过分析和未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券收益率水平、信用风险、流动性等因素,构建债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
 (五)股指期货投资策略
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

选择航天军工装备安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
 第一,将本空间中过去一年日均成交金额排名在后20%的股票剔除。第二,根据本基金航天军工装备安全相关上市公司的高频选进备选基金股票池。第三,对备选航天军工装备安全相关上市公司,具体从公司成本状况和股票估值两个方面进行筛选。
 1)公司成本状况分析
 A.经营状况分析
 对于航天军工装备安全相关概念上市公司,将重点关注:业绩成长性、技术密集、附加值高、成长空间,主要通过分析公司的研发投入、经营模式、公司治理、行业整合等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。
 B.财务状况分析
 本基金重点关注上市公司盈利能力、成长和股本扩张能力、持续经营能力、杠杆水平以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。
 2)股票估值分析
 通过对内估值、相对估值、收益价值等方面的研究,考察市盈率增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、自由现金流/市值(DCF)、市值/未来市场预期溢价等一系列估值指标,给出股票综合评价,从中选择估值水平相对合理的公司。
 本基金将结合公司状况以及股票估值分析的基本结论,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整航天军工装备安全相关主题股票池。基金管理人将根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
 (四)债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
 本基金通过分析和未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券收益率水平、信用风险、流动性等因素,构建债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
 (五)股指期货投资策略
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

选择航天军工装备安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
 第一,将本空间中过去一年日均成交金额排名在后20%的股票剔除。第二,根据本基金航天军工装备安全相关上市公司的高频选进备选基金股票池。第三,对备选航天军工装备安全相关上市公司,具体从公司成本状况和股票估值两个方面进行筛选。
 1)公司成本状况分析
 A.经营状况分析
 对于航天军工装备安全相关概念上市公司,将重点关注:业绩成长性、技术密集、附加值高、成长空间,主要通过分析公司的研发投入、经营模式、公司治理、行业整合等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。
 B.财务状况分析
 本基金重点关注上市公司盈利能力、成长和股本扩张能力、持续经营能力、杠杆水平以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。
 2)股票估值分析
 通过对内估值、相对估值、收益价值等方面的研究,考察市盈率增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、自由现金流/市值(DCF)、市值/未来市场预期溢价等一系列估值指标,给出股票综合评价,从中选择估值水平相对合理的公司。
 本基金将结合公司状况以及股票估值分析的基本结论,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整航天军工装备安全相关主题股票池。基金管理人将根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
 (四)债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
 本基金通过分析和未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券收益率水平、信用风险、流动性等因素,构建债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
 (五)股指期货投资策略
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

选择航天军工装备安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
 第一,将本空间中过去一年日均成交金额排名在后20%的股票剔除。第二,根据本基金航天军工装备安全相关上市公司的高频选进备选基金股票池。第三,对备选航天军工装备安全相关上市公司,具体从公司成本状况和股票估值两个方面进行筛选。
 1)公司成本状况分析
 A.经营状况分析
 对于航天军工装备安全相关概念上市公司,将重点关注:业绩成长性、技术密集、附加值高、成长空间,主要通过分析公司的研发投入、经营模式、公司治理、行业整合等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。
 B.财务状况分析
 本基金重点关注上市公司盈利能力、成长和股本扩张能力、持续经营能力、杠杆水平以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。
 2)股票估值分析
 通过对内估值、相对估值、收益价值等方面的研究,考察市盈率增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、自由现金流/市值(DCF)、市值/未来市场预期溢价等一系列估值指标,给出股票综合评价,从中选择估值水平相对合理的公司。
 本基金将结合公司状况以及股票估值分析的基本结论,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整航天军工装备安全相关主题股票池。基金管理人将根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
 (四)债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
 本基金通过分析和未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券收益率水平、信用风险、流动性等因素,构建债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
 (五)股指期货投资策略
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

选择航天军工装备安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
 第一,将本空间中过去一年日均成交金额排名在后20%的股票剔除。第二,根据本基金航天军工装备安全相关上市公司的高频选进备选基金股票池。第三,对备选航天军工装备安全相关上市公司,具体从公司成本状况和股票估值两个方面进行筛选。
 1)公司成本状况分析
 A.经营状况分析
 对于航天军工装备安全相关概念上市公司,将重点关注:业绩成长性、技术密集、附加值高、成长空间,主要通过分析公司的研发投入、经营模式、公司治理、行业整合等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。
 B.财务状况分析
 本基金重点关注上市公司盈利能力、成长和股本扩张能力、持续经营能力、杠杆水平以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。
 2)股票估值分析
 通过对内估值、相对估值、收益价值等方面的研究,考察市盈率增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、自由现金流/市值(DCF)、市值/未来市场预期溢价等一系列估值指标,给出股票综合评价,从中选择估值水平相对合理的公司。
 本基金将结合公司状况以及股票估值分析的基本结论,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整航天军工装备安全相关主题股票池。基金管理人将根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
 (四)债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
 本基金通过分析和未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券收益率水平、信用风险、流动性等因素,构建债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
 (五)股指期货投资策略
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

选择航天军工装备安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
 第一,将本空间中过去一年日均成交金额排名在后20%的股票剔除。第二,根据本基金航天军工装备安全相关上市公司的高频选进备选基金股票池。第三,对备选航天军工装备安全相关上市公司,具体从公司成本状况和股票估值两个方面进行筛选。
 1)公司成本状况分析
 A.经营状况分析
 对于航天军工装备安全相关概念上市公司,将重点关注:业绩成长性、技术密集、附加值高、成长空间,主要通过分析公司的研发投入、经营模式、公司治理、行业整合等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。
 B.财务状况分析
 本基金重点关注上市公司盈利能力、成长和股本扩张能力、持续经营能力、杠杆水平以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。
 2)股票估值分析
 通过对内估值、相对估值、收益价值等方面的研究,考察市盈率增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、自由现金流/市值(DCF)、市值/未来市场预期溢价等一系列估值指标,给出股票综合评价,从中选择估值水平相对合理的公司。
 本基金将结合公司状况以及股票估值分析的基本结论,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整航天军工装备安全相关主题股票池。基金管理人将根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
 (四)债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
 本基金通过分析和未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券收益率水平、信用风险、流动性等因素,构建债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
 (五)股指期货投资策略
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

选择航天军工装备安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
 第一,将本空间中过去一年日均成交金额排名在后20%的股票剔除。第二,根据本基金航天军工装备安全相关上市公司的高频选进备选基金股票池。第三,对备选航天军工装备安全相关上市公司,具体从公司成本状况和股票估值两个方面进行筛选。
 1)公司成本状况分析
 A.经营状况分析
 对于航天军工装备安全相关概念上市公司,将重点关注:业绩成长性、技术密集、附加值高、成长空间,主要通过分析公司的研发投入、经营模式、公司治理、行业整合等多方面的运营管理能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。
 B.财务状况分析
 本基金重点关注上市公司盈利能力、成长和股本扩张能力、持续经营能力、杠杆水平以及现金流管理水平,选择优良财务状况的上市公司股票。
 2)股票估值分析
 通过对内估值、相对估值、收益价值等方面的研究,考察市盈率增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、自由现金流/市值(DCF)、市值/未来市场预期溢价等一系列估值指标,给出股票综合评价,从中选择估值水平相对合理的公司。
 本基金将结合公司状况以及股票估值分析的基本结论,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整航天军工装备安全相关主题股票池。基金管理人将根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
 (四)债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
 本基金通过分析和未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券收益率水平、信用风险、流动性等因素,构建债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
 (五)股指期货投资策略
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将以套期保值和锁定价值为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货投资操作,利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场下行期间做空套保,通过股指期货对冲降低投资组合仓位,从而调整投资组合的风险敞口,规避市场系统性风险,改善组合的风险收益特征;并在市场快速向上时适当增加仓位。
 本基金将结合深入分析上述指标与深入、动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产的分配比例,控制市场风险,提高资产配置效率。
 (二)航天军工装备安全相关上市公司股票投资策略
 本基金管理人界定,航天军工装备安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空航天装备、航天装备、轨道交通装备、海洋工程装备及安全装备5个重点领域,具体如下:
 1.航天装备:包括航天制造、发射、应用等相关产业的个股;
 2.航空装备:包括民用航空、军用航空、通用航空及航空配件研制生产等相关产业的个股;
 3.轨道交通装备:包括铁路机车车辆各种设备及配件、服务等相关产业的个股;
 4.海洋工程装备:包括海洋工程装备制造及海洋工程、海洋油气开发服务等致力于海洋经济发展的个股;
 5.信息安全装备:包括为城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等以社会和网络稳定为目标提供设备及服务的个股。
 如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金航天军工装备安全相关上市公司行业范围的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对相关行业和股票池进行补充和修订。
 (三)股票投资策略
 本基金将结合定性定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	280,579,764.03	76.10
2	固定收益投资	280,579,764.03	76.10
3	货币资金	-	-
4	应收款项	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	86,710,232.42	23.52
7	其他负债	1,414,034.40	0.38
8	合计	368,704,019.85	100.00

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	-	-
C	制造业	240,556,909.25	70.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	金融业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	房地产业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,240,386.28	8.02
J	综合	12,782,468.50	3.76

代码	名称	持仓量(股)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	风险敞口
000001	平安银行	-	-	-	0.00
000002	万科A	-	-	-	0.00
000003	深发展A	-	-	-	0.00
000004	浦发银行	-	-	-	0.00
000005	民生银行	-	-	-	0.00
000006	招商银行	-	-	-	0.00
000007	中信银行	-	-	-	0.00
000008	华夏银行	-	-	-	0.00
000009	光大银行	-	-	-	0.00
000010	工商银行	-	-	-	0.00
000011	建设银行	-	-	-	0.00
000012	农业银行	-	-	-	0.00
000013	交通银行	-	-	-	0.00
000014	中信证券	-	-	-	0.00
000015	华泰证券	-	-	-	0.00
000016	招商证券	-	-	-	0.00
000017	广发证券	-	-	-	0.00
000018	中信建投	-	-	-	0.00
000019	国信证券	-	-	-	0.00
000020	海通证券	-	-	-	0.00
000021	东方证券	-	-	-	0.00
000022	国泰君安	-	-	-	0.00
000023	兴业证券	-	-	-	0.00
000024	光大证券	-	-	-	0.00
000025	华林证券	-	-	-	0.00
000026	国都证券	-	-	-	0.00
000027	首创证券	-	-	-	0.00
000028	中信证券	-	-	-	0.00
000029	中信证券	-	-	-	0.00
000030	中信证券	-	-	-	0.00
000031	中信证券	-	-	-	0.00
000032	中信证券	-	-	-	0.00
000033	中信证券	-	-	-	0.00
000034	中信证券	-	-	-	0.00
000035	中信证券	-	-	-	0.00
000036	中信证券	-	-	-	0.00
000037	中信证券	-	-	-	0.00
000038	中信证券	-	-	-	0.00
000039	中信证券	-	-	-	0.00
000040	中信证券	-	-	-	0.00
000041	中信证券	-	-	-	0.00
000042	中信证券	-	-	-	0.00
000043	中信证券	-	-	-	0.00
000044	中信证券	-	-	-	0.00
000045	中信证券	-	-	-	0.00
000046	中信证券	-	-	-	0.00
000047	中信证券	-	-	-	0.00
000048					