汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2019年第1号）

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金的募集申请于【2015】年【12】月【14】日经中国证监会证监许可[2015]【2929】号文注册。

本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价值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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（以下简称“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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金除了投资于 A 股上市公司外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。同时，本基金名为“沪港深”基金，基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并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，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书（更新）已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2019年1月8日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

第一部分　基金管理人

一、基金管理人概况

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

法定代表人：杨小勇

设立时间：2005年11月16日

联系人：周慧

电话：021－20376868

公司的股权结构如下：

山西信托股份有限公司（以下简称“山西信托”）持有51%的股权，HSBC Global Asset Management（UK）Limited（汇丰环球投资管理（英国）有限公司）持有49%的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员

杨小勇先生，董事长，硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资（集团）公司副总经理、山西光信实业有限公司副董事长、山西省国信投资（集团）公司党委书记、山西信托副董事长、晋商银行股份有限公司党委副书记、副行长（正职待遇）、现任山西金融投资控股集团有限公司专职党委副书记、副总经理（正职待遇）。

郭晋普先生，董事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司房地产开发部、投资实业总部副总经理、太原万丰房地产发展有限公司总经理、山西国际贸易中心有限公司总经理、董事长、山西信托董事长、山西国信投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

柴宏杰先生，董事、本科学历。曾任长治银监分局办公室主任、党委办公室主任，晋商银行股份有限公司董事会办公室主任、大同分行行长，山西省国信投资（集团）公司董事会办公室主任兼党委办公室主任、中合盛资本管理有限公司董事、董事长，山西国信投资集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理，山西金融投资控股集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理。现任山西省国有资本投资运营有限公司总经理助理兼资本运营部负责人。

李选进先生，董事，硕士学历。曾任怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监、汇丰投资管理（香港）董事兼亚太区全业拓展及中国事业主管，汇丰晋信基金管理有限公司总经理、董事。现任汇丰中华证券投资信托股份有限公司董事长。

巴培卓（Pedro Augusto Botelho Bastos）先生，董事。曾任汇丰环球投资管理（巴西）行政总裁、汇丰环球投资管理（拉丁美洲）首席投资官、行政总裁。现任汇丰环球投资管理亚太行政总裁。

王栋先生，董事。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理。

常修泽先生，独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长，国家发改委经济研究所常务副所长、教授、博士研究生导师。现任清华大学中国经济研究中心研究员。

梅建平先生，独立董事，博士学历。曾任纽约大学金融学副教授、芝加哥大学访问副教授、阿姆斯特丹大学访问副教授、清华大学特聘教授、长江商学院EMBA项目副院长。现任长江商学院金融学教授。

叶迪奇先生，独立董事，硕士学历。曾担任汇丰银行(美国)西岸业务副总裁，汇丰银行(香港)零售部主管、汇丰银行中国总代表处中国业务总裁、交通银行副行长、国际金融协会(IIF)亚太区首席代表、现任星展银行(香港)有限公司独立董事。

2、基金管理人监事会成员

焦杨先生，监事，硕士学历。曾任山西信托副总经理兼资金管理部经理，常务副总经理，山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理。现任山西金融投资控股集团有限公司运营总监兼资本运营部总经理，山西证券股份有限公司监事会主席，山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席。

廖宜建、监事，本科学历。曾任联于日本兴业银行（现为瑞穗国际），1997 年加入汇丰负责大中华区及新加坡的本地外汇、利率及债券市场业务，后先后担任汇丰中国地区司库、汇丰中国环球银行及资本市场总监、汇丰银行（中国）有限公司副行长。现任汇丰银行（中国）有限公司行长兼行政总裁。

曹菁女士，监事，硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理，汇丰晋信基金管理有限公司人事经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

侯玉琦先生，监事，硕士学历。曾任山西信托及山西省国信投资（集团）公司担任交易员及投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员，现任汇丰晋信基金管理有限公司股票基金经理。

3、基金管理人高级管理人员

王栋先生，总经理，硕士学历。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。

闫太平先生，副总经理，本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托副处长、国际金融部经理。

王立荣先生，副总经理，硕士学历。曾任山西信托固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监；上海万方投资管理有限公司副总经理；汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

赵琳女士，副总经理，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金注册部副总监；中银基金管理有限公司基金运营部总监；汇丰晋信基金管理有限公司基金运营部总监；现任汇丰晋信基金管理有限公司首席运营官。

张毅杰先生，副总经理，硕士学历。曾任招商基金管理有限公司华东业务发展经理、天同基金管理有限公司机构理财部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、直销业务总监。

古韵女士，督察长，硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理，国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

4、本基金基金经理

程诚先生，加拿大英属哥伦比亚大学国际工商管理硕士。曾任坎马威会计师事务所担任助理审计经理、摩根士丹利资地产基金投资经理、汇丰晋信基金管理有限公司国际业务部副总监，现为汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金基金经理兼国际业务部总监。

本基金历任基金经理：曹庆先生，于2016年11月10日至2018年8月31日期间，曾管理本基金。

5、投资决策委员会成员

王栋，总经理；郑宇尘，投资部总监；基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分　基金托管人

一、基金托管人基本情况

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：彭纯

住　　所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：陆志俊

电　话：95559

第三部分　相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

汇丰晋信基金管理有限公司投资理财中心

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

电话：021－20376868

传真：021－20376989

客户服务中心电话：021－20376888

公司网址：www.hsbcjt.cn

2、其他销售机构

■　交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人：彭纯

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：王菁

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

■　中国建设银行股份有限公司（仅代销本基金A类份额）

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

■　汇丰银行（中国）有限公司（仅代销本基金A类份额）

注册地址：上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层

办公地址：上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层

法定代表人：廖宜建

公司网站：www.hsbc.com.cn

客服电话：卓越理财客户　800－820－8828（限中国内地固话）

(+86)－(21)－3888　8828（适用于境外或移动电话）

远海理财客户　800－820－8878（限中国内地固话）

(+86)－(21)－3888　8878（适用于境外或移动电话）

非汇丰个人客户800－830－2880（限中国内地固话）

(+86)－(21)－3888　3015（适用于境外或移动电话）

■　恒生银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦34楼、36楼及上海浦东南路528号证券大厦27楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦34楼、36楼及上海浦东南路528号证券大厦27楼

法定代表人：李慧敏

公司网站：www.hangseng.com.cn

客服电话：8008308008/4008308008

■　招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：秦晓

电话：（0755）83195834，82090060

传真：（0755）83195049，82090817

联系人：刘薇

客户服务热线：95555

网址：www.cmbchina.com

■　宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市中山东路294号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528（上海地区962528）

网址：www.nbcb.com.cn

■　渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道201－205号

办公地址：天津市河东区海河东路218号

法定代表人：李伏安

联络人：王宏

电话：022－58316666

传真：022－58316569

客服电话：95541

公司网址：www.cbhb.com.cn

■　上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路8号15－20楼、22－27楼

办公地址：上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：021－38576666

传真：021－50105124

客服电话：021－962999

公司网址：http://www.srcb.com

■　光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：　唐双宁

电话：010－68098778

传真：010－68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

■　中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

传真：（010）68858117

公司网址：www.psbc.com

■　山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351－8686703

传真：0351－8686619

客服电话：400－666－1618

网址：www.i618.com.cn

■　申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021－33389888

传真：021－33388224

客户服务电话：95523或4008895523

网址：www.swhysc.com

■　申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：李季

联系人：唐岚

电话：010－88085258

传真：010－88013605

■　中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：张佑君

电话：4008888108

传真：010－65182261

联系人：权唐

客户服务电话：400－8888－108(免长途费)

网址：http://www.csc108.com

■　光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘曌、李芳芳

电话：021－22169999

传真：021－22169134

客户服务电话：95525、10108998

网址：www.ebscn.com

■　国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16－26层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16－26层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755－82133066

传真：0755－82133302

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

■　国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城东路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

联系人：丙敏棋

联系电话：021－38676161

传真：021－38670161

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

■　中国银河证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

注册地址：北京市西城区金融大街35号2－6层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008－888－888或95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

■　招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层

办公地址：深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼

邮编：518033

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755－82943666

传真：0755－82943636客服电话：400－8888－111、95565

网址：www.newone.com.cn

■　兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

联系人：杨盛芳

电话：0591－87613888

传真：0591－87546058

客户服务电话：400－8888－123

网址：www.xyzq.com.cn

■　中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010－84683893

传真：010－84865560

客服电话：010－84588888

网址：www.cs.ecitic.com

■　中信证券（山东）有限责任公司

法定代表人：杨宝林

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

基金业务联系人：吴忠超

电话：0532－85022326

传真：0532－85022605

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

■　中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇　陈曦

客服电话：400　910　1166

公司网址：www.cicc.com.cn

■　华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼

法定代表人：周易

联系人：沈晓芸

电话：0755－82492193

传真：0755－82492962（深圳）

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

■　东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座12、15层

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010－66555316

传真：010－66555147

客户服务电话：4008888993

网址：www.dxzq.net

■　长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：021－68751929

联系人：李良

客户服务电话：95579

网址：www.95579.com

■　东海证券有限责任公司

注册地点：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18－19楼

法定代表人：朱科敏

联系人：汪江

公司网站：www.longone.com.cn

客服电话：400－8888－588

■　中泰证券股份有限公司

注册地点：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531－68889155

传真：0531－68889518

公司网站：www.zts.com.cn

客服电话：95538

■　安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755－82558305

传真：0755－82558355

客服电话：4008001001

公司网址：www.essences.com.cn

■　上海天天基金销售有限公司

注册地点：上海浦东新区峨山路613号6幢551室

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客户服务电话：400－1818－188

网址：www.1234567.com.cn

■　北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层

法定代表人：赵荣春

公司网站：www.qianjing.com

客服电话：400　893　6885

■　上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼

法定代表人：鲍东华

公司网站：www.lufunds.com

客服电话：4008219031

■　中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301－1305室、14层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301－1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩　钰

客服电话：400－990－8826

公司网站：www.citicsf.com

■　珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室－3491

法定代表人：肖雯

公司网站：www.yingmi.cn

客服电话：020－89629099

■　广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号

法定代表人：王继康

公司网站：www.grcbank.com

客服电话：95313

■　蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地点：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000766123

网址：www.fund123.cn

■　诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地点：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

法定代表人：汪静波

联系人：姚思轶

公司网站：www.noah-fund.com

客服电话：400－821－5399

■　平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16－20层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26楼

法定代表人：　曹实凡

联系人：　石静武

电话：021－38631117

传真：021－58991896

客服电话：95511－8

公司网址：stock.pingan.com

■　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号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座1108号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：400－619－9059/010－56251471

传真：010－62680827

公司网站：www.hcjjin.com

客服电话：400－619－9059

■　北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603－06

法定代表人：　江卉

电话：　4000988511/　4000888816

传真：　010－89188000

公司网站：fund.jd.com

客服电话：95118

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构的公告。

二、登记机构

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

法定代表人：杨小勇

联系人：赵琳

联系电话：021－20376892

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫峰

电话：021－31358666

传真：021－31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

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：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人/首席合伙人：杨绍信

联系电话：021－2323　8888

传真电话：021－2323　8800

经办注册会计师：薛雯、赵钰

联系人：赵钰

五、提供港股投资顾问服务的香港机构

名称：HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited

注册地址：香港中环皇后大道中1号香港上海汇丰银行总行大厦

办公地址：香港中环皇后大道中1号香港上海汇丰银行总行大厦

成立时间：1973年3月9日

管理证券资产规模（2017会计年度）：86,228百万美元

主要负责人：巴培卓（Pedro Augusto Botelho Bastos）

联系电话：(852)　2284　1111

第四部分　基金的名称

汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金

第五部分　基金的类型

股票型证券投资基金

第六部分　基金的投资目标

本基金把握港股通及后续资本市场开放政策带来的机会，挖掘A股及港股市场的优质公司，在控制风险的前提下精选个股，以追求超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分　基金的投资方向

本基金投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、国内依法发行上市的股票(含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，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80%－95%（投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0－95%），投资于权证的比例为基金资产净值的0－3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金依据法律法规的规定，本着谨慎和风险可控的原则，可参与创业板上市证券的投资。

在基金实际管理过程中，在法律法规有新规定的情况下，在履行适当程序后，基金管理人可对上述比例做适度调整。

第八部分　基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。

2、股票投资策略

（1）两地股票资产配置策略：

通过有效的资产配置(考虑国内与海外宏观经济、流动性、企业盈利、估值与A/H股价差、国际资本流动、动量指标、市场情绪、政府政策等因素)，动态调整两地股票资产的配置比例。

（2）个股精选策略

本基金对沪港深三市涵盖的上市公司采用“盈利性－估值指标”二维估值模型，并从公司治理结构等方面进行综合评价，以筛选出优质的上市公司。具体而言，主要考虑的因素包括：

1）“盈利性－估值指标”是一个二维的概念（毛利率、净利率、ROE等指标为代表的盈利性维度与PE、PB等指标为代表的估值维度），其分别反映公司的盈利能力和估值水平。基金管理人力求在这两个维度中选出高盈利性下具有低估值属性的投资标的。在实际投资操作中，本基金并不拘泥于参照单一指标，而是将综合考虑上市公司的基本面后，最大程度地筛选出具有持续投资价值的上市公司。

2）公司治理结构：公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定公司盈利能力能否持续的重要因素。在国内上市公司较普遍存在治理结构缺陷的情况下，本基金管理人对个股的选择将尤为注重对上市公司治理结构的评估，以期为投资者挑选出具备持续盈利能力的股票。本基金管理人将主要通过以下五个方面对上市公司治理水平进行评估：

- 股东价值创造力
- 公司声誉记录
- 管理层战略
- 管理层稳定性
- 盈利的可预见性

3、债券投资策略

本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，权衡投资，获取超额收益：

（1）利率趋势预期

准确预测未来利率趋势能为债券投资带来超额收益。本基金将密切关注宏观经济运行状况，全面分析货币政策、财政政策和汇率政策变化情况，把握未来利率走势，在预期利率下降时加大债券投资久期，在预期利率上升时适度缩小久期，规避利率风险，增加投资收益。

（2）收益率曲线变动分析

收益率曲线反映了债券期限同收益率之间的关系。投资研究部门通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券投资组合长短期品种的比例获得投资收益。

（3）收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债券）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，投资部门采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的，但是在某种情况下，比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或市场供求发生变化时，这种稳定关系会被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

（4）公司基本面分析

公司基本面分析是公司债(包括可转换债券)投资决策的重要决定因素。研究部门对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析，并结合实际调研结果，准确评价该公司债券的信用风险程度，作出价值判断。对于可转换债券，通过判断正股的价格走势及其与可转换债券间的联动关系，从而取得转债购入价格优势或进行套利。

4.权证投资策略

本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。基金的权证投资策略主要包括以下几个方面：

（1）综合衡量权证标的股票的合理内在价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。

（2）根据权证的合理内在价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理内在价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理内在价值的考量，决策买入、持有或沽出权证。

（3）通过权证与证券的组合投资，利用权证衍生工具的特性，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5. 资产支持证券投资策略

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。

第九部分　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×45%　+　恒生指数收益率×45%　+同业存款利率（税后）×10%

沪深　300指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。现金管理部分则采用同业存款利率（税后）业绩比较基准。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，或有更具代表性、更能为市场接受的业绩比较基准，基金管理人可根据市场变化情况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人报中国证监会备案后变更业绩比较基准并予以公告，而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分　基金的风险收益特征

本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金除了投资于 A 股上市公司外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。同时，本基金名为“沪港深”基金，基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

第十一部分　基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合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。

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月25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。

本基金投资组合报告的报告期为2018年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

8.1　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	1,389,961,424.35	93.25
	其中：股票	1,389,961,424.35	93.25
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	40,271,440.00	2.70
	其中：债券	40,271,440.00	2.70
	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	56,001,783.40	3.76
8	其他资产	4,413,150.99	0.30
9	合计	1,490,647,798.74	100.00

8.2　报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1　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	－	－
C	制造业	310,174,186.56	20.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	3,920,000.00	0.26
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,477,048.16	2.92
J	金融业	25,290,200.00	1.70
K	房地产业	－	－
L	租赁和商务服务业	3,404,000.00	0.23
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	386,265,434.72	25.99

8.2.2　报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	港股通投资股票行业分类公允价值占基金资产净值比(%)
基础材料	47,617,913.48	3.20
非日常生活消费品	42,637,429.92	2.87
金融	394,453,879.78	26.54
医疗保健	79,444,992.22	5.34
工业	181,999,644.92	12.24
信息技术	175,112,496.28	11.78
电信服务	10,208,616.73	0.69
公用事业	9,632,108.69	0.65
地产业	62,588,907.61	4.21
合计	1,003,695,989.63	67.52

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.3　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	02208	金风科技	12,911,000	95,546,299.72	6.43
1	002202	金风科技	3,492,916	41,949,921.16	2.82
2	00700	腾讯控股	400,900	114,015,895.86	7.67
3	02318	中国平安	1,228,000	85,905,998.70	5.78
3	601318	中国平安	369,200	25,290,200.00	1.70
4	01336	新华保险	3,310,500	109,385,946.54	7.36
5	02601	中国太保	3,791,400	100,754,521.39	6.78
6	00817	中国金茂	19,030,000	59,613,796.66	4.01
7	01093	石药集团	3,446,000	50,396,953.97	3.39
8	002475	立讯精密	3,144,316	48,485,352.72	3.26
9	01055	中国南方航空股份	10,938,000	48,220,714.43	3.24
10	01299	友邦保险	764,400	47,017,101.22	3.16

注：金风科技、中国平安同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

8.4　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