信达澳银中小盘混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2019 年第 1 期

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

二〇一九年七月

重要提示

信达澳银中小盘混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于 2009 年 8 月 19 日经中国证监会证监许可【2009】810 号文核准募集。根据相关法律法规,本基金基金合同已于 2009 年 12 月 1 日生效,基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券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,由于基金投资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基金管理风险等。

本基金是混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险,较高收益的基金品种。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书中与托管业务相关的更新信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 5 月 31 日,所载财务数据和净值表现截至 2019 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:信达澳银基金管理有限公司

住所:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331 号阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层和第 9 层

办公地址:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层

邮政编码:518054

成立日期:2006 年 6 月 5 日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:中国证监会证监基金字【2006】071 号

法定代表人:于建伟

电话:0755-83172666

传真:0755-83199091

联系人:郑妍

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

股本结构:信达证券股份有限公司出资 5400 万元,占公司总股本的 54%;康联首域集团有限公司(Colonial First State Group Limited)出资 4600 万元,占公司总股本的 46%

存续期间:持续经营

(二)主要人员情况

1、董事、监事、高级管理人员

董事:

于帆先生,董事长,毕业于厦门大学法律系。1987 年 7 月至 1988 年 10 月任化工部管理干部学院经济系法学教师,1988 年 10 月至 1999 年 6 月任中国信达信托投资公司部门副总经理、部门总经理,1999 年 6 月至 2000 年 9 月任中国信达资产管理公司债权管理部高级经理,2000 年 9 月至 2007 年 9 月任宏源证券股份有限公司董事会秘书、副总经理,2007 年 9 月至 2011 年 10 月任信达证券股份有限公司党委委员、董事会秘书、副总经理、常务副总经理,2011 年 10 月至 2013 年 8 月任中国信达资产管理公司投融资业务部总经理,2013 年 8 月至今任信达证券股份有限公司董事、总经理。2014 年 9 月 16 日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事长。

施普敦(Michael Stapleton)先生,副董事长,澳大利亚墨尔本 Monash 大学经济学学士。1996 年至 1998 年担任 JP 摩根投资管理有限公司(澳大利亚)机构客户经理,1998 年加入康联首域投资有限公司机构业务开发部门,负责澳大利亚机构客户销售和关系管理,2002 年加入首域投资国际(伦敦),历任机构销售总监、机构业务开发主管,2009 年 6 月起担任首域投资有限公司(香港)亚洲及日本区域董事总经理。

于建伟先生,董事,中央财政金融学院金融专业学士,东北财经大学 EMBA。30 年证券从业经历,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1989 年至 1996 年在中国建设银行信托投资公司工作,历任证券部副总经理、深圳证券业务部总经理、资产中介部负责人;1996 年至 2000 年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理;2000 年至 2004 年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理;2004 年至 2008 年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理;2008 年至 2013 年 5 月任世纪证券有限公司副总裁;2013 年 7 月加入信达澳银基金管理有限公司,2013 年 8 月 9 日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

潘广建先生,英国伯明翰大学工商管理硕士,加拿大注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所稽核部、香港期货交易所监察部。1997 年起历任山一证券分析员、香港证券及期货事务监察委员会助理经理、香港强制性公积金计划管理局经理、景顺亚洲业务发展经理、景顺长城基金管理公司财务总监、AXA 国卫市场部助理总经理、银联信托有限公司市场及产品部主管。潘广建先生于 2007 年 5 月起任首域投资(香港)有限公司中国业务开发董事並于同年兼任信达澳银基金管理公司监事至 2016 年 5 月 13 日,自 2016 年 5 月 14 日起,潘广建先生兼任信达澳银基金管理公司董事。

刘治海先生,独立董事,全国律师协会公司法专业委员会委员,北京市人大立法咨询专家,中国政法大学法学硕士,历任江苏省盐城市政法干校教师,首都经贸大学经济系讲师,自 1993 年 2 月起担任北京金诚同达律师事务所高级合伙人。2015 年 5 月 8 日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

张宏先生,独立董事,北京大学光华管理学院工商管理硕士,高级经济师。历任中国建设银行总行信托投资公司证券部副总经理、国际业务部副总经理,北京国利能源投资有限公司副总经理,华澳国际信托有限公司总裁、董事长、监事长。2019 年 4 月 9 日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

刘颂兴先生,独立董事,香港中文大学工商管理硕士。历任 W.I.Carr(远东)有限公司投资分析师,霸菱国际资产管理有限公司投资分析师、投资经理,纽约摩根担保信托公司 Intl 投资管理副经理,景顺亚洲有限公司投资董事,汇丰资产管理(香港)有限公司(2005 年 5 月起改组为汇丰卓誉投资管理公司)股票董事,中银保诚资产管理有限公司投资董事,新鸿基地产有限公司企业策划总经理,中国平安资产管理(香港)有限公司高级副总裁兼股票投资董事,中国国际金融(香港)有限公司资产管理部执行董事,Seekers Advisors(香港)有限公司执行董事兼投资总监。2012 年 6 月 19 日起担任广发资产管理(香港)有限公司董事总经理。

执行监事:

郑妍女士,中国农业大学管理学硕士,现任监察稽核部总监。2007 年 5 月加入信达澳银基金管理有限公司,历任客户服务部副总经理、监察稽核部副总经理、监察稽核总监助理。自 2015 年 1 月起兼任信达澳银基金管理有限公司职工监事。

高级管理人员:

于建伟先生,总经理,中央财政金融学院金融专业学士,东北财经大学 EMBA。30 年证券从业经验,具有证券与基金从业资格,基金业高管人员任职资格。1989 年至 1996 年在中国建设银行信托投资公司工作,历任证券部副总经理、深圳证券业务部总经理、资产中介部负责人;1996 年至 2000 年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理;2000 年至 2004 年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理;2004 年至 2008 年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理;2008 年至 2013 年 5 月任世纪证券有限公司副总裁;2013 年 7 月加入信达澳银基金管理有限公司,2013 年 8 月 9 日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

黄晖女士,副总经理兼董事会秘书,中南财经大学经济学学士,加拿大 Concordia University 经济学硕士。22 年证券、基金从业经验,具有证券与基金从业资格,基金业高管人员任职资格。1999 年起历任大成基金管理有限公司研究部分析师、市场部副总监、规划发展部副总监、机构理财部总监等职务,其间借调到中国证监会基金部工作,参与养老基金重组、首批开放式基金评审等工作。2000-2001 年参与英国政府“中国金融人才培训计划”(FIST 项目),任职于东方汇理证券公司(伦敦)。2005 年 8 月加入信达澳银基金管理有限公司,任督察长兼董事会秘书。2019 年 4 月 30 日任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

于鹏先生,副总经理,中国人民大学经济学学士。25 年证券、基金从业经验,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。历任中国建设银行总行信托投资公司证券总部驻武汉证券交易中心交易员、计划财务部会计、深圳证券业务部计划财务部副经理、经理;中国信达信托投资公司北京证券营业部总经理助理兼计财部经理;宏源证券股份有限公司北京营业部副总经理、机构管理总部业务监控部经理兼清算中心经理、资金财务总部副总经理、资金管理总部总经理兼客户资金存管中心总经理等职务。2005 年 10 月加入信达澳银基金管理有限公司,历任财务总监、总经理助理兼财务总监、副总经理。

段皓静女士,督察长,西南财经大学经济学硕士。19 年证券、基金行业监管经验,具有 CPA 注册会计师资格、基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1996 年加入深圳发展银行总行工作;2000 年 10 月加入中国证券监督管理委员会深圳监管局,历任副主任科员、主任科员、副处级调研员、副处长、处长。2019 年 4 月 30 日任信达澳银基金管理有限公司督察长。

阳先伟先生,副总经理,西南财经大学金融学本科和西南财经大学金融学硕士,17 年证券、基金从业经验,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。2002 年 7 月至 2003 年 5 月任民生证券有限公司证券分析师、债券研究员;2003 年 5 月至 2004 年 6 月任国海证券有限公司固定收益部高级经理;2004 年 6 月至 2016 年 10 月任鹏华基金管理有限公司研究员、基金经理、公司投资决策委员会成员、固定收益部总经理;2016 年 10 月至 2018 年 8 月任东吴证券股份有限公司董事总经理,资管八部总经理;2018 年 8 月加入信达澳银基金管理有限公司,任总经理助理,分管固定收益总部。2019 年 5 月 17 日任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

王咏辉先生,总经理助理,英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士,21 年证券、基金从业经验。 曾任伦敦摩根大通(JPMorgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师,汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司(Barclays Capital)部门负责人,泰达宏利基金管理公司(Manulife Teda)国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理,鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监,基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017 年 10 月加入信达澳银基金管理有限公司,任总经理助理、基金经理,分管权益投资总部、智能量化与资产配置总部。王咏辉先生具备基金从业资格、英国基金经理从业资格(IMC)、英国 IET 颁发的特许工程师(CEng)认证资格。

徐伟文先生,首席信息官,湖南大学工业自动化专业学士,23 年证券、基金从业经验,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1990 年 7 月至 1993 年 7 月任长沙二机床厂数控机床控制系统技术员;1993 年 7 月至 1995 年 8 月任《证券时报》社证券信息数据库工程师;1995 年 9 月至 1998 年 9 月任湘财证券公司经纪业务总部交易监控组主管;1999 年 1 月至 2004 年 8 月历任广发证券深圳营业部电脑部经理、总部稽核部业务主管、IT 审计主管;2004 年 8 月至 2008 年 9 月任景顺长城基金管理有限公司法律稽核部稽核经理;2008 年 9 月加入信达澳银基金管理有限公司,历任交易部总经理、运营总监。2019 年 5 月 17 日任信达澳银基金管理有限公司首席信息官。

2、基金经理

(1)现任基金经理:

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾国富	本基金的基金经理、健康中国灵活配置混合型基金、消费优选混合型基金的基金经理、权益投资总部副总监	2019年4月26日	-	20年	上海财经大学管理学硕士。1994年至2005年历任深圳大华会计师事务所审计部经理,大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审核委员会委员,平安证券有限责任公司资本市场部业务总监、内部审核委员会委员,国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员。2006年9月加入信达澳银基金,历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监、权益投资总部副总监,信达澳银精华配置混合型基金基金经理(2008年7月30日至2011年12月16日)、信达澳银红利回报混合基金基金经理(2010年7月28日至2011年12月16日)、信达澳银中小盘混合基金基金经理(2009年12月1日至2014年2月22日)、信达澳银产业升级混合基金基金经理(2015年2月14日起至今)、信达澳银健康中国灵活配置混合型基金基金经理(2017年8月18日起至今)、信达澳银消费优选混合型基金基金经理(2018年3月8日起至今)

(2)曾任基金经理

姓名	任本基金的基金经理期限	
	任职日期	离任日期
黄敬东	2010 年 1 月 13 日	2010 年 12 月 30 日
曾国富	2009 年 12 月 1 日	2014 年 2 月 22 日
执伟	2013 年 12 月 26 日	2015 年 7 月 1 日
冯士祯	2015 年 7 月 1 日	2019 年 5 月 18 日

3、公司投资审议委员会

公司公募基金投资审议委员会由 7 名成员组成,设主席 1 名,委员 6 名。名单如下:

主席:于建伟,总经理

委员:

黄晖,副总经理兼董事会秘书

阳先伟,副总经理、固定收益总部总监

王咏辉,总经理助理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监

曾国富,权益投资总部副总监、基金经理

孔学峰,固定收益总部副总监、基金经理

刘威,权益投资总部副总监

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所: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

成立时间:2004 年 09 月 17 日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人:田 青

联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939),于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年 6 月末,本集团资产总额 228,051.82 亿元,较上年末增加 6,807.99 亿元,增幅 3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加 93.27 亿元至 1,814.20 亿元,增幅 5.42%;净利润较上年同期增加 84.56 亿元至 1,474.65 亿元,增幅 6.08%。

2017 年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017 年中国最佳银行”,美国《环球金融》“2017 最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017 年中国最佳数字银行”、“2017 年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017 最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017 全球银行 1000 强”中列第 2 位;在美国《财富》“2017 年世界 500 强排行榜”中列第 28 名。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工 315 余人。自 2007 年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2018 年二季度末,中国建设银行已托管 857 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”,4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项,并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

(二)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

(1)每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

(3)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1、直销机构

名称:信达澳银基金管理有限公司

住所:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331 号阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层和第 9 层

办公地址:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331 号阿里巴巴大厦 T1 栋 8、9 层

法定代表人:于建伟

电话:0755-82858168/0755-83077068

传真:0755-83077038

联系人:王丽燕

公司网址:www.fscinda.com

邮政编码:518054

2、代销机构

序号	名称	注册地址	法定代表人	办公地址	客服电话	联系人	网站
1	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区金融大街25号	田国立	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	95533	吴寒冰	www.ccb.com
2	招商银行股份有限公司	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦	李建红	同“注册地址”	95555	邓炯鹏	www.cmbchina.com
3	交通银行股份有限公司	上海市浦东新区自由贸易试验区银城中路188号	彭 纯	同“注册地址”	95559	王菁	www.bankcomm.com
4	中信银行股份有限公司	北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦中信银行总行12层	李庆萍	同“注册地址”	95558	王晓琳	www.citicbank.com
5	北京银行股份有限公司	北京市西城区金融大街甲17号首层	张东宁	北京市西城区金融大街丙17号	95526	赵姝	www.bankofbeijing.com.cn
6	华夏银行股份有限公司	北京市东城区建国门内大街22号	李民吉	同“注册地址”	95577	董金	www.hxb.com.cn
7	平安银行股份有限公司	深圳市罗湖区深南东路5047号	谢永林	同“注册地址”	95511-3	冯博	www.bank.pingan.com
8	杭州银行股份有限公司	杭州市下城区庆春路46号	陈震山	同“注册地址”	95398	汪绪恒、陈振峰	www.hccb.com.cn
9	渤海银行股份有限公司	天津市河东区海河东路218号	李伏安	天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦	95541/4008888811	王宏	www.cbhb.com.cn
10	西安银行股份有限公司	陕西省西安市高新路60号	郭军	同“注册地址”	96779/4008696779	白智	www.xacbank.com
11	南洋商业银行(中国)有限公司	上海市浦东新区世纪大道800号三层、六层至九层	陈孝周	上海市浦东新区世纪大道800号南洋商业银行大厦	4008302066	陆赟	www.ncbchina.cn/cn/index.html?
12	恒丰银行股份有限公司	山东省烟台市芝罘区南大街248号	蔡国华	同“注册地址”	95395	李胜贤	www.hfbank.com.cn
13	信达证券股份有限公司	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	张志刚	同“注册地址”	95321	唐静	www.cindasc.com
14	中国银河证券股份有限公司	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层	陈共炎	同“注册地址”	95551/4008888888	辛国政	www.chinastock.com.cn
15	中信建投证券股份有限公司	北京市朝阳区安立路66号4号楼	王常青	北京市朝阳门内大街188号	95587/4008888108	刘畅	www.csc108.com
16	申万宏源证券有限公司	上海市徐汇区长乐路989号45层	李梅	上海市徐汇区长乐路989号45层	95523/4008895523	余敏	www.swhysc.com
17	申万宏源西部证券有限公司	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	韩志谦	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	4008000562	唐岚	www.hysec.com
18	华龙证券股份有限公司	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼	李晓安	同“注册地址”	95368/4006898888	范坤、杨力	www.hlzqgs.com
19	中信证券股份有限公司	广东省深圳市福田区中心3路8号卓越时代广场(二期)北座	张佑君	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层	95558	秦夏、马静懿	www.cs.ecitic.com
20	中信证券(山东)有限责任公司	青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层2001	姜晓林	同“注册地址”	95548	孙秋月	www.zxzqsd.com.cn
21	国泰君安证券股份有限公司	中国(上海)自由贸易试验区商城路618号	杨德红	上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层	95521	钟伟镇	www.gtja.com
22	湘财证券股份有限公司	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼	林俊波	同“注册地址”	95351	李欣	www.xcsc.com
23	光大证券股份有限公司	上海市静安区新闸路1508号	周健男	同“注册地址”	95525	李晓皙	www.ebscn.com
24	兴业证券股份有限公司	福建省福州市湖东路268号	杨华辉	上海市浦东新区长柳路36号	95562	乔琳雪	www.xyzq.com.cn
25	海通证券股份有限公司	上海市黄浦区广东路689号	周杰	上海市广东路689号海通证券大厦	95553/4008888001	王立群	www.htsec.com
26	招商证券股份有限公司	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层	霍达	同“注册地址”	95565	黄婵君	www.newone.com.cn
27	国信证券股份有限公司	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层	何如	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层	95536	李颖	www.guosen.com.cn
28	广发证券股份有限公司	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室	孙树明	广州市天河区马场路26号广发证券大厦	95575	黄岚	www.gf.com.cn
29	安信证券股份有限公司	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	王连志	同“注册地址”	95517	刘志斌	www.essence.com.cn
30	平安证券股份有限公司	深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层	刘世安	同“注册地址”	95511	王阳	stock.pingan.com
31	东兴证券股份有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层	魏庆华	同“注册地址”	95309/4008888993	和志鹏	www.dxzq.net
32	世纪证券有限责任公司	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层	姜昧军	同“注册地址”	4008323000	王雯、陈玮	www.csco.com.cn
33	华福证券有限责任公司	福州市鼓楼区温泉街道五四路157号新天地大厦7-9层	黄金琳	福州市五四路157号新天地大厦7至10层	95547	王虹,刘蕴祺	www.hfzq.com.cn
34	华泰证券股份有限公司	南京市江东中路228号	周易	深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦10楼	95597	庞晓芸	www.htsc.com.cn
35	广州证券股份有限公司	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层	邱三发	同“注册地址”	95396	梁微	www.gzs.com.cn
36	新时代证券股份有限公司	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501	叶顺德	同“注册地址”	95399	田芳芳	www.xsdzq.cn
37	长江证券股份有限公司	武汉市新华路特8号长江证券大厦	尤习贵	同“注册地址”	95579/4008888999	奚博宇	www.95579.com
38	银泰证券有限责任公司	广东省深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行18楼	黄冰	同“注册地址”	95341	刘翠玲	www.ytzq.com
39	浙商证券股份有限公司	浙江省杭州市江干区五星路201号	吴承根	同“注册地址”	95345	高扬,陈姗姗	www.stocke.com.cn
40	中泰证券股份有限公司	济南市市中区经七路86号	李玮	同“注册地址”	95538	秦雨晴	www.zts.com.cn
41	联讯证券股份有限公司	惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层	徐刚	同“注册地址”	95564	彭莲	www.lxsec.com
42	长城证券有限责任公司	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层	丁益	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14层	4006666888	金夏	www.cgws.com
43	恒泰证券股份有限公司	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼	庞介民	同“注册地址”	4001966188	熊丽	www.cnht.com.cn
44	太平洋证券股份有限公司	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼	李长伟	北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元	95397	王婧	www.tpyzq.com
45	国金证券股份有限公司	四川省成都市青羊区东城根上街95号	冉云	同“注册地址”	95310	杜晶、贾鹏	www.gjzq.com.cn
46	华金证券股份有限公司	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层	宋卫东	同“注册地址”	4008211357	郑媛	www.huajinsc.cn/
47	首创证券有限责任公司	北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座??	吴涛	同“注册地址”	4006200620	刘宇	www.sczq.com.cn
48	上海华信证券有限责任公司	上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼	陈灿辉	同“注册地址”	4008205999	徐璐	www.shhxzq.com
49	华西证券股份有限公司	四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	杨炯洋	同“注册地址”	? 95584/4008888818	谢国梅	www.hx168.com.cn
50	山西证券股份有限公司	山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	侯巍	同“注册地址”	95573/4006661618	郭熠	www.i618.com.cn
51	五矿证券有限公司	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元	赵立功	同“注册地址”	4001840028	濮耘瑶	www.wkzq.com.cn/
52	联储证券有限责任公司	广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼	沙常明	北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层联储证券	4006206868	丁倩云	www.lczq.com
53	西藏东方财富证券股份有限公司	拉萨市北京中路101号	陈宏	上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦	95357	付佳	http://www.18.cn
54	诺亚正行基金销售有限公司	上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室	汪静波	同“注册地址”	4008215399	余翼飞、邱佳捷	www.noah-fund.com
55	深圳众禄基金销售股份有限公司	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801	薛峰	深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼	4006788887	童彩平、徐丽平	www.zlfund.cn www.jjmmw.com
56	上海天天基金销售有限公司	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	其实	上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼	95021/4001818188	夏雯	www.1234567.com.cn
57	上海好买基金销售有限公司	上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号	杨文斌	同“注册地址”	4007009665	高源	www.howbuy.com
58	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室	陈柏青	杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼	4000766123	徐丽玲、钘金	www.fund123.cn
59	和讯信息科技有限公司	北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室	王莉	同“注册地址”	4009200022	陈慧慧、陈艳琳	licaike.hexun.com
60	浙江同花顺基金销售有限公司	杭州市文二西路一号903室	凌顺平	同“注册地址”	4008773772	朱琼	www.5ifund.com
61	上海联泰基金销售有限公司	中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室	燕斌	上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼	4001181188	兰敏	www.66zichan.com
62	北京展恒基金销售股份有限公司	北京市顺义区后沙峪镇安富街6号	闫振杰	山西省太原市迎泽区劲松北路31号哈伯大厦9层	4008188000	李晓芳	www.myfund.com
63	众升财富(北京)基金销售有限公司	北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室	李招弟	北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	4008769988	徐微	www.zscffund.com
64	中信期货有限公司	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	张皓	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	4009908826	刘宏莹	www.citicsf.com
65	上海长量基金销售有限公司	上海市浦东新区高翔路526号2幢220室	张跃伟	上海市浦东新区东方路1267号11层	4008202899	詹慧萌	www.erichfund.com
66	嘉实财富管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元	赵学军	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层	4000218850	李雯、闫欢	www.harvestwm.cn
67	北京虹点基金销售有限公司	北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心B座裙房2层	郑毓栋	北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层	4006180707	陈铭洲	www.hongdianfund.com
68	上海陆金所基金销售有限公司	上海市自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元	王之光	同“注册地址”	4008219031	程晨	www.lufunds.com
69	上海利得基金销售有限公司	上海市宝山区蕴川路5475号1033室	李兴春	上海虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53楼	4000676266	陈洁	www.leadfund.com.cn
70	深圳市金斧子基金销售有限公司	深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108	赖任军	同“注册地址”	4009300660	刘昕霞	www.jfzinv.com
71	珠海盈米财富管理有限公司	珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491	肖雯	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	89629066	梁文燕、邱湘湘	www.yingmi.cn
72	北京创金启富基金销售有限公司	北京西城区白纸坊东街2号院6号楼712室	梁蓉	同“注册地址”	4006262818	王瑶	www.5irich.com
73	北京钱景基金销售有限公司	北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012	赵荣春	同“注册地址”	4008936885	田伟静	www.qianjing.com
74	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室	钱昊旻	北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层	4008909998	孙雯	www.jnlc.com
75	北京广源达信基金销售有限公司	北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室	齐剑辉	北京市朝阳区望京宏泰东街 浦项中心B座19层	4006236060	王永霞	www.niuniufund.com
76	北京晟视天下基金销售有限公司	北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室	蒋煜	北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层	4008188866/010-58170761	殷雯	www.shengshiview.com
77	上海万得基金销售有限公司	中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座	王廷富	上海市浦东新区福山路33号8楼	4008210203	徐亚丹	www.520fund.com.cn
78	北京富国大通资产管理有限公司	北京市东城区北三环东路36号1号楼A2501室	宋宝峰	同“注册地址”	4000880088	李盛楠	www.fuguowealth.com
79	上海基煜基金销售有限公司	上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)	王翔	上海市杨浦区昆明路518号A1002室	4008205369	吴鸿飞	www.jiyufund.com.cn
80	北京唐鼎耀华基金销售有限公司	北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室	张冠宇	北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层	4008199868	徐晓婷	www.tdyhfund.com
81	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704	马勇	北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层	4001661188	文雯	8.jrj.com.cn/
82	北京汇成基金销售有限公司	北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号	王伟刚	北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层	4006199059	王骁骁	www.hcjijin.com
83	中民财富基金销售(上海)有限公司	上海市黄浦区中山南路100号7层05单元	弭洪军	上海市黄浦区中山南路100号17层	4008765716	黄鹏	www.cmiwm.com
84	北京植信基金销售有限公司	北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67	于龙	北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号	4006802123	吴鹏	www.zhixin-inv.com
85	北京肯特瑞基金销售有限公司	北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15	江卉	北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部	95118/4000988511	黄立影	kenterui.jd.com/ fund.jd.com/
86	喜鹊财富基金销售有限公司	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室	陈皓	同“注册地址”	4006997719	曹砚财	www.xiquefund.com
87	一路财富(北京)基金销售股份有限公司	北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	吴雪秀	同“注册地址”	4000011566	吕晓歌	www.yilucaifu.com
88	南京苏宁基金销售有限公司	南京市玄武区苏宁大道1号	王锋	同“注册地址”	95177	张云飞	www.snjijin.com
89	济安财富(北京)基金销售有限公司	北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307	杨健	同“注册地址”	4006737010	李海燕	www.jianfortune.com
90	北京蛋卷基金销售有限公司	北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	钟斐斐	北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座 17层	4005199288	侯芳芳	www.danjuanapp.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:信达澳银基金管理有限公司

住所:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331 号阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层和第 9 层

办公地址:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层

法定代表人:于建伟

电话:0755-83172666

传真:0755-83196151

联系人:刘玉兰

(三)律师事务所和经办律师

名称:上海源泰律师事务所

办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

电话:021-51150298

传真:021-51150398

联系人:刘佳

经办律师:刘佳、徐莘

(四)会计师事务所和经办注册会计师

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

法定代表人(执行事务合伙人): 毛鞍宁

联系电话:010-58153000

传真:010-85188298

联系人:昌华

经办注册会计师:昌华、高鹤

四、基金的名称

信达澳银中小盘混合型证券投资基金

五、基金的运作方式和类型

运作方式:契约型、开放式

类型:混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

通过投资具有高成长性的中小盘股票,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。

七、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的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

未来根据法律法规或监管机构相关政策的变动,基金管理人在履行适当程序后,本基金可以相应调整下述投资比例,并且还可以投资于法律法规或监管机构允许投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为:股票资产为基金资产的 60%-95%,债券资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%,权证占基金资产净值的 0%—3%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;投资于中小盘股票的资产比例不低于股票资产的 80%。

本基金管理人每半年末将中国 A 股市场中所有股票按 A 股流通市值从小到大进行排序并累加,累计流通市值占 A 股总流通市值 50%以下的股票定义为中小盘股票。在下一调整周期之前,对于未纳入最近一次排序范围的股票(如新股、恢复上市股票等),若其流通市值(对于未上市新股,用本基金管理人预测的流通市值代替)满足以上对中小盘股票的定义,则也视其为中小盘股票。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成没有收盘价格的,本基金将根据市场情况,取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。当基金所持有中小盘股票在某调整周期期间因价格变化或者流通股本发生变化而导致该股票不再满足当期中小盘股票的定义时,本基金仍沿用该调整周期期初时对该股票的定义,认为在该调整周期内该股票仍属中小盘股票并纳入到中小盘股票投资中。基金管理人将根据市场情况,本着最大化持有人利益的原则,适时予以调整,调整的时间不超过下一调整周期。

本基金所指的流通市值是在上海交易所和深圳交易所所有 A 股的流通股本乘以各股票当日的收盘价。

若今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式,本基金将予以相应调整,并提前三个工作日公告变更后具体的计算方法。

八、基金的投资策略

本基金奉行“自下而上”和“自上而下”相结合的投资方法。一方面,本基金通过“自下而上”的深入分析,选择素质高、竞争力突出的优秀公司,依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力,力争获得超越行业平均水平的良好回报;另一方面,本基金依靠“自上而下”的策略分析和运作,通过优化大类资产配置来有效控制系统风险,并力争把握行业轮动等方面的投资机会。

1.股票投资策略

本基金通过积极主动的投资管理为投资人创造价值,秉承自下而上的投资分析方法,对企业及其发展环境的深入分析,寻求具有良好的公司治理结构、在行业内具有竞争优势及长期持续增长能力的中小盘股票并把握他们的价值被低估时产生的投资机会,通过投资具有持续盈利增长能力和长期投资价值的优质企业为投资人实现股票资产的持续增值。

(1)运用“信达澳银公司价值分析体系(QGV,Quality, Growth & Valuation)”,从公司素质、盈利增长和估值三个方面对公司进行严格的综合评估,以深度挖掘能够持续保持盈利增长的成长型公司。

中小市值公司的各项业务处于起步、发展的过程中,公司各项制度一般处于不断完善的过程中。针对中小市值公司的这种特点,本基金将更加注重对其治理结构的研究分析,同时对公司主营业务增长及其持续性给予重点分析研究。

除了关注中小市值公司的治理结构、主营业务发展情况外,本基金还将通过关注其负债水平及负债结构、创造现金的能力、融资能力和盈利能力 / 营运能力的变化情况等方面以深入分析公司的财务风险。

(2)运用“信达澳银行业优势分析体系(ITC,Industrial Trends & Competitiveness)”,从行业长期发展的维度对比分析行业内的公司,从行业层面对公司做出筛选,挑选在细分行业内竞争力强、符合行业发展趋势的中小市值公司。

(3)运用“信达澳银宏观景气分析体系(MDE,Macro Drivers & Environment)”,考察宏观经济增长的行业驱动力,行业景气的变化、宏观景气变动对不同行业及相关公司的潜在影响,以及宏观经济政策对相关行业的影响,进而判断行业的发展趋势、景气周期、盈利能力、成长性、相对投资价值的变化,选择未来一段时间内持续增长能力突出的行业并调整对相关公司的价值判断,最终完成对行业配置的适度调控。

相关公司根据满足“信达澳银公司价值分析体系(QGV)”和“信达澳银行业优势分析体系(ITC)”的不同程度,以及投资团队对该公司的研究深度,分别被确定为“核心品种”、“重点品种”和“观察性品种”3 个层级并不断循环论证,在此基础之上基金经理根据自身判断,结合“信达澳银宏观景气分析体系(MDE)”提出的行业投资建议,构建基金的股票投资组合。

2.资产配置策略

本基金的资产配置包括两个层面:战略资产配置(SAA,Strategic Assets Allocation)和策略灵活配置(TAA,Tactic Assets Allocation)。战略资产配置以“联邦模型”为基础,每季度更新一次数据,并依据模型输出的结果来决定是否进行基本配置的调整,这是本基金资产配置的基础。策略灵活配置是在战略配置的基础上,根据“宏观环境和市场气氛分析体系(MEMS)”,在战略配置决定的配置比例的基础上可以进行占基金净值±10%比例的调整,以更灵活地适应市场的现时特点,从而在坚持基金的纪律性的配置方法的同时也保持适度的灵活性。

(1)战略资产配置(SAA)

信达澳银战略资产配置模型的蓝本是“联邦模型”,该模型通过测算动态市盈率、债券收益率等一系列市场变量与市场环境变量及其相关性,评估比较股票市场、债券市场等不同资产类别的相对投资价值及其变化,研判市场系统性风险的高低,为动态调整或修正基金在不同资产类别中的资产配置比例提供决策依据。

基于联邦模型的思想,我公司设计了“信达澳银战略资产配置模型”,模型的核心是“市场相对价值指标(RVI, relative value index)”。模型的含义是:长期来看国债和股票收益水平之间应该有一个确定的相对关系,如果短期两者偏离程度较大我们就进行相应操作等待市场恢复到正常状况。具体配置策略是,当 RVI 大于 0 时,股票市场相对于债券市场处于高估状态,这时应保持较低股票投资比例,RVI 越高,股票比例应越低;当 RVI 小于零时,股票市场相对于债券市场处于低估状态,这时应保持较高股票比例,RVI 越低,股票比例应越高。

(2)策略灵活配置(TAA)

本基金将保留占基金资产±10%比例的灵活配置空间,由基金经理根据对宏观环境和市场气氛的判断进行调整。其中,宏观经济环境的分析重在把握宏观经济的趋势,希望能准确把握实体经济趋势的拐点。市场气氛的分析重在把握市场即时的“动量(Momentum)”情况,以适应市场现时的氛围。策略灵活配置将主要依据 “宏观环境与市场气氛 (MEMS,Macro Environment and Market Sentiment)分析体系”。该体系主要由全球经济指标、国内经济指标、政策取向、企业盈利趋势、分析员盈利预测、市场故事等部分构成。本基金将根据实际的效果对上述指标赋以相应的权重(并进行及时的调整),计算整体得分,若得分很高说明宏观经济、市场氛围整体向好,则调高股票配置比例,否则降低股票比例。

3.固定收益投资策略

本基金将债券投资管理作为控制基金整体投资风险和提高非股票资产收益率的重要策略性手段,坚持价值投资理念,把注意力集中在对个券公允价值的研究上,精选价值相对低估的个券品种进行投资。通过类属资产配置、期限配置等手段,有效构造债券投资组合并控制风险。

(1)公允价值分析:债券的公允价值应该要求的足够补偿债券各种风险的收益率。债券投资研究团队通过对通货膨胀、实际利率、期限、信用、流动性、税收等因素的深入分析,运用公允价值分析模型,确定各券种的公允值。

(2)在类属配置层面,本基金将市场细分为交易所国债、交易所企业债、交易所可转债、银行间国债、银行间央行票据、银行间金融债(含政策性金融债、商业银行债等)、银行间企业债、银行间企业短期融资券、资产支持证券等不同类属,定期跟踪分析不同类属的公允值和风险收益特征,并结合该类属的市场收益率水平、波动性、市场容量、流动性等确定其投资比例和组合的目标久期。

(3)在个券选择层面,本基金将在对个券进行深入研究和估值的基础上选择价值相对低估的品种,具体操作中将专注于对不同类属关键驱动因素的研究和分析,如国债 / 央票 / 政策性金融债主要关注影响利率水平的各种因素,企业债 / 短期融资券则在关注影响利率水平的因素基础上还要综合评估其信用风险,可转债则还要评估正股的投资价值。

4.权证投资策略

本基金将权证作为有效控制基金投资组合风险、提高投资组合收益的辅助工具。本基金在投资权证时,将根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值,发现市场对股票权证的非理性定价,谨慎进行投资,追求较为稳健的当期收益。

5.其他金融衍生产品投资策略

本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向,一旦有新的产品推出市场,将在届时相应法律法规的框架内,制订符合本基金投资目标的投资策略,同时结合对衍生工具的研究,在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下,谨慎进行投资。

6.投资决策程序

本基金投资决策基本原则是根据基金合同规定的投资目标、投资理念以及范围等要素,制定基金投资策略。本基金采用投资团队分级负责制的投资决策方式,本基金经理是本基金投资团队的重要成员,一方面积极参与投资团队的投资研究工作,另一方面在公司授权下主动行使投资决策和本基金的投资组合管理职责。本基金力求通过包括本基金经理在内的整个投资团队全体人员的共同努力来争取良好的投资业绩。在投资过程中,采取分级授权的投资决策机制,对于不同的投资规模,决策程序有所不同。通过这样的决策流程既充分调动投资团队的集体智慧,也使得基金经理的主观能动性得到充分的发挥。在合理控制投资风险的前提下,追求本基金持有人最优化的投资收益。

公司设立投资审议委员会,作为公司投资管理的最高决策和监督机构。投资审议委员会由总经理担任主席,投资总监任执行委员。为提高投资决策效率和专业性水平,公司授权投资总监带领投资研究部负责公司日常投资决策和投资管理。投资审议委员会定期或在认为必要时,评估基金投资业绩,监控基金投资组合风险,并对基金重大投资进行审议做出决策。投资决策的程序是:

1)基金经理与投资团队运用“信达澳银战略资产配置模型”从战略资产配置(SAA)角度研究各资产类别的相对长期投资价值,提出大类资产(股票、债券、现金等)的投资建议,在投资总监批准后实施。在战略配置的基础上,基金经理运用“策略灵活配置模型(TAA)”,根据现时的经济环境和市场气氛进行±10%的灵活配置。

2)投资研究团队对符合基本流通性条件和素质要求的上市公司展开广泛研究,确定本基金的备选股票库;

3)基金经理根据分析师推荐及自身研究自行确定观察性买入的股票,以及买入数量和价格;

4)投资总监每周或在认为必要时组织投资团队召开股票分析会,运用 QGV 和 ITC 等分析体系对基金经理或行业分析师建议投资的股票进行深入讨论,形成对股票的基本面和投资价值的结论性意见;

5)在深入研究(要具备内部的深入研究报告)和团队讨论的基础上,基金经理可提出重点投资建议和集中投资建议,分别报投资总监和公司投资审议委员会审议,经批准后方可实施;

6)投资总监组织基金经理和投资团队对基金的投资组合进行分析,对投资组合的资产配置和主要品种进行分析,投资总监根据上述分析对基金的组合提出调整建议,建议区分为建议性提议和强制性提议,对强制性建议基金经理必须在特定时间内完成组合调整;

7)公司投资审议委员会每月讨论并每季正式评议本基金的投资业绩和投资组合风险,并在认为必要时要求投资团队和基金经理提出控制投资组合风险和改善投资业绩的方案,方案经会议审议后,基金经理根据方案和投资流程调整投资组合;

8)固定收益品种的投资和调整程序。通过对各类属和各券种的公允值进行全面分析,以确定组合久期并选择价值相对低估的个券从而构建固定收益投资组合;

9)公司风险管理委员会和监察稽核部实时监控本基金投资的全过程,并及时制止违反本基金合规控制要求的投资行为,对基于有关法规和本基金合同要求的该等合规建议本基金经理及投资团队必须在合理时间内无条件执行。

九、基金的业绩比较基准

自基金成立日至 2012 年 4 月 30 日本基金的业绩比较基准为“(天相中盘指数收益率×40%+ 天相小盘指数收益率×60%)×80%+ 中国债券总指数收益率×20%”。

为使本基金的业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,本公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案同意后,自 2012 年 5 月 1 日起本基金业绩比较基准变更为:中证 700 指数收益率×80%+ 中国债券总指数收益率×20%

中证 700 指数由中证指数有限公司编制。中证 700 指数成分股由中证 200 指数和中证 500 指数的成分股构成,能够较好反映沪深证券市场里中小市值公司的整体情况。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数,拥有独立的数据源和自主的编制方法。该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个债券市场,能够反映债券市场总体走势,具有较强的市场代表性,可以作为本基金债券投资部分的基准。

随着法律法规和市场环境发生变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案并公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险,较高收益的基金品种。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司复核了本次更新招募说明书中的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。

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资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告期截止至 2019 年 3 月 31 日。本报告中财务资料未经审计。

一)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	72,807,521.42	80.23
	其中:股票	72,807,521.42	80.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,664,648.43	5.14
	其中:债券	4,664,648.43	5.14
	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	12,942,022.42	14.26
8	其他资产	337,377.70	0.37
9	合计	90,751,569.97	100.00

二)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(%)
A	农、林、牧、渔业	3,410,400.00	3.91
B	采矿业	-	-
C	制造业	46,341,225.48	53.16
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	1,518,000.00	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,961,902.94	10.28
J	金融业	5,012,643.00	5.75
K	房地产业	3,173,000.00	3.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,323,000.00	1.52
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	3,067,350.00	3.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,807,521.42	83.52

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

三)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	000661	长春高新	15,000	4,754,850.00	5.45
2	300601	康泰生物	70,000	3,969,000.00	4.55
3	300498	温氏股份	84,000	3,410,400.00	3.91
4	000858	五 粮 液	35,000	3,325,000.00	3.81
5	002583	海能达	300,000	3,288,000.00	3.77
6	000671	阳 光 城	380,000	3,173,000.00	3.64
7	300001	特锐德	140,000	3,131,800.00	3.59
8	600872	中炬高新	85,000	3,109,300.00	3.57
9	002044	美年健康	165,000	3,067,350.00	3.52
10	000860	顺鑫农业	50,000	3,031,500.00	3.48

四)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	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,664,648.43	5.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,664,648.43	5.35

五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	127010	平银转债	19,992	2,365,653.36	2.71
2	127005	长证转债	19,993	2,298,995.07	2.64

六)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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金未参与投资股指期货。

十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

十一)投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	104,784.90
2	应收证券清算款	183,480.03
3	应收股利	-
4	应收利息	4,257.30
5	应收申购款	44,855.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	337,377.70

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127005	长证转债	2,298,995.07	2.64

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩

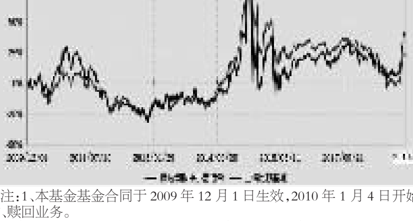
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

(一)自 2012 年 5 月 1 日起,本基金的业绩比较基准由“(天相中盘指数收益率×40%+ 天相小盘指数收益率×60%)×80%+ 中国债券总指数收益率×20%”,变更为“中证 700 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%”。故截至 2012 年 4 月 30 日,本基金的基金份额净值增长率表现、变动情况,与同期业绩比较基准收益率、变动情况的比较均以原业绩比较基准为准,2012 年 5 月 1 日起,本基金的基金份额净值增长率表现、变动情况,与同期业绩比较基准收益率、变动情况的比较均以新的业绩比较基准为准。

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(截至 2019 年 3 月 31 日):

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009年(2009年12月1日至2009年12月31日)	0.00%	0.42%	1.35%	2.95%	-1.35%	-2.53%
2010年(2010年1月1日至2010年12月31日)	23.70%	1.54%	3.75%	1.35%	19.95%	0.19%
2011年(2011年1月1日至2011年12月31日)	-34.36%	1.28%	-24.38%	1.14%	-9.98%	0.14%
2012年(2012年1月1日至2012年12月31日)	-3.20%	1.16%	1.65%	1.17%	-4.85%	-0.01%
2013年(2013年1月1日至2013年12月31日)	12.21%	1.50%	7.95%	1.13%	4.26%	0.37%
2014年(2014年1月1日至2014年12月31日)	27.78%	1.51%	32.89%	0.95%	-5.11%	0.56%
2015年(2015年1月1日至2015年12月31日)	22.27%	3.08%	28.53%	2.23%	-6.26%	0.85%
2016年(2016年1月1日至2016年12月31日)	-13.13%	2.05%	-13.55%	1.45%	0.42%	0.60%
2017年(2017年1月1日至2017年12月31日)	5.35%	0.88%	2.43%	0.67%	2.92%	0.21%
2018年(2018年1月1日至2018年12月31日)	-15.15%	1.34%	-25.40%	1.17%	10.25%	0.17%
2019年(2019年1月1日至2019年3月31日)	33.55%	1.54%	26.30%	1.34%	7.25%	0.20%
自基金合同生效起至今(2009年12月1日至2019年3月31日)	42.90%	1.70%	24.36%	1.32%	18.54%	0.38%

(二)基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较



注:1、本基金基金合同于 2009 年 12 月 1 日生效,2010 年 1 月 4 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:股票资产为基金资产的 60%-95%,债券资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%,权证占基金资产净值的 0%—3%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,投资于中小盘股票的资产比例不低于股票资产的 80%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

3、本基金基金管理人根据《信达澳银中小盘混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,经与基金托管人中国建设银行协商一致,并报中国证监会备案后,自 2012 年 5 月 1 日起,本基金的业绩比较基准由“(天相中盘指数收益率×40% + 天相小盘指数收益率×60%)×80%+ 中国债券总指数收益率×20%” 变更为 “中证 700 指数收益率×80%+ 中国债券总指数收益率×20%”。

十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.基金财产拨划支付的银行费用;

4.基金合同生效后的基金信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

7.基金的证券交易费用;

8.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、基金申购(基金合同生效后购买本基金)

投资者在申购基金份额时需交纳前端申购费,费率按申购金额递减,具体费率如下:

申购金额 M	申购费率
M<50 万元	1.5%
50≤M<200 万元	1.0%
200≤M<500 万元	0.6%
M≥500 万元	每笔 1000 元

申购费用的计算方法如下:

净申购金额 = 申购金额 /[1+ 申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

本基金申购费用由投资者承担,申购费不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

若投资者在一个交易日内多次申购,则根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率,分别计算每笔的申购费用。

4、基金赎回

投资者在赎回基金份额时需交纳赎回费,赎回费率按持有期(T)递减,最高不超过总的赎回金额的 5%,持有期超过 2 年赎回费率则为 0。具体费率如下:

持有期 T	适用的赎回费率
T<7 天	1.5%
7 天≤T<1 年	0.5%
1 年≤T<2 年	0.3%
T≥2 年	0%

注:1 年按照 365 天计算,2 年按照 730 天计算,其余同。

赎回费用的计算方法如下:

赎回费用 = 赎回金额×赎回费率

基金管理人对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产,除此之外,本基金赎回费总额的 25%归基金财产,75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

5、基金转换

本基金已通过信达澳银直销中心及部分代销机构开通本基金与公司旗下其他基金的转换业务。本基金转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见招募说明书的“基金份额的申购与赎回”章节和本基金关于转换业务的相关公告。

(四) 除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(五) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(六) 基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(七) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人于 2019 年 1 月 12 日公告的本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

(一)在“重要提示”部分,修改了本基金更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期;

(二)在“三、基金管理人”部分,更新了管理人的相关信息:

1、更新了基金管理人证券投资基金管理情况;

2、更新了基金管理人董事、监事、高级管理人员的相关信息;

3、更新了基金经理的相关信息;

4、更新了公司投资审议委员会的相关信息;

(三)在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的相关信息;

(四)在“五、相关服务机构”部分,更新了代销机构的相关信息;

(五)在“九、基金的投资”部分,更新了本基金最近一期投资组合报告内容,数据截至 2019 年 3 月 31 日;

(六)在“十、基金的业绩”部分,更新了基金业绩相关数据,数据截至 2019 年 3 月 31 日;

(七)在“二十三、其他应披露事项”部分,更新了本基金的其他应披露事项列表;

信达澳银基金管理有限公司

二〇一九年七月十一日