

东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

(2018年第2号)

东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证监会于2016年6月28日证监许可【2016】1443号文准予注册。本基金的基金合同于2016年8月30日正式生效。

【重要提示】

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,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,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,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,自行承担投资风险。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括: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、开放期大量赎回、巨额赎回或赎回导致的流动性风险、基金管理人提醒投资者投资过程中产生的操作风险、本基金特有的风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“卖者尽责、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,由投资者自行承担。

本基金投资于中小企业私募债券,由于中小企业私募债券采取非公开发行的方式发行,即存在市场流动性比较好的情况下,个别债券的流动性可能较差,从而使基金在进行个券操作时,可能难以按计划买入或卖出相应数量的,或买入卖出行为对价格产生比较大的影响,增加个券的建仓成本或变现成本。并且,中小企业私募债券信用等级较一般信用债券较低,存在着发行人不能按时足额还本付息的风险,此外,当发行人信用评级降低时,基金所投资的债券可能面临价格下跌风险。

本基金除了投资A股外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市交易的股票。除了需要承担与境内证券投资类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还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(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易不连续可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。具体风险提示详见查阅本基金招募说明书“风险提示”章节的具体内容。

基金管理人在此特别提示投资者: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和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。

本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

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并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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编制。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。招募说明书为主要向投资者披露与本基金相关事项的信息,是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金投资人应仔细阅读基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其认同基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书所载内容截止至2018年8月28日,基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2018年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
本基金基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基本信息如下:

名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路318号31层
办公地址:上海市黄浦区中山南路318号2号楼31、37、39、40层
法定代表人:潘鑫军
设立日期:2010年7月28日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2010]518号
开展公开募集证券投资基金业务批准文号:证监许可[2013]1131号
组织形式:有限责任公司
注册资本:3亿元人民币
存续期限:持续经营
联系电话:(021)63258888
联系人:廉迪

股权结构:东方证券股份有限公司持有公司100%的股权。
公司前身是东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部,2010年7月28日经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]518号)批准,由东方证券股份有限公司出资3亿元,在原东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部的基础上正式成立,是国内首家获批设立的券商系资产管理公司。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员
潘鑫军先生,董事长,1961年出生,中共党员,工商管理硕士,高级经济师。曾任中国人民银行上海分行办公室处长、上海分行办公室副主任、工商银行上海分行行政办公室联络员、工商银行上海分行组织部副主任科员、工商银行上海分行行长办公室副主任、上海分行党委办公室主任、党委书记、总裁助理兼国际投行支行党支部书记,东方证券股份有限公司党委书记、副总裁、董事长兼总裁,汇添富基金管理公司董事长、上海东方证券股份有限公司董事、上海东方金融控股(香港)有限公司董事。现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长、执行董事,东方花旗证券有限公司董事长,上海东方证券资产管理有限公司董事长。
金文忠先生,董事,1964年出生,中共党员,经济学硕士,经济师。曾任上海交通大学财经研究所研究员,上海万国证券公司办公室主任助理,农行副经理(主持工作)、研究所副副主任、总裁助理兼总办办公室主任,野村证券(主持工作)、研究所副主任,上海东方证券股份有限公司党委书记、副总裁,证券投资业务总部总经理,杭州东方银信投资管理有限公司董事长,东方金融控股(香港)有限公司董事,上海花旗投资管理有限公司董事。现任东方证券股份有限公司党委副书记,执行董事、总裁,上海东方期货有限公司董事长,上海东方证券资本投资有限公司董事长,上海东方证券创新投资有限公司董事,上海东方证券资产管理有限公司董事。

杜卫华先生,董事,1964年出生,中共党员,工商管理学硕士、经济学硕士,副教授。曾任上海财经大学金融学院教师,东方证券股份有限公司营业部经理,经纪业务总部总经理助理,副总经理,营运管理总部总经理,人力资源部总经理助理,总裁助理,职工监事。现任东方证券股份有限公司副总裁、工会主席、纪委书记,上海东方证券资本投资有限公司董事,上海东方证券创新投资有限公司董事,上海东方证券资产管理有限公司董事。

程莉女士,董事、总经理,公开募集基金管理业务负责人、财务负责人、董事兼秘书,1968年出生,社会学硕士,工商管理硕士,拥有十多年海内外市场营销经验,曾任东方证券股份有限公司管理业务总部副总经理,上海东方证券资产管理有限公司总经理助理,副总经理、联席副总经理,现任上海东方证券资产管理有限公司董事、总经理,公开募集基金管理业务负责人、财务负责人、董事兼秘书、合规总监兼首席风险官(代行)。公开募集基金管理业务合规负责人(代行)。

杨斌先生,董事,1972年出生,中共党员,经济学硕士。曾任中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处科长,上海证监局稽查处罚科科员,案件管理处科员,副主任科员,案件调查一处主任科员,机构监管一处副科长、期货监管处处长、法制工作处处长;现任东方证券股份有限公司首席风险官兼合规兼稽核总部总经理,上海东方期货有限公司董事,上海东方金融控股(香港)有限公司董事,东方花旗证券有限公司董事,上海东方证券资产管理有限公司董事。

2.基金管理人监事

陈波先生,监事,1971年出生,中共党员,经济学硕士。曾任东方证券投资银行业务总部副总经理,东方证券股份有限公司上市办副主任,上海东方证券资本投资有限公司副总经理(主持工作),现任上海东方证券资本投资有限公司董事、总经理,上海东方证券资产管理有限公司监事。

3.经营管理层人员
饶刚先生,副总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。

饶刚先生,副总经理,1973年出生,硕士研究生。曾任兴业证券研究员,富国基金管理有限公司研究员,固定收益部总经理兼基金经理,总经理助理,富国资产管理(上海)有限公司总经理,现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼公募固定收益投资部总经理,曾荣获中证报2010年金牛特别基金经理奖(唯一固定收益获奖者),2012年度上海市金融行业领军人才,在固定收益投资领域具有丰富的经验。

周代希先生,副总经理,1980年出生,中共党员,硕士研究生。曾任深圳证券交易所会员管理部经理,金融创新事业部高级经理,固定收益与衍生品工作小组执行经理,兼任深圳仲裁委员会仲裁员。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。曾荣获“证券公司仲债服务能手”称号等,在资产证券化等结构融资领域具有丰富的经验。

卢盛先生,副总经理,1973年出生,中共党员,硕士研究生。曾任冶金部安全环保研究院五室项目经理,华夏证券武汉分公司投资银行部业务董事,长信基金管理有限责任公司客户服务部客服总监,综合投行行政部总监,中欧基金管理有限公司基金销售总部销售总监,海通证券客户资产管理部市场总监,上海东方证券资产管理有限公司渠道发展部总监兼机构业务部副总监,执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼市场部总经理。

张豫先生,副总经理,1974年出生,硕士研究生。曾任上海财政证券公司研究员,兴业证券股份有限公司上海研究员,上海融昌资产管理有限公司研究员,信诚基金管理有限公司股票投资副总监、基金经理,上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监,执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼私募权益投资部总经理,拥有丰富的证券投资经验。

林鹏先生,副总经理,1976年出生,硕士研究生。曾任东方证券研究所研究员,资产管理业务总部投资经理,上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理,专户投资部投资经理,基金投资部基金经理,执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼公募权益投资部总经理,拥有丰富的证券投资经验。

4.合规总监、首席风险官
任莉女士,首席风险官兼合规总监(代行)(简历请参见上述关于董事的介绍)。

5.公开募集基金管理业务合规负责人(督察长)
任莉女士,公开募集基金管理业务合规负责人(代行)(简历请参见上述关于董事的介绍)。

6.本基金基金经理

(1)现任基金经理
纪文静女士,生于1982年,江苏大学经济学硕士,自2007年起开始证券行业工作。历任东海证券股份有限公司固定收益部投资经理、销售交易经理,德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理,上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监。现任上海东方证券资产管理

管理有限公司公募固定收益投资部副总经理、基金经理。2015年7月起任东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年7月至2017年9月任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年10月起任东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。2015年11月起任东方红收益增强债券型证券投资基金和东方红信用债债券型证券投资基金基金经理。2016年5月起任东方红添利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。2016年6月至2017年8月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理。2016年8月起任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理。2016年9月起任东方红价值精选混合型证券投资基金基金经理。2016年11月起任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年4月起任东方红睿泽沪深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2017年8月起任东方红红利主题证券投资基金基金经理。

(2)历任基金经理

李家春先生,2016年10月至2018年6月任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理。
7.公募产品投资决策委员会成员
公募产品投资决策委员会成员构成如下:主任委员饶刚先生,委员林鹏先生,委员刘峰先生,委员纪文静女士,委员周云先生。

列席人员:任莉女士。

8.上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况
本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司,基本信息如下:
名称:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
成立时间:1992年10月19日
经营范围:经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准,公司主营业务主要包括:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算;办理票据贴现;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、同业拆借;提供信用证服务及担保;代收代付款项及代理保险业务;提供保险箱业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外币兑换;国际结算;同业外汇买卖;外汇票据的承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;结汇、售汇;买卖和代理买卖股票以外的外币和有价证券;自营外汇买卖;代客外汇买卖;资信调查、咨询、见证业务;离岸银行业务;证券投资基金托管业务;全国社会保障基金托管业务;经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式:股份有限公司
注册资本:293.52亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人:胡波
联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务,是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部,2005年更名为资产托管部,2013年更名为资产托管与养老金业务部,2016年进行组织架构优化调整,并更名为资产托管部,目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心(含合肥分中心)五个职能处室。

目前,上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募基金投资托管、私募股权投资托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

(二)主要人员情况

高国富,男,1956年出生,研究生学历,博士学位,高级经济师职称。曾任:上海外高桥保税区开发(控股)公司总经理;上海外高桥保税区工委副主任;上海万国证券公司代总;上海久事公司总经理;上海市城市建设开发总公司总经理;中国太平洋保险(集团)股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员,中欧国际商学院理事会成员、国际顾问委员会委员,上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义,男,1965年出生,硕士研究生,高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理,上海市金融服务办挂职机构处长、市金融办服务办主任助理,上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监,上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建,男,1968年出生,博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员,国际业务部、工商信贷科科长,资金营运处副处长,上海浦东发展银行济南分行信贷处总经理,上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况
截至2018年6月30日,上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为2762.81亿元,比去年同期减少1.95%。托管证券投资基金共一百二十二只,分别为国泰君安金融行业精选基金、国泰君安债券基金、天治财富增长基金、东方小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业股票基金、国联安货币基金、长信金利趋势基金、LOF、华夏保本混合证券投资基金、中海策略精选灵活配置混合基金、博时安享18个月基金(LOF)、易方达裕时回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、富国恒利分级债券基金、汇添富和聚宝石货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、长信利率债货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保稳健信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫源混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘价值增值混合基金、嘉实稳固快线货币基金、鹏华REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳健回报基金、国寿安祺纯债债券基金、国投瑞银成长基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新动力混合基金、鑫元汇利债券型混合基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、华富诚鑫灵活配置基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时昇安纯债基金、国泰添益混合基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金、华富鑫利灵活配置基金、东方红战略精选沪港深混合基金、博时安纯债基金、鑫元利发纯债基金、银河君启混合基金、汇添富鑫保保本混合基金、景顺长城顺颐鑫利债券基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈18个月定期债券基金、中信建投裕发纯债债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安鑫利纯债债券基金、银河利融灵活配置混合基金、广发汇瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安嘉纯债债券基金、南方宜利可转债债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫源灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞泽灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、国泰景益灵活配置混合基金、易方达瑞兴混合基金、华富长富一年定开债券基金、中欧骏华债券基金、招商瑞华纯债券基金、上海安融弘远灵活配置混合基金、鑫元嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、工银瑞信瑞盈半年定开债券基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深300指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德泊通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中债500指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润混合基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、银河舜利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、长盛盛源灵活配置混合基金、万家现实增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业4.0主题沪港深精选混合基金、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫益主题轮动混合基金、中欧理泰灵灵活配置混合基金、中银证券安玖债券基金、鑫元鑫利灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、博时鑫源灵活配置混合基金、南方安福混合基金、中银证券瑞瑞混合基金、太平洋红利精选灵活配置混合基金、中银价值轮动灵活配置混合基金、富荣乾利精选灵活配置混合基金、国联安双轮驱动灵活配置混合证券投资基金、国泰裕益灵活配置混合型混合基金、前海开源鑫源灵活配置混合型证券投资基金、前海开源源鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源鑫源灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、华富恒悦定期开放债券型证券投资基金。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构
1.直销机构
(1)直销中心
名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路318号31层
办公地址:上海市黄浦区中山南路318号2号楼37层
法定代表人:潘鑫军
联系电话:(021)33315895
传真:(021)66326381
联系人:廉迪
公司网址:www.dham.com

(2)网上交易系统
网上交易系统包括管理人直销网站(www.dham.com)、东方红资产管理APP和管理人指定且授权的电子交易平台。个人投资者可登录本公司的电子交易平台,在与本公司达成网上交易的相关协议,接受本公司有关服务条款,了解有关基金网上交易的具体业务规则后,通过本公司网上交易系统办理开户、认购、申购、赎回等业务。

2.代销机构
(1)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市北京东路689号
法定代表人:高国富
联系电话:(010)61618888
传真:(021)66323087
联系人:杨国平、吴蓉
客服电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

(2)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层—29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼13层、21层—23层、25层—29层、32层、36层、39层、40层
法定代表人:潘鑫军
联系电话:(021)66325888

联系人:黄静
客服电话:(021)95503
公司网站:www.dfqz.com.cn
(3)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建强
联系电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195050
联系人:邓朔
客服电话:95555

公司网站:www.cmbchina.com
(4)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:北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B.E座3层@法
定代表人:王常青@联系电话:010-85130628
传真:010-65182621
联系人:许梦园@客服电话:400-8888-108@公司网站:www.csc108.com

(5)中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街25号,甲25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
法定代表人:李晓鹏
联系电话:010-63636235
传真:010-63636713
联系人:张清
客服电话:95595
网址:www.cebank.com

(6)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:谢永林
联系电话:021-38637673
联系人:张莉
客服电话:95511
公司网站:www.bank.pingan.com

(7)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市中环路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:金煜
联系电话:021-68475888
传真:021-68476111
联系人:王景斌
客服电话:95594
公司网站:www.bosc.cn

(8)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号天华信息科技园南区3C座7楼(天天基金)
法定代表人:其实
联系电话:021-54509888
传真:021-64385308
联系人:胡润
客服电话:4008181888
网址:http://www.1234567.com.cn/

(9)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京亚沙小镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号院建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:李露璐
电话:010-59601365-7024
传真:010-62002555
邮政编码:100029
客户服务电话:4008188000
公司网站:www.myfund.com

(10)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系电话:020-89629099
传真:020-89629101
联系人:黄敏娟
客户服务电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn

(11)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:田国立
联系人:徐瑞雪
电话:86-10-66215533
传真:010-66276564
客服电话:95533
公司网站:www.ccb.com

(12)北京肯瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市海淀区经济开发区科创十一街12号院京东集团总部
法定代表人:江卉
客服电话:400-098-8511(个人业务)、400-088-8816(企业业务)
公司网站:http://kenteru.jd.com/
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构
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
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:田国立
电话:010-58598893
传真:010-58598907
联系人:赵亦清

(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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞允
电话:02131358666
传真:02131358600
联系人:陈颖

七、基金的投资策略
(四)审计会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
经办注册会计师:薛岚、陈燕
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:乐美翼

四、基金的投资目标
本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求资产净值的长期稳健增值。

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)、沪港股票市场交易互联互通机制试点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”)、固定收益类金融工具、权证、股指期货、国债期货以及经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)。

本基金投资的具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、中期票据、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、债券回购、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具等金融工具以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种(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,可以将纳入投资范围。

本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-30%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-30%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-30%);本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略,在做好风险管理的基础上,运用多样化的投资策略实现基金资产的稳定增值。

1.资产配置
本基金通过定性研究与定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票、债券和现金类大资产的投资比例。

本基金通过动态跟踪国内外主要经济体的GDP/CPI/利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。并通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产配置权重,实现资产配置调整。

(1)普通债券投资策略
(1)久期控制:根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险。
(2)期限结构配置:在确定组合久期后,基金管理人将针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等,在长期、中期与短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(2)信用债投资策略
本基金在充分理解信用债基本面分析的基础上,结合信用债发行情况和流动性管理结果,积极参与债券回购交易,放大固定收益类资产投资比例,追求长期稳定的超额收益。

(3)公募产品投资策略
本基金主要遵循“自下而上”的投资理念,结合当前宏观经济运行情况及发展前景、国家政策等因素,考察行业运行周期,发展空间等,重点关注具有良好发展前景的行业。
(2)个股选择策略
本基金结合定性分析和定量分析的方法选择价值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资。

定性分析主要基于研发团队对公司的案头研究和实地调研,包括所属细分行业情况、市场供求、商业模式、核心技术等内容,深入分析公司的治理结构、经营竞争、竞争优势,综合考虑公司的估值水平和未来盈利空间。

定量分析主要根据相关财务指标,如营业利润率、净利率、每股收益(EPS)增长、主营业务收入增长率等,分析公司经营业绩、财务情况等,并结合利用市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)、折现现金流法(DCF)对公司进行合理估值。

(3)港股投资策略
本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不投资合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注:
①A股稀缺性行业个股,包括优质中资公司(如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领先品牌等)、A股缺乏投资标的的行业(如博彩)、②具有持续领先优势或核心竞争力企业,这类企业应具有良好成长性或者市场龙头;
③符合内地政策和投资逻辑的主题性个股;
④与A股同类公司相比具有估值优势的公司。
4.股指期货投资策略
本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货合约的空头合约比例主要与股票组合的头寸比例相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萃取相应股票组合的超额收益。

5.国债期货投资策略
本基金对国债期货的投资以套期保值为目的,回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

6.权证投资策略
本基金在权证投资中以对标的证券的基本面为基础,结合权证定价模型,隐含波动率、交易制度设计等多种因素对权证进行合理估值,谨慎投资,在风险可控的前提下实现较稳定的当期收益。本基金权证投资的原则为有利于基金资产增值,加强基金风险控制。

七、基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+沪深300指数收益率×10%。
中债综合指数为中央国债登记结算有限责任公司编制,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成份债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,具有广泛的市场代表性,能够反应中国债券市场的总体走势。
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,是反映香港股票市场趋势最权威的一种股价指数。
沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场成份指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。
若未来上述指数编制机构决定停止发布市场,市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状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。业绩比较基准变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,在履行适当程序后报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒介上及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

八、基金的风险收益特征
本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

本基金除了投资A股外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的投资,除了需要承担与境内证券投资类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还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。

九、基金的投资组合报告
以下投资组合资产配置数据截至2018年6月30日。
1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	189,566,167.71	18.79
	其中:股票	189,566,167.71	18.79
2	固定收益投资	763,338,689.21	75.64
	其中:债券	758,123,689.21	75.13
	资产支持证券	5,215,000.00	0.52
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	44,147,353.06	4.37
8	其他资产	12,059,998.97	1.20
9	合计	1,009,112,208.95	100.00

注:通过港股通交易机制持有的港股期末公允价值为101,911,962.1元,占基金资产净值的9.85%。
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(%)
----	------	---------	--------------