

(上接 B63 版)

3. 跟踪投资策略  
本基金将严格执行制度化的风控流程, 通过基金资产配置、行业配置、个股选择等策略, 结合定量与定性分析, 充分发掘研究驱动型个股的投资机会, 力争实现超越业绩基准的投资收益。

4. 风险控制策略  
本基金风控的核心理念为事前防范, 资产配置以稳健型为主, 追求合理的估值水平, 以主动的科学投资策略为主线, 充分考量个股的收益性、流动性及风险收益特征, 通过资产配置、行业配置、个股选择, 追求与基金风险相匹配的基金投资收益。

九、基金业绩比较基准  
中证综合价格指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布, 其指数样本涵盖国内政策银行、商业银行、证券公司、中期票据以及证券公司短期融资券等债券品种, 综合反映了债券市场整体的价格变动情况。目前市场上较权威的反映债券市场整体走势的指数之一, 该指数透明、公开, 具有较好的市场接受度, 作为衡量本基金债券投资部分业绩的比较基准, 较为合适。

本基金管理人将根据市场环境变化, 或者今后法律法规发生变化, 又或者市场出现更具权威、更能代表本基金风险收益特征的指数, 则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后, 调整或变更本基金的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。

十、基金的风险收益特征  
本基金是一只债券基金, 其风险与预期收益高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金, 属于证券投资基金中中等风险的品种。

十一、基金的投资组合情况  
本基金管理人的董事会及董事承诺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法律责任。  
本基金管理人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定, 于 2018 年 1 月 19 日复核了本报告中财务指标、资产负债表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。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	4,161,348.00	7.94
	其中: 股票	4,161,348.00	7.94
2	固定收益投资	42,825,989.00	81.70
	其中: 债券	42,825,989.00	81.70
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,400,000.00	2.67
6	应收利息	2,518,858.54	4.81
7	其他资产	1,509,271.09	2.88
8	合计	52,415,466.63	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、渔业	-	-
B	采矿业	517,588.00	1.00
C	制造业	1,873,000.00	3.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	729,120.00	1.41
J	金融业	1,041,600.00	2.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	医药制造业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、航空航天制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,161,348.00	8.02

3. 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

本基金本报告期末未有港股投资股票投资组合。

4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	600885	宝硕股份	33,800	1,813,750.00	2.64
2	601798	上海医药	168,000	1,041,600.00	2.01
3	002410	广联达	37,200	729,120.00	1.41
4	600947	山东黄金	16,600	517,588.00	1.00
5	002035	华谊兄弟	16,500	491,280.00	0.95

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	018065	国债 1701	190,800	18,873,156.50	36.39
2	179934	17国债 01	100,000	9,833,000.00	18.96
3	018063	国债 01	50,500	4,849,051.50	9.35
4	180861	国债 1703	42,000	4,130,760.00	8.08
5	018067	21国债 07	33,900	3,407,901.00	6.57

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未有权证。

9. 投资组合报告附注  
(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 且本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未发生公开谴责和处罚。  
(2) 本基金投资的前十名证券中, 没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。  
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,237.40
2	应收证券清算款	520,360.00
3	应收股利	-
4	应收利息	900,639.86
5	应收中融款	5,693.74
6	预收款项	-
7	应付账款	-
8	其他	-
9	合计	1,509,271.09

(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。

(5) 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在受争议情况的说明。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述性信息  
由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩  
本基金管理人承诺以诚实信用、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, 也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表其未来表现, 投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于下列所列数字。

1. 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-3.54%	0.26%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.41%	0.26%	-1.67%	0.09%	-1.76%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	2.06%

(2) 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数

阶段	业绩比较基准收益率①	基金份额净值增长率②	①-②	③	④
过去三个月	10.09%	10.28%	-1.19%	0.06%	0.17%
2017年度	-4.03%	0.28%	-3.39%	0.06%	0.26%
2016年度	-3.85%	0.28%	-1.67%	0.09%	-2.28%
2015年度	20.50%	0.34%	4.18%	0.08%	16.40%
2014年度(自基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日)	7.58%	0.30%	5.72%	0.11%	1.86%

注: 本基金自成立以来基金业绩比较基准有效运作 6 个月。截至建仓期末, 本基金各项资产配置比例符合基金合同约定且符合投资比例约定。

2. 业绩比较基准: 中证综合价格指数