

万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第2号)

基金管理人: 万家基金管理有限公司 基金托管人: 招商银行股份有限公司

二零一八年十一月

重要提示
万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2016年8月30日经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1980号文注册募集。基金合同生效日期为2017年3月30日。

2018年3月24日,基金管理人按照中国证监会《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》(2017)12号)的要求对基金合同的部分内容进行了修订,修订后的法律文件自2018年3月31日起正式生效。

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投资价值、市场前景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,投资有风险,投资者在投资本基金前,请认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,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,自主判断基金的投资价值,对认购(或申购)基金的意思、时机、数量及投资行为作出独立决策,承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险;个别证券特有的非系统性风险;大量赎回或暴跌导致的流动性风险;基金投资过程中产生的操作风险;因交易对手违约和债券违约引发的信用风险;基金投资回报可能低于业绩比较基准的风险;本基金投资范围包括国债、期权等金融衍生品,证券公司短期公司债券,中小企业私募债券等品种,可能给本基金带来额外风险等。本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特殊风险详见本招募说明书“风险揭示”部分。

本基金为混合型基金,理论上其预期风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金净值状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。此外,本基金以1.00元初始面值进行募集,在市场波动等因素的影响下,存在单位份额净值跌破1.00元初始面值的风险。

基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高收益,也有可能损失本金。投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年9月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2018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B2(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B2(名义楼层9层)
法定代表人: 方一天
成立日期: 2002年8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]144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: 021-38099262 传真: 021-38099027
二、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, 本科学历, 学士学位, 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月起任董事, 2015年2月至2016年7月任公司总经理, 2015年7月起任公司董事长。
董事马永春先生, 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副总经理, 新疆对外经贸集团总经理, 新疆山鹰纸业股份有限公司高级顾问。
董事李俊峰先生, 中共党员, 研究生, 工商管理学硕士, 曾任宝钢集团财务部部长, 副部长, 中泰证券股份有限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。
董事纪晓云女士, 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营销部经理, 上海证券有限责任公司经营管理总部副总经理、总经理, 上海股权托管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, 任董事、总经理。
独立董事黄寅先生, 中国民主建国会会员, 经济学博士, 教授, 曾任贵州财经大学财政金融系主任, 山东财经大学经济学院教授, 山东省政协常委, 现任山东财经大学齐鲁金融研究中心主任, 山东金融产业优化与区域管理研究中心副主任, 山东省人大常委会, 山东省人大常委会财经委员会常委, 教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。
独立董事张永强先生, 经济学博士, 曾任上海佳佳饲料厂员工, 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, 兴业证券有限责任公司副经理, 上海证券有限责任公司副经理, 海证期货有限公司董事长, 兴业证券有限责任公司董事, 现任玖玖投资(集团)有限公司董事局副主席。
独立董事李小明先生, 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
监事会主席李润刚先生, 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经理, 公司投行部项目经理, 新疆国际实业股份有限公司证券事务代表、副总经理, 现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书。
监事张浩先生, 中共党员, 管理学博士, 先后任职于山东银亿投资管理有限公司, 山东省国有资产控股有限公司, 巨能资本管理有限公司, 现任巨能资产管理有限责任公司董事长。
监事李海女士, 中共党员, 硕士, 中级经济师, 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10月加入本公司, 曾任公司综合管理部副经理, 现任公司总经理助理。
监事尹丽雯女士, 中共党员, 硕士, 先后任职于申银万国期货有限公司, 东海期货有限责任公司, 万家共赢资产管理有限公司, 2017年4月起加入本公司, 现任公司总经理助理。
监事陈广平先生, 中共党员, 学士学位, 先后任职于苏州对外贸易有限公司, 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, 现任公司助理经理、基金运营部总监、交易部总监。
3. 基金管理人高级管理人员
董事长: 方一天先生(简历请见基金管理人董事会成员)
总经理: 纪晓云女士(简历请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、机构业务开发等工作; 2003年至2007年任职于兴证证券, 从事资产管理工作; 2007年至2011年任职于中泰证券, 任营业部高级经理、总经理等职务。2011年加入本公司, 曾任综合管理部总监、总经理助理, 2013年1月起任公司副总经理。
副总经理: 黄海先生, 硕士研究生。先后在上海德福投资有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司、华信信托有限责任公司、中银国际证券有限责任公司任职, 历任项目经理、研究员, 投资助理, 投资总监等职务。2015年4月加入万家基金管理有限公司任资产管理部负责人, 负责专户投资管理等工作, 2017年4月任公司副总经理。
副总经理: 沈芳女士, 经济学博士。历任东亚银行上海经济研究中心主任, 富国基金管理有限公司资产管理部高级经理, 长江养老保险股份有限公司大客户部副经理及综合工作, 汇添富基金管理有限公司战略发展部总监, 华融基金管理有限公司筹备组副组长, 担任任公司副总经理, 协助保险资产登记交易系统有限公司运营管理委员会副主任职务。2018年7月加入万家基金管理有限公司, 2018年10月起任公司副总经理。
督察长: 兰剑先生, 法学学士, 律师, 注册会计师, 曾在江苏淮安安知律师事务所、上海和华利律师事务所从事律师工作, 2005年10月加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
助理: 投资研究部总监, MBA, 2010年进入财富证券有限责任公司, 任分析师, 投资助理助理, 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月加入万家基金管理有限公司, 现任万家和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、万家新兴蓝筹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、万家宏观择时多策略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、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
5. 投资决策委员会成员
(1) 权益与组合投资决策委员会
主任: 方一天
副主任: 黄海
委员: 李杰、黄海波、苏泽东、徐朝凯、陈旭、李文英、高源
方一天先生, 董事长。
黄海先生, 副总经理, 投资研究部总监, 基金经理。
李杰先生, 副总经理。
黄海波先生, 总经理助理, 投资研究部总监, 基金经理。
苏泽东先生, 固定收益部总监, 基金经理。
徐朝凯先生, 国际业务部总监, 组合投资部总监, 基金经理。
陈旭先生, 量化投资部副总监, 基金经理。
李文英女士, 基金经理。
高源女士, 基金经理。
(2) 固定收益投资决策委员会
主任: 方一天
委员: 陈广平、黄海波、苏泽东
方一天先生, 董事长。
陈广平先生, 总经理助理, 基金运营部总监、交易部总监。
黄海波先生, 总经理助理, 投资研究部总监, 基金经理。
苏泽东先生, 固定收益部总监, 基金经理。
6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

国内第一只券商集合资产管理计划, 第一只FOF, 第一只信托计划, 第一只股权私募基金, 第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账, 第一只境外银行QDII基金, 第一只和ETF基金, 第一只“1+N”基金专户理财, 第一家大小非解禁资产, 第一单TOT理财, 实现从单一托管服务向全面投资者服务机构的转变, 得到了业界的认可。
招商银行资产管理业务持续稳健发展, 社会影响力不断提升, 四度蝉联《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣获《财资》“中国最佳托管银行”, 成为国内唯一获得该奖项的托管银行。“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融创新奖”, 7月荣获2016年中国资产管理《金贝奖》“最佳托管银行”, 2017年6月再度荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”, “多功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融创新奖”, 8月荣获国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国最佳托管银行奖”, 2018年1月获得“第八届国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国最佳托管银行奖”, 2018年6月荣获“2017年度最佳托管银行”、“2017年度优秀资产管理机构”奖项, 同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖, 以及中央金融工委、全国金融期货第五届“双提升”金点子方案一等奖; 3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖, 5月荣获国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。
(二) 主要人员情况
李建红先生, 本行董事长, 非执行董事, 2014年7月起担任本行董事、董事长。美国东俄大学工商管理硕士, 吉林大学经济管理专业硕士, 高级经济师。招商银行原董事长, 兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国金融期货交易所(集团)理事长及他国中国投资会核准上市公司、中国金融期货交易所(集团)董事长、曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、副总裁, 招商局集团有限公司董事、总裁。
田惠宇先生, 本行行长, 执行董事, 2013年5月起担任本行行长, 本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位, 高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。
王良先生, 本行副行长, 货币银行学硕士, 高级经济师。1991年至1995年, 在中国科技国际信托投资公司工作; 1995年6月至2001年10月, 历任招商银行北京分行副行长, 广东、北京分行行长助理, 副行长, 行长, 北京分行风险控制部总经理; 2001年10月至2003年3月, 任北京分行行长助理, 副行长; 2006年3月至2008年6月, 任北京分行党委书记, 副行长(主持工作); 2008年6月至2012年6月, 任北京分行行长, 党委书记; 2012年6月至2013年11月, 任招商银行总行行长助理兼北京分行行长, 党委书记; 2013年11月至2014年12月, 任招商银行总行行长助理; 2015年1月起担任本行副行长; 2016年11月起担任本行董事兼首席。
姜然女士, 招商银行资产管理部总经理, 大学本科学历, 具有基金托管人高级管理人员任职资格, 先后供职于中国农业银行黑龙江分行, 中国工商银行深圳市分行, 中国工商银行总行, 担任信贷管理、托管等工作。2002年9月加盟招商银行至今, 历任招商银行总行资产管理部高级经理, 高级经理, 助理经理等职。是国内首批推出网上托管银行的主要设计、开发者之一, 具有20余年信贷管理、托管及丰富的托管实践经验。服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域均有深入的研究和丰富的实操经验。
(三) 基金托管业务资格情况
截至2018年6月30日, 招商银行股份有限公司累计托管3891只开放式基金。

第三部分 相关服务机构

一、基金发售代理机构
1. 直销机构
基金直销机构为万家基金管理有限公司以及该公司的电子直销系统(网站、微信交易)。住所: 办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号B2(名义楼层9层)
法定代表人: 方一天
联系人: 尹雷
电话: 021-38090977
传真: 021-38090788
客户服务专线: 400-888-0800/955386
投资者可以通过基金管理人电子直销系统(网站、微信交易)办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务, 具体交易规则请查阅基金管理人网站公告。
网上交易网站: <http://fund.wjfund.com/>
网上交易网站: <http://trade.wjnet.com/>
微信交易: http://wjfund_wx/
2. 非直销销售机构
(1) 招商银行股份有限公司
客服电话: 95555
网址: <http://www.cmbchina.com/>
(2) 中国农业银行股份有限公司
客服电话: 95599
网址: <http://www.abchina.com/>
(3) 中国银行股份有限公司
客服电话: 95566
网址: <http://www.boc.cn/>
(4) 中国民生银行股份有限公司
客服电话: 95568
网址: <http://www.cmbc.com.cn/>
(5) 泉州银行股份有限公司
客服电话: 400-889-6123
(6) 中国光大银行股份有限公司
客服电话: 95588
(7) 中信银行股份有限公司
客服电话: 95558
网址: <http://www.citic.com/>
(8) 中信证券(山东)有限公司
客服电话: 400-990-8262
网址: <http://www.citics.com/>
(9) 华泰证券股份有限公司
客服电话: 0755-82583788
网址: <http://www.htsc.com.cn/>
(10) 上海证券有限责任公司
客服电话: 400-891-8918
网址: <http://www.962518.com/>
(11) 中国建投证券股份有限公司
客服电话: 95587或400-188-8108
网址: <http://www.csc.com.cn/>
(12) 中信证券(上海)有限公司
客服电话: 95558
网址: <http://www.citics.com/>
(13) 中信期货有限公司
客服电话: 400-990-8262
网址: <http://www.citics.com/>
(14) 信达证券股份有限公司
客服电话: 95321
网址: <http://www.cindas.com/>
(15) 东吴证券股份有限公司
客服电话: 400-860-1555
网址: <http://www.dwjg.com/>
(16) 华安证券股份有限公司
客服电话: 400-889-8888
网址: <http://www.hahg.com/>
(17) 东吴证券股份有限公司
客服电话: 400-888-8888
网址: <http://www.jongtong.com/>
(18) 中国国际金融有限公司
客服电话: 400-910-1166
网址: <http://www.cicc.com.cn/>
(19) 国泰君安证券股份有限公司
客服电话: 400-888-8666
网址: <http://www.gtja.com/>
(20) 申万宏源证券股份有限公司
客服电话: 95523或400-889-5523
网址: <http://www.swhyc.com/>
(21) 光大证券股份有限公司
客服电话: 400-888-8788
网址: <http://www.ebsc.com.cn/>
(22) 国金证券股份有限公司
客服电话: 95310
网址: <http://www.gqz.com.cn/>
(23) 招商证券股份有限公司
客服电话: 95565
(24) 中泰证券(山东)有限公司
客服电话: 95548
(25) 南京证券股份有限公司
客服电话: 95386
(26) 平安证券股份有限公司
客服电话: 95511
网址: <http://stock.pingan.com/>
(27) 申万宏源西部证券有限公司
客服电话: 021-33389888
网址: <http://www.swhyc.com/>
(28) 爱建证券有限责任公司
客服电话: 4001-962502
网址: <http://www.ajzq.com/>
(29) 中航证券股份有限公司
客服电话: 95355
网址: <http://www.avicsec.com/>
(30) 中泰证券(山东)有限公司
客服电话: 95542
(31) 国联证券股份有限公司
客服电话: 95570
网址: <http://www.glig.com.cn/>
(32) 中国银河证券股份有限公司
客服电话: 400-888-8888
网址: <http://www.chinastock.com.cn/>
(33) 中国国际信托有限公司
客服电话: 400-620-8888
网址: <http://www.bocicchina.com/>
(34) 华宝证券有限责任公司
客服电话: 4008290898
(35) 济安财富(北京)基金销售有限公司

客服电话: 400-673-7010
网站: <http://www.jianfengt.com/>
公司网站: <http://www.cmbchina.com/>
二、基金登记机构
名称: 中国证券登记结算有限责任公司
住所: 北京市西城区太平桥大街17号
电话: (010) 50938907
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
办公地址: 中国上海中银大厦80115、16层
负责人: 陈峰
经办律师: 夏川山、华涛
电话: (021) 5878 5888
传真: (021) 5878 4866
联系人: 华涛
四、审计会计师事务所
名称: 立信会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: 中国上海市南京东路670号新凯大厦4楼
办公地址: 中国上海市南京东路670号新凯大厦4楼四楼
联系电话: 021-63911166
传真: 021-63925588
联系人: 徐冬
经办注册会计师: 袁斌、徐冬、张阳

万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金类别: 混合型
基金运作方式: 契约型开放式
基金存续期限: 不定期

本基金在追求本金安全的基础上, 通过大类资产配置与个股选择, 采用数量化手段严格控制本基金的下行风险, 力争在减少波动的同时在有效时间内为投资者谋求资产的稳健增值。

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(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市)的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、证券公司短期融资债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、股指期货、期权以及法律法规和中国证监会允许基金投资的金融工具等。

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。

在法律法规允许的前提下, 本基金投资于期权等衍生品投资时, 管理人应就清算交收、核算估值、系统支持等各方面与托管人进行确认, 确保各项准备就绪, 方可投资。
本基金为混合型基金, 股票资产占基金资产的比例为0%-95%, 每个交易日日终扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金后, 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、权证、国债期货、股指期货、期权及其他金融工具; 本基金的投资策略依据法律法规及监管机构的相关规定执行。其中, 现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%, 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金资产净值以外的因素致使基金资产净值超过比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(2) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(3) 法律法规及中国证监会规定的《基金合同》约定的其他投资限制。
除上述第(2)、(13)、(2)、(24)项外, 因证券市场波动、证券发行和上市、合并规模变动等基金资产净值以外的因素致使基金资产净值比例超过上述比例限制的, 基金管理人应当在两个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。上述期间, 基金的投资组合比例可不符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。

2. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1) 承销证券;
(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;
(3) 从事承担无限责任的投资;
(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及任何其他不正当的证券交易活动;
(7) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他活动。
3. 管理人运用基金财产买卖股票、债券、期货、期权及结构化产品、投资衍生品或者与其有重大利害关系人的证券或者期货合约, 应当按照公平原则、防范利益冲突, 建立健全内部审批控制和评估机制, 按照市场公平价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易必须经基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事批准。基金管理人董事会应至少每年对关联交易事项进行审查。
4. 法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 则本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述限制取消或调整时, 如适用于本基金, 本基金可不受相关限制。

第十部分 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*50%+中证全指商品指数收益率*50%
沪深300指数是中国指数公司编制的沪深两市统一指数, 具有良好的市场代表性和市场影响力, 适合作为本基金股票投资的业绩基准。
中证全指商品指数是中国证监会编制的综合反映境内债券市场和深交所债券市场的市场情绪指数, 具有较高的代表性。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素, 本基金业绩比较基准设定为: 沪深300指数收益率*50%+中证全指商品指数收益率*50%
如果中证全指商品指数发生变更或停止沪深300指数编制的编制及发布, 或沪深300指数或中证全指商品指数由其他指数替代, 或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或中证全指商品指数不能真实反映本基金投资组合的业绩表现, 基金管理人有权变更业绩比较基准, 变更业绩比较基准的, 基金管理人可以依据相关法律法规的规定, 取得基金托管人同意后, 变更本基金的业绩比较基准。

第十一部分 基金的风险收益特征
本基金为混合型基金, 风险与收益高于债券型基金和货币市场基金, 属于较高风险、较高收益的品种。

第十二部分 基金的投资组合报告
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责任。
基金托管人中国招商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年7月18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止日为2018年6月30日, 本报告中所列数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	229,424,225.00	91.64
2	固定收益	229,424,225.00	91.64
3	银行存款	-	-
4	应收利息	-	-
5	其他资产	-	-
6	负债及或有负债	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	贵金属投资	-	-
9	股指期货投资	-	-
10	国债期货投资	-	-
11	期权投资	-	-
12	其他	-	-
13	合计	229,424,225.00	100.00

2) 报告期末按行业分类的股票投资组合
3) 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	医药生物	-	-
C	信息技术	15,879,268.7	6.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,935.00	0.03
E	制造业	25,944,274.30	10.45
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	16,622,107.38	6.76
J	房地产业	19,096,536.06	7.70
K	综合	34,642,107.38	14.13
L	国防军工	-	-
M	新材料	-	-
N	有色金属	79,295.00	0.03
O	轻工、纺织	2,382,125.00	0.97
P	医药生物	81,226.41	0.03
Q	食品饮料	-	-
R	公用事业	-	-
S	其他	-	-
T	合计	229,424,225.00	92.45

2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
3) 报告期末按行业分类的深港通投资股票投资组合

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	600116	华信国际	782,405	24,231,020.90	9.76
2	600888	海航控股	1,528,480	22,407,268.00	9.03
3	600066	长城证券	2,220,800	20,795,622.00	8.46
4	002179	汇创世纪	1,070,057	20,535,985.45	8.28
5	002416	爱建集团	2,248,348	19,620,074.00	7.81
6	601040	华安证券	748,174	19,200,480.00	7.76
7	600883	海通证券	1,284,276	18,311,076.23	7.31
8	600984	华资实业	2,382,125	13,866,020.75	5.60
9	600002	招商证券	1,282,125	13,866,020.75	5.60
10	600997	开 元	530,143	13,043,537.00	5.26
11	600192	华彬集团	995,715	11,860,277.00	4.78

4) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000115	国债0115	782,405	24,231,020.90	9.76
2	000116	国债0116	1,528,480	22,407,268.00	9.03
3	000117	国债0117	2,220,800	20,795,622.00	8.46
4	000118	国债0118	1,070,057	20,535,985.45	8.28
5	000119	国债0119	2,248,348	19,620,074.00	7.81
6	000120	国债0120	748,174	19,200,480.00	7.76
7	000121	国债0121	1,284,276	18,311,076.23	7.31
8	000122	国债0122	2,382,125	13,866,020.75	5.60
9	000123	国债0123	1,282,125	13,866,020.75	5.60
10	000124	国债0124	530,143	13,043,537.00	5.26
11	000125	国债0125	995,715	11,860,277.00	4.78

5) 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	品种名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	782,405	24,231,020.90	9.76
2	金融债	1,528,480	22,407,268.00	9.03
3	企业债	2,220,800	20,795,622.00	8.46
4	可转债	1,070,057	20,535,985.45	8.28
5	其他	2,248,348	19,620,074.00	7.81
6	其他	748,174	19,200,480.00	7.76
7	其他	1,284,276	18,311,076.23	7.31
8	其他	2,382,125	13,866,020.75	5.60