

# 天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书(更新)摘要

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

日 期：二零一五年十月

## 重要提示

本基金经中国证监会 2015 年 1 月 15 日证监许可[2015]90 号文注册募集。

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和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于 2015 年 3 月 17 日正式生效。

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，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，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。投资人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、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。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。

本基金投资中小企业私募债券，基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

本基金股票投资比例为基金资产的 0%-95%，投资于消费及相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；投资于权证的比例不超过基金资产的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，

但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依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对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，应详细查阅基金合同。

基金招募说明书自基金合同生效之日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告。本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 9 月 16 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 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

名称：天弘基金管理有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

成立日期：2004 年 11 月 8 日

法定代表人：井贤栋

联系电话：(022) 83310208

组织形式：有限责任公司

注册资本及股权结构

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监基金字[2004]164号），于2004年11月8日成立。公司注册资本为人民币5.143亿元，股权结构为：

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2015年9月16日，本公司旗下管理的基金有天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金

金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深 300 指数型发起式证券投资基金、天弘中证 500 指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药 100 指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金、天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金、天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金。

公司下设股票投资、固定收益投资、中央交易、国际业务、品牌管理、渠道管理、互联网金融、机构理财、风险管理、监察稽核、信息技术、基金运营、公司财务、客户服务、综合管理、人力资源等部门和北京分公司、上海分公司、广州分公司、天津分公司。随着公司业务发展的需要，将对相关业务部门进行适当的调整。

基金管理人无任何处罚记录。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员基本情况

井贤栋先生，董事长，硕士研究生。历任太古饮料有限公司财务总监、广州百事可乐有限公司首席财务官、阿里巴巴（中国）信息技术有限公司财务副总裁、支付宝（中国）网络技术有限公司首席财务官，浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司

首席运营官，现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司总裁。

卢信群先生，副董事长，硕士研究生。历任君正国际投资（北京）有限公司研究员、研究部经理、投资部经理，乌海市君正科技有限责任公司副总裁，内蒙古君正能源化工股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书，北京博晖创新光电技术股份有限公司监事。现任北京博晖创新光电技术股份有限公司副董事长、总经理，君正国际投资（北京）有限公司董事。

袁雷鸣先生，董事，硕士研究生。历任中国银联股份有限公司法律专员，现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司金融事业部总经理。

屠剑威先生，董事，硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法律事务处案件管理科副科长、香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理、花旗银行（中国）有限公司合规部助理总裁、永亨银行（中国）有限公司法律合规部主管，现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司法务及合规部资深总监。

付岩先生，董事，大学本科。历任北洋（天津）物产集团有限公司期货部交易员，中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员，顺驰（中国）地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司自营业务部总经理。

郭树强先生，董事，总经理，硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理，天弘创新资产管理有限公司总经理、董事。

魏新顺先生，独立董事，大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长，天津市政府法制办经济法规处处长，天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所律师。

张军先生，独立董事，博士。现任复旦大学经济学院院长，中国经济研究中心主任。

贺强先生，独立董事，本科。现任中央财经大学金融学院教授。

## 2、监事会成员基本情况

李琦先生，监事会主席，硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记，天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部，天津信托有限责任公司

条法处处长、总经理助理兼条法处处长、副总经理，本公司董事长。

张杰先生，监事，大学专科。现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书，锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长，锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理，内蒙古君正化工有限责任公司监事，乌海市君正矿业有限责任公司监事，内蒙古中鑫能源有限公司董事，内蒙古坤德物流股份有限公司监事。

方隽先生，监事，硕士研究生。历任厦门中恒信会计师事务所审计部门经理、福建立信闽都会计师事务所副主任会计师、立信会计师事务所厦门分所副主任会计师，现任芜湖高新投资有限公司总经理。

韩海潮先生，监事，硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理，亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监，证通股份有限公司监事。

张牡霞女士，监事，硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、天弘基金市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理，现任本公司互联网金融业务部副总经理。

付颖女士，监事，硕士研究生。历任天弘基金监察稽核部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管，现任本公司监察稽核部副总经理。

### 3、高级管理人员基本情况

郭树强先生，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。

陈钢先生，副总经理，硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理，北京宸星投资管理公司投资经理，兴业证券公司债券总部研究部经理，银华基金管理有限公司机构理财部高级经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月份加盟本公司，现任公司副总经理、资深基金经理、固定收益总监兼固定收益部总经理，分管公司固定收益投资业务。

周晓明先生，副总经理，硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理，万通企业集团总裁助理，中工信托有限公司投资部副总，国信证券北京投资银行一部经理，北京证券投资银行部副总，嘉实基金市场部副总监、渠道部总监，香港汇富集团高级副总裁，工银瑞信基金市场部副总监，嘉实基金产品和营销总监，盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司，

同月被任命为公司首席市场官，现任公司副总经理，分管公司互联网综合业务及战略产品业务。

宁辰先生，副总经理，硕士研究生。历任三峡证券投资分析师，亚洲证券天津勤俭道营业部部门经理和营销总监，亚洲证券天津管理总部总经理助理。2006年8月加盟本公司，2011年4月任命为公司总经理助理，现任公司副总经理，分管公司机构销售业务。

张磊先生，副总经理，硕士研究生。历任清华兴业投资管理公司证券分析师，嘉实基金基金直销经理，泰信基金北京理财中心经理，华夏基金机构理财部总经理，九鼎投资管理有限公司副总经理和合伙人，北京杰思汉能资产管理公司执行总裁。2012年10月加盟本公司，2012年11月任命为公司总经理助理，现任公司副总经理，分管公司投行业务。

童建林先生，督察长，大学本科，高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理，亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管，华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管，本公司基金会计、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理。现任本公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

肖志刚先生，经济学硕士，7年证券从业经验。历任富国基金管理有限公司行业研究员。2013年8月加盟本公司，历任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理助理、股票研究部总经理。现任本公司投资研究部总经理、本基金基金经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘永定价值成长混合型证券投资基金基金经理、天弘周期策略混合型证券投资基金基金经理、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

李宁先生，管理学博士，5年证券从业经验。历任中信建投证券股份有限公司行业分析师。2011年8月加盟本公司，历任本公司行业研究员。现任本公司股票研究部总经理助理，本基金基金经理。

#### 5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

郭树强先生，董事、总经理，投资决策委员会主席。

陈钢先生，本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理，基金经理。

姜文涛先生，股票投资总监，基金经理。

钱文成先生，基金经理。

刘冬先生，宏观策略分析师，基金经理。。

肖志刚先生，投资研究部总经理，基金经理。

李蕴炜先生，基金经理。

王登峰先生，基金经理。

姜晓丽女士，基金经理。

王林先生，投资经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银

行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2015年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共287只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证

券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、

东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收

益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投

资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深300指数型证券投资基金、前海开源沪深300指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、嘉实新兴产业股票型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、招商招利1个月期理财债券型证券投资基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、中证500医药卫生指数交易型开放式指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、鹏华先进制造股票型证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、华润元大富时中国A50指数型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、南方理财金交易型货币市场基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金、前海开源股息率100强等权

重股票型证券投资基金、国开泰富货币市场证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金、富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金、鹏华可转债债券型证券投资基金、华夏沪深300指数增强型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、中证500工业指数交易型开放式指数证券投资基金、华融新锐灵活配置混合型证券投资基金、中证500原材料指数交易型开放式指数证券投资基金、华安智能装备主题股票型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、南方改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、鹏华医药科技股票型证券投资基金、长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金、中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金销售机构

##### 1、直销机构：

##### (1) 天弘基金管理有限公司直销中心

住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人：井贤栋

电话：（022）83865560

传真：（022）83865563

联系人：司媛

客服电话：400-710-9999（免长途话费）

（2）天弘基金管理有限公司网上直销平台

办公地址：北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 20 层

电话：（010）83571739

传真：（010）83571840

联系人：许丛立

网址：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

（3）天弘基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 20 层

电话：（010）83571789

传真：（010）83571900

联系人：申向阳

（4）天弘基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号 30 层 E-F 单元

电话：（021）50128808

传真：（021）50128801

联系人：涂远宏

（5）天弘基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 10 号富力中心写字楼第 10 层 08 单

元

电话：（020）38927920

传真：(020) 38927985

联系人：袁宇鹏

2、其他销售机构：

(1) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

电话：010-85108206

传真：85109219

联系人：唐文勇

客户服务热线：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(2) 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

法定代表人：李国华

电话：010-68858095

传真：010-68858117

联系人：杨涓

客服电话：95580

网站：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：胡迪峰

客服电话：95559

网站: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(4) 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 常振明

电话: 010-65557046

传真: 010-65550827

联系人: 王媛

客服电话: 95558

网站: [bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(5) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址: 广东省东莞市城区南城路 2 号

办公地址: 广东省东莞市城区南城路 2 号

法定代表人: 何沛良

电话: 0769-961122

传真: 0769-22320896

联系人: 杨亢

客户服务热线: 0769-961122

网址: [www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(6) 平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南东路 5047 号

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号平安金融大厦 9 楼

法定代表人: 孙建一

电话: 021-38637673

传真: 021-50979507

联系人: 张莉

客户服务热线: 95511-3

网址: [bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(7) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：常州市延陵路 668 号

办公地址：常州市延陵路 668 号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-89995066

传真：0519-89995170

联系人：包静

客户服务热线：0519-96005

网址：[www.jnbank.cc/](http://www.jnbank.cc/)

(8) 南京银行股份有限公司

注册地址：南京市中山路 288 号

办公地址：南京市中山路 288 号

法定代表人：林复

电话：025-86775335

联系人：刘晔

客户服务热线：40088-96400

网址：[www.njcb.com.cn](http://www.njcb.com.cn)

(9) 浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

办公地址：浙江省杭州市延安路 128 号耀江广厦 1-125

法定代表人：金子军

电话：0571-87117604

传真：0571-87117607

联系人：陈旭英

客户服务热线：4008096527、0571-96527

网址：[www.sdns.czcb.com.cn](http://www.sdns.czcb.com.cn)

(10) 长安银行股份有限公司

注册地址：陕西省西安市高新四路 13 号 1 栋 1 单元 10101 室

办公地址：陕西省西安市高新四路 朗臣大厦 1101

法定代表人：孙宗宽

电话：029-88609563

传真：029-88609566

联系人：闫石

客户服务热线：029-96669

网址：www.ccabchina.com/

(11) 晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市长风西街一号丽华大厦 A 座

办公地址：山西省太原市长风西街一号丽华大厦 A 座

法定代表人：上官永清

联系人：董嘉文

客户服务热线：95105588

网址：www.jshbank.com

(12) 江苏吴江农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号

办公地址：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号

法定代表人：陆玉根

电话：0512-63969063

联系人：王健

客户服务热线：400-86-96068

网址：www.wjrcb.com

(13) 哈尔滨银行股份有限公司

住所：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址：哈尔滨市道里区西八道街 2 号 1003 室

法定代表人：郭志文

电话：0451-86779018

传真：0451-86779218

联系人：遇玺

客户服务热线：95537

网址：www.hrbb.com.cn

(14) 天津农商商业银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 59 号国际经济贸易中心 A 座 1-6 层

办公地址：天津市河西区马场道 59 号国际经济贸易中心 A 座 1-6 层

法定代表人：李宗堂

电话：022-83872243

联系人：张广彧

客户服务热线：96155

网址：www.trcbank.com.cn

(15) 浙江泰隆商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省台州市路桥区南官大道 188 号

办公地址：浙江省台州市路桥区南官大道 188 号

法定代表人：王钧

电话：0571-87219677

传真：0576-82453522

联系人：陈妍宇

客户服务热线：400-88-96575

网址：www.zjtlcb.com

(16) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：021-20315255

传真：021-20315137

联系人：马晓男

客户服务热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(17) 光大证券股份有限公司

住所：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

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务热线：400-888-8788、10108998

网址：www.ebscn.com

(18) 中航证券有限公司

住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座

法定代表人：杜航

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

客户服务热线：400-886-6567

网址：www.avicsec.com

(19) 新时代证券有限责任公司

住所：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

电话：010-83561146

传真：010-83561094

联系人：卢珊

客户服务热线：400-698-9898

网址：www.xsdzq.cn

(20) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：010-65183880

传真：010-65182261

联系人：张颢

客户服务热线：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(21) 长江证券股份有限公司

住所：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：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：奚博宇

客户服务热线：400-888-8999

网址：www.95579.com

(22) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市长乐路 989 号 40F

法定代表人：储晓明

电话：021-54041654

传真：021-33388217

联系人：钱达琛

客户服务热线：95523 或 400-889-5523

网址：www.sywg.com.cn

(23) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

客户服务热线：400-8888-666

网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(24) 广州证券有限责任公司

住所: 广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人: 吴志明

电话: 020-87322668

传真: 020-87325036

联系人: 林洁茹

客户服务热线: 020-961303

网址: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(25) 信达证券股份有限公司

住所: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 高冠江

电话: 010-63081000

传真: 010-63080978

联系人: 唐静

客户服务热线: 400-800-8899

网址: [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(26) 华安证券有限责任公司

住所: 安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址: 安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24-32 层

法定代表人: 李工

电话: 0551-5161666

传真: 0551-5161600

联系人: 汪燕

客户服务热线: 96518、400-809-6518

网址: [www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(27) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045500

联系人：林爽

客户服务热线：010-66045678

网址：www.txsec.com

(28) 国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690126

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪

客户服务热线：400-660-0109

网址：www.gjzq.com.cn

(29) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 号楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 号楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：王一彦

客户服务热线：400-888-8588、95531

网址：www.longone.com.cn

(30) 西藏同信证券有限责任公司

住所：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：曹亦思

客户服务热线：400-881-1177

网址：[www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

(31) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：王薇

电话：021-32229888

传真：021-62878783

联系人：戴莉丽

客户服务热线：021-63340678

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

(32) 东莞证券有限责任公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

电话：0769-22116557

传真：0769-22119423

联系人：柯天池

客户服务热线：0769-961130

网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

(33) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富中心财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656

传真：0931-4890118

联系人：邓鹏怡

客户服务热线：400-689-8888

网址：www.hlzqgs.com

(34) 联讯证券有限责任公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

电话：0752-2119397

传真：0752-2119396

联系人：郭晴

客户服务热线：400-8888-929

网址：www.lxzq.com.cn

(35) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦 16F

法定代表人：兰荣

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

联系人：夏中苏

客户服务热线：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(36) 大同证券经纪有限责任公司

住所：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层

法定代表人：董祥

电话：0351-7219303

联系人：张冠

客户服务热线：4007121212

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

(37) 中国国际金融股份有限公司

住所：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166

联系人：杨涵宇

客户服务热线：400-910-1166

网址：[WWW.CICC.COM.CN](http://WWW.CICC.COM.CN)

(38) 德邦证券股份有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

客户服务热线：95353

网址：<http://www.tebon.com.cn>

(39) 东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区星阳街5号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

电话：0512-62938521

联系人：陆晓

客户服务热线：400-860-1555

网址：<http://www.dwjq.com.cn/>

(40) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

住所：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦16号

法定代表人：张冠宇

电话：010-53570573

传真：010-59200800

联系人：刘美薇

客户服务热线：400-819-9868

网址：<http://www.tdyhfund.com/>

3、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调整为本基金的销售机构，并及时公告。

(二) 登记机构

名称：天弘基金管理有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人：井贤栋

电话：(022) 83865560

传真：(022) 83865563

联系人：薄贺龙

(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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、孙睿

联系人：孙睿

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办注册会计师：薛竞、周祎

联系人：周祎

#### 四、基金的名称

本基金名称：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：混合型基金

#### 六、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，利用公司大数据研究优势优选与居民生活密切相关的大消费及相关行业的优质企业进行投资，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资对象是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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、股指期货及法律法规或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。

#### 八、基金的投资策略

本基金采取灵活资产配置、主动投资管理的投资模式。在投资策略上，本基金从两个层次进行，首先是进行大类资产配置，在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险，把握市场波动中产生的投资机会；其次是充分发挥公司大数据研究平台的优势，通过建立量化模型优选具有良好投资价值的投资品种，构建投资组合。

## 1、资产配置策略

本基金通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场研判进行前瞻性的资产配置决策。在大类资产配置上,本基金将通过对各种宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、货币供应增长率、市场利率水平等)的分析和预测,研判宏观经济运行所处的经济周期及其演进趋势,同时,积极关注财政政策、货币政策、汇率政策、产业政策和证券市场政策等的变化,分析其对不同类别资产的市场影响方向与程度,通过考察证券市场的资金供求变化以及股票市场、债券市场等的估值水平,并从投资者交易行为、企业盈利预期变化与市场交易特征等多个方面研判证券市场波动趋势,进而综合比较各类资产的风险与相对收益优势,结合不同市场环境下各类资产之间的相关性分析结果,对各类资产进行动态优化配置,以规避或分散市场风险,提高并稳定基金的收益水平。

## 2、股票投资策略

在股票投资方面,本基金侧重中观和微观分析,利用公司大数据研究平台对大消费行业的海量数据(包括电商数据、上市公司数据、国家权威机构公开数据以及其他第三方数据等)进行综合分析,结合宏观研究结果,对行业景气度进行综合排序,筛选出值得重点投资的子行业;在个股选择上,本基金侧重自下而上的研究方法,对上市公司所处的成长阶段、盈利模式、管理团队、创新能力等核心要素进行综合判断,通过公司大数据量化模型筛选出符合电商、互联网发展趋势、与居民生活密切相关的消费类优质公司进行重点投资。

### (1) 大消费行业的界定

本基金将充分利用电商数据和公司大数据研究平台的优势,对受益于电商和互联网发展趋势的大消费行业进行重点投资,界定如下:

1) 易于借助电商平台和互联网工具销售产品和服务的传统行业,主要包括食品饮料、家电、纺织服装、轻工制造、传媒、消费电子等;

2) 易于借助电商平台和互联网工具提高原有运营效率的传统行业,主要包括商贸零售、餐饮旅游等;

3) 未来有望借助电商平台及互联网工具提高自身竞争优势的传统行业,主要包括医药、农业等。

本基金管理人将根据电商、互联网及消费产业发展的最新动态,对大消费行业

的范围进行动态调整。

### (2) 行业精选策略

本基金作为主要投资于大消费及其相关行业的基金,通过定性和定量相结合的方法,对子行业的成长阶段、景气程度、发展趋势、增长速度、竞争格局、创新空间等要素分析,得出子行业相对优势的排序,并对排名靠前的子行业进行重点投资。

在影响股价表现的诸多因素中,行业(公司)的成长性、周期阶段、主题因素和信息差几个方面最为重要,分别影响股价表现的年k线、月k线、周k线和日k线,本基金将主要捕捉属于年k线和月k线的投资机会。

行业的统计数据(包括官方权威数据和第三方数据等)是对行业发展情况较好的量化反映,但是传统的数据来源存在着针对性不够、时效性不强、精确度不高的缺点,本基金将利用公司大数据平台,整合海量数据,针对性的建立量化模型并进行数据分析,科学筛选有投资价值的子行业。此外,本基金将依据不同子行业的特点差异化地调整量化模型,不断提高模型的准确度。

### (3) 个股投资策略

本基金在行业配置的基础上,通过定性和定量研究相结合的办法,在综合排序靠前、具有发展前景的子行业中挑选出优质上市公司进行重点投资。

#### 1) 定性研究

对于优质公司的选择标准,成长空间、盈利模式、公司治理几个因素最为重要:

A、公司业务的天花板:本基金优先选择行业或公司成长天花板较高的公司;在满足成长空间条件下,选择在行业中处于优势竞争地位的公司,比如符合护城河宽、品牌力强、定价能力强、增长迅速等条件的上市公司。

B、公司的盈利模式:公司需要有清晰、稳定的盈利模式,并且该盈利模式可持续、难复制、符合政策指引方向和社会发展的趋势。

C、公司治理方面:公司是否有清晰、合理的发展战略,是否具有良好的治理结构,管理团队的品质、格局、进取心、执行能力都是重要的考虑因素。

#### 2) 定量研究

本基金将对反映行业和公司发展现状、未来前景、市场表现的各种数据进行综合分析,以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。

A、成长性指标:收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等;

B、财务指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等；

C、估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值。

### 3、债券等固定收益类资产的投资策略

本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据不同债券类金融工具的到期收益率、流动性和市场规模等情况，并结合各债券品种之间的信用利差水平变化特征、宏观经济变化以及税收因素等的预测分析，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，对各类债券金融工具进行优化配置，力求规避风险并实现基金资产的保值增值。

#### （1）久期选择

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

#### （2）收益率曲线分析

本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响之外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期，并适时调整基金的债券投资组合。

#### （3）债券类属选择

本基金根据对金融债、企业债（公司债）、可转债等债券品种与同期限国债之间利差（可转债为期权调整利差（OAS））变化分析与预测，确定不同类属债券的投资比例及其调整策略。

#### （4）个债选择

本基金根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。对于含权类债券品种，如可转债等，本基金还将结合公司基本面分析，综合运用衍生工具定价模型分析债券的内在价值。

#### (5) 信用风险分析

本基金通过对信用债券发行人基本面的深入调研分析,结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

#### (6) 中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,并限制投资者数量上限,整体流动性相对较差。同时,受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。本基金将采用谨慎投资策略进行中小企业私募债券的投资,在重点分析和跟踪发债主体的信用基本面基础上,综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素,确定具体个券的投资策略。

#### 4、权证投资策略

本基金将从权证标的证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行分析,以有利于资产增值为原则,加强风险控制,谨慎参与投资。

#### 5、股指期货等投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产证券化产品的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基

金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### 九、业绩比较基准

本基金投资业绩的比较基准为： $60\% \times$  中证主要消费指数收益率 $+40\% \times$  中证综合债指数收益率。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人和基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

### 十、风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 10 月 13 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至 2015 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	882,455,058.18	76.28
	其中：股票	882,455,058.18	76.28
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
	其中：权证	-	-
4	买入返售金融资产	187,000,000.00	16.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	23,451,442.85	2.03
6	其他各项资产	63,940,098.96	5.53
7	合计	1,156,846,599.99	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	95,838,154.44	9.32
B	采矿业	-	-
C	制造业	482,586,247.47	46.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,181,166.00	1.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,749,213.90	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	122,871,888.94	11.95
H	住宿和餐饮业	8,825,514.25	0.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,715,535.80	2.11
J	金融业	10,082,224.00	0.98

K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	29,183,876.16	2.84
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	70,085,209.44	6.82
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	11,336,027.78	1.10
S	综合	—	—
	合计	882,455,058.18	85.81

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300152	燃控科技	1,389,924	63,589,023.00	6.18
2	600029	南方航空	2,540,900	36,944,686.00	3.59
3	600115	东方航空	2,280,791	28,099,345.12	2.73
4	002429	兆驰股份	2,173,151	28,033,647.90	2.73
5	000998	隆平高科	984,831	26,688,920.10	2.60
6	002714	牧原股份	444,530	26,111,692.20	2.54
7	600559	老白干酒	311,624	26,026,836.48	2.53
8	600703	三安光电	767,110	24,010,543.00	2.33
9	000089	深圳机场	2,006,760	22,636,252.80	2.20
10	300422	博世科	208,050	22,240,545.00	2.16

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3) 基金的其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	598,015.69
2	应收证券清算款	61,126,352.95
3	应收股利	—
4	应收利息	11,621.11
5	应收申购款	2,204,109.21
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	63,940,098.96

(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流通受限情况的说明

本基金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

计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本基金合同生效日 2015 年 3 月 17 日，基金业绩数据截至 2015 年 6 月 30 日。

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	净值增长率 ①	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
自基金合同 生效日起至 今（2015 年 3 月 17 日 -2015 年 6 月 30 日）	16.76%	2.46%	17.36%	1.56%	-0.60%	0.90%

注：本基金业绩比较基准为： $60\% \times$  中证主要消费指数收益率  $+40\% \times$  中证综合债指数收益率。

## 十三、基金费用与税收

### （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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易或结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；

- 8、证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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要求，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2015年2月6日公告的《天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“一、重要提示”部分，增加了基金合同的生效日期，及招募说明书更新的时间要求；
- 2、在“三、基金管理人”部分，对管理人管理基金的基本信息及公司部门设置情况进行了更新；
- 3、在“三、基金管理人”部分，对董事会成员信息、投资决策委员会成员及其管理的基金进行了更新；
- 4、在“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的内容做了相应的更新；
- 5、在“五、相关服务机构”部分，增加了新的代销机构；
- 6、在“七、基金的募集”部分，增加了基金募集结果的描述；
- 7、在“八、基金合同的生效”部分，更新了相关信息；
- 8、在“十二、基金投资组合报告”部分，按有关规定补充了本基金近一期投资组合报告的内容；
- 9、在“十三、基金的业绩”部分，更新了基金业绩数据，并经基金托管人复核。

10、在“二十五、其他应披露的事项”部分，对本次更新内容期间的历次公告进行了补充。

天弘基金管理有限公司

二〇一五年十月三十日