

(上接B031版)

法定代表人:赵学军
联系人:汪舒东
电话:010-85092367
传真:010-85097208
客服热线:400-021-8850
网址:https://www.harvestwm.cn/
(二) 本基金委托场外发售机构
1. 直销机构 (C类)
名称:中欧基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层
办公地址:上海虹口区公平路18号8楼-嘉昱大厦7层
法定代表人:裘玉明
联系人:袁维
电话:021-68909602
传真:021-68909601
客服热线:021-68609700,400-700-9700(免长途话费)
网址:www.zofund.com
2. 代销机构 (C类)
1) 名称:招商银行股份有限公司
住所:广东省深圳市福田區深南大道7088号
办公地址:广东省深圳市福田區深南大道7088号
法定代表人:李建红
联系人:邓翩翩
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
客服热线:95555
公司网站:www.cmbchina.com
2) 名称:大连银行股份有限公司
住所:辽宁省大连市中山区中山路88号
办公地址:辽宁省大连市中山区中山路88号
法定代表人:陈占维
联系人:沈宗达
电话:0411-82231936
传真:0411-82231731
客服热线:74006640099
网址:www.bankofdl.com
3) 名称:国都证券股份有限公司
住所:北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:李绍华
联系人:黄静
电话:010-84183389
传真:010-64482090
客服热线:400-818-8118
网址:www.guodu.com
4) 名称:中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市经七路96号
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路66号
法定代表人:李玮
联系人:马晓男
电话:021-20315255
传真:021-20315137
客服热线:95538
网站:http://www.zts.com.cn
5) 名称:财通证券股份有限公司
住所:杭州市拱墅区大隐15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716
办公地址:浙江省杭州市拱墅区大隐15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716
法定代表人:沈继平
联系人:周志华
电话:0571-87789160
传真:0571-87818329
客服热线:95336,40086-96336
网址:www.ctsec.com
6) 名称:深圳众城基金销售有限公司
住所:深圳市福田区深南东路5047号发展银行大厦12J单元
办公地址:深圳市福田区深南东路5047号发展银行大厦25楼12J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227953
传真:0755-43208798
客服热线:4006-788-887
众城基金销售网:www.zjfund.cn
基金委官网:www.jamvc.com
7) 名称:诺正证正(上海)基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
联系人:朱婉敏
电话:021-38602377
传真:021-38509777
客服热线:400-821-5399
网址:www.nuozheng-fund.com
8) 名称:杭银(杭州)基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道江南大道388号恒生大厦12楼
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道388号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:徐梦菲
电话:0571-28829790
传真:0571-26698533
客服热线:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
9) 名称:中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F
法定代表人:林爽斐
联系人:孙莹
电话:010-59336519
传真:010-59336500
客服热线:400-690-9998
网址:www.jnlc.com
10) 名称:北京肯特瑞财富管理咨询有限公司
住所:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座京东集团总部
法定代表人:陈超
联系人:赵德慧
电话:18600280566
传真:010-89138800
客服热线:4000888511 4000888816
网址:http://fund.jkrcm.com/
11) 名称:上海华夏财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:李一梅
联系人:仲秋明
电话:010-88066632
传真:010-88066532
客服热线:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
12) 名称:北京京成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号11层B座A1109号
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层B座A1108号
法定代表人:王伟刚
联系人:陈小小
电话:010-56341771/13466546744
传真:010-62868027
客服热线:4006199069
网址:www.jccj.com.cn
13) 名称:上海挖财金融信息服务有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01,02,03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01,02,03室
法定代表人:胡燕飞
联系人:李娟
电话:021-50810687
传真:021-58300279
客服热线:021-50810673
网址:www.wacaijin.com
14) 名称:嘉实财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期3层312-15单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系人:汪舒东
电话:010-85092367
传真:010-85097308
客服热线:400-021-8850
网址:https://www.harvestwm.cn/
(三) 本基金委托的场外发售机构
1. 直销机构 (E类)
名称:中欧基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层
办公地址:上海虹口区公平路18号8楼-嘉昱大厦7层
法定代表人:裘玉明
联系人:袁维
电话:021-68909602
传真:021-68909601
客服热线:021-68609700,400-700-9700(免长途话费)
网址:www.zofund.com
2. 代销机构 (E类)
1) 名称:招商银行股份有限公司
住所:广东省深圳市福田區深南大道7088号
办公地址:广东省深圳市福田區深南大道7088号
法定代表人:李建红
联系人:邓翩翩
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
客服热线:95555
公司网站:www.cmbchina.com
2) 名称:广东顺德农村商业银行股份有限公司
住所:广东省佛山市顺德区大良新城区新展路2号
办公地址:广东省佛山市顺德区大良新城区新展路2号
法定代表人:姚真真
联系人:胡健强
电话:0757-22396489
传真:0757-22382326
客服热线:0757-22223388
网址:www.sdbank.com
3) 名称:广东南海农村商业银行股份有限公司
住所:广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北26号
办公地址:广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北26号
法定代表人:李宜心
联系人:吴泳雄
电话:0757-86369612
传真:0757-86250627
客服热线:96138
网址:www.nanhai-bank.com
4) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:刘国义
联系人:唐珉
电话:021-61618888
传真:021-63604199
客服热线:96269
网址:www.spdb.com.cn
5) 名称:大连银行股份有限公司
住所:辽宁省大连市中山区中山路88号
办公地址:辽宁省大连市中山区中山路88号
法定代表人:陈占维
联系人:沈宗达
电话:0411-82231936
传真:0411-82231731
客服热线:74006640099
网址:www.bankofdl.com
6) 名称:中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市经七路96号
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路66号
法定代表人:李玮
联系人:马晓男
电话:021-20315255
传真:021-20315137
客服热线:95538
网站:http://www.zts.com.cn
7) 名称:平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:谢永林
联系人:周一涵
电话:021-38627466
传真:0755-42434367
客服热线:95511-8
网址:www.stock.pingan.com
8) 名称:财通证券股份有限公司
住所:浙江省杭州市大隐15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716
办公地址:杭州市拱墅区大隐15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716
法定代表人:沈继平
联系人:周志华
电话:0571-87789160
传真:0571-87818329
客服热线:95336,40086-96336
网址:www.ctsec.com
9) 名称:上海好易基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人: 杨文斌
联系人: 张茹
电话: 021-20613999
客服热线: 400-700-9665
网址: www.howbuy.com
10) 名称: 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
住所: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人: 汪静波
联系人: 张姚杰
电话: 021-38602377
传真: 021-38500777
客服热线: 400-821-5399
网址: www.noah-fund.com
11) 名称: 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东号
办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈柏青
联系人: 徐海峰
电话: 0571-28029790
传真: 0571-26695833
客服热线: 4000-766-123
网址: www.fund123.cn
12) 名称: 上海陆金所资产管理有限公司
住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人: 郭坚
联系人: 宁博宇
电话: 021-20665652
传真: 021-22066653
客户热线: 400-821-9031
网址: www.lufunds.com
13) 名称: 上海汇付基金销售有限公司
住所: 上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址: 上海市宜山路700号百度信息产业园2期C栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人: 冯敬敏
联系人: 陈广平
电话: 021-33323999
传真: 021-33323837
客服热线: 400-821-3999
网址: www.huiyifund.com
14) 名称: 珠海盈米财富管理有限公司
住所: 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
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
联系人: 黄敏豪
电话: 020-89629009
传真: 020-89629011
客户热线: 020-89629099
网址: www.yingmi.com.cn
15) 名称: 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F
法定代表人: 钱昊雯
联系人: 孙雯
电话: 010-59336519
传真: 010-59335000
客服热线: 400-880-8808
网址: www.jinnc.com
16) 名称: 上海利得基金销售有限公司
住所: 上海市虹口区临潼路1188号5476号1033室
办公地址: 上海市浦东新区康桥路91弄611号10楼12楼
法定代表人: 李兴春
联系人: 徐鹏
电话: 021-50583533
传真: 021-50583533
客服热线: 400-921-7755
网址: www.lidfund.com.cn
17) 名称: 深圳前海微众银行股份有限公司
住所: 深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201
办公地址: 深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼
法定代表人: 顾敏
联系人: 梁文
电话: 0755-89462721
客服热线: 400-999-8800
网址: www.webank.com
18) 名称: 上海联泰资产管理有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区路277号3层3103室
办公地址: 上海市长宁区江苏北路518号8层3层
法定代表人: 燕斌
联系人: 王晨
电话: 021-52922063
传真: 021-52975270
客服热线: 4000-466-788
网址: www.66zichuan.com
19) 名称: 北京度鑫基金销售有限公司
住所: 北京市朝阳区阜成路1号10层6号楼2单元21层
办公地址: 北京市朝阳区阜成路大街1号院6号楼2单元21层
法定代表人: 邢建英
联系人: 吴季林
电话: 010-61840688
传真: 010-61840699
客服热线: 400-818-518
网址: http://danuanyuan.com
20) 名称: 天津国美基金销售有限公司
住所: 天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室
办公地址: 北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人: 丁东华
联系人: 郭克敏
电话: 010-59287984
传真: 010-59287825
客服热线: 400-111-0889
网址: www.gomefund.com
21) 名称: 北京广源达信投资管理有限公司
住所: 北京市西城区新街口外大街28号C座605室
办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区13号楼润康中心B座19层
法定代表人: 齐剑峰
联系人: 王莉
电话: 13911468997
传真: 010-92065960
客服热线: 400-623-6960
网址: www.niuulfund.com
22) 名称: 北京万得基金销售有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴东路331111楼8楼
办公地址: 上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦1楼
法定代表人: 王廷富
联系人: 徐亚平
电话: 021-51327185
传真: 021-50710161
客服热线: 400-821-0203
网址: 暂无
23) 名称: 北京新浪乐石基金销售有限公司
住所: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层B18室
办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层B18室
法定代表人: 李昭理
联系人: 付文红
电话: 010-62760405
传真: 010-62760342
客服热线: 010-62675369
网址: www.xincai.com
24) 名称: 上海鑫乔投资管理有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层, 200127
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层, 200127
法定代表人: 戴新装
联系人: 江晖
电话: 021-20639898
传真: 021-20639999
客服热线: 400-820-1515
网址: www.zhengtongfunds.com
25) 名称: 北京肯瑞财富投资管理有限公司
住所: 北京市西城区中关村大街11号E世界A座1108号
办公地址: 北京市西城区中关村大街11号E世界A座1108号
法定代表人: 王博刚
联系人: 董小满
电话: 010-56251471/13466546744
传真: 010-68808027
客服热线: 4000195699
网址: www.bceji.com.cn
26) 名称: 上海挖财金融信息服务有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02_03室
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01_02_03室
法定代表人: 李娟
联系人: 胡燕飞
电话: 021-50810687
传真: 021-50830079
客服热线: 021-50010673
网址: www.wacaijin.com
基金管理人可以根据实际情况变化, 增加或者减少代销机构, 并另行公告。销售机构可以根据情况变化, 增加或者减少其销售机构、网点, 并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异, 具体请咨询各销售机构。
三、注册服务机构
本基金A类份额注册登记机构如下:
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
法人代表: 周明
联系人: 赵亦清
电话: 010-59338762
传真: 010-59338828
本基金C、E类份额注册登记机构信息如下:
名称: 中国基金资产管理有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦7层
办公地址: 上海市虹口区公平路18号8楼-嘉盛大厦7层
法定代表人: 龚玉明
总经理: 刘建平
成立日期: 2008年7月19日
电话: 021-68609600
传真: 021-68609601
联系人: 杨超
四、出具法律意见书的律师事务所
律师事务所名称: 上海市锦天城律师事务所
住所: 上海市银城中路68号时代金融中心11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: 卫建峰
经办律师: 吕红、安冬
电话: 021-31358666
传真: 021-31358600
联系人: 安冬
五、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: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银银行大厦6楼
办公地址: 上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道11楼
负责人: 李丹
电话: 021-23238189
联系人: 俞俊敏
经办注册会计师: 许康伟、俞俊敏
四、部分基金名称
中欧盛世成长混合型证券投资基金(COF)
五、部分基金类型
契约型 开放式
六、部分基金的投资目标
把握中国经济发展主题, 在合理估值的基础上, 投资于行业成长性优良, 个股盈利持续增长的上市公司股票, 追求基金资产的长期增值。
七、部分基金的投资范围
本基金投资于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, 包括科创板、创业板及科创板上市的红筹企业发行的股票, 债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和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)。
本基金的投资组合比例为: 股票、权证等权益类资产占基金资产的90%-95%, 其中中国A股资产比例不超过基金资产净值的30%; 债券等固定收益类资产以及现金类资产占基金资产的5%-10%, 其中现金、国债、金融债、企业债、资产支持证券等资产投资于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%。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具, 本基金管理人在履行适当程序后, 可将其纳入基金投资范围。
八、部分基金的投资策略

本基金在资产配置方式上“自下而上”地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在权益类资产投资品中，以自上而下的资产配置策略为基础，精选优势行业中的优质个股来确定具有投资价值证券投资品种。本基金的资产配置方式如下：

1、资产配置策略

本基金的投资策略以记号卡体系为基础。本基金在记号卡体系中设定影响证券市场前景的相关方面，包括宏观经济预期、上市公司盈利能力和、股票市场价格水平、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和打分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有其量化的赋值。加权上述各方面得分之和即可得到资产配置加评分。本基金据此调整股票资产配置策略。

（1）经济周期与行业分析

各行业变动时，往往呈现出较为明显的、可预测的规律或趋势性的特征。这些变动与国民经济总体的周期密切相关，但不同行业变动的幅度又不一样。据此，可以将行业分为三类。

1)领先型行业

增长行业的运行状态与经济活动总水平的周期及其振幅并不紧密相关。这些行业收入增长的速率并不总是随着经济周期的变动而出现同步变动，因为它们主要依靠技术的新产品推出及更优质的服务，从而使其经常处在增长状态。

本基金将重点投资于增长型行业，因为这些高增长的行业受到国民经济的周期性波动的影响较小。在经济高涨时，高增长行业的发展速度通常高于平均水平；在经济衰退时期，其所受负面影响小甚至仍能保持一定的增长。

2)周期型行业

周期型行业的运行状态与经济周期密切相关，当经济处于上升时期，这些行业会紧随其扩张；当经济衰退时，这些行业也会相应的萎缩，且该类型行业收益的波动幅度往往会在一定程度上放大经济的周期性。该类行业的产品需求受到经济景气、行业增长速度的较大影响。此类行业的产品或服务往往具有较高的附加值。因此，本基金将积极寻找宏观经济景气、行业增长速度到一个适度水平、行业发展可能难以与成熟企业后起而追平的行业；如果行业的营业收入与国民经济整体指标指向相同方向，说明该行一行业很可能是周期型行业；如果行业的营业收入与国民经济整体指标呈现不同方向的不同幅度的变化都保持相对稳定，说明该行业是防守型行业。

（2）成长型行业的具体识别

1)行业生命周期

通常，每个行业都要经历一个由小到大地调整到衰退的发展演变过程。这个过程便称为行业的生命周期。一般来说，行业的生命周期可以分为幼稚期、成长期、成熟期和衰退期。

A、幼稚期：是指一个新行业刚刚形成，尚未有足够多的产品和服务来满足市场的需要，往往面临较大的市场风险，而且还可能因为财务困难而引发破产倒闭。因此本基金原则上不投资于幼稚期行业。

B、成长期：是指行业的工作上开始非常迅速，部分优秀企业能够脱颖而出，企业的资源往往也能获得较高的投入回报。本基金将积极寻找符合成长期的优质上市公司进行投资。

C、成熟期：是指行业的工作上开始非常迅速，部分优秀企业能够脱颖而出，企业的发展可能难以与成熟企业后起而追平。但由于技术创新、产业政策、经济全球化等各种原因，某些行业可能会在迈入成熟期之后重新回到成长期。本基金将根据成长性综合在稳健收益资本利得两类资本增值方式之中中长期合理的性价比适度投资于成熟期以上的上市公司。

D、衰退期：是指行业的工作上开始市场减少，收入利润增长停滞甚至不断下降的局面。因此本基金原则上不投资于衰退期行业。

2)行业成长能力的考察

本基金主要从以下三个方面考察行业的成长能力：

A、需求弹性。一般而言，需求弹性较高的行业成长能力较强，容易保持优势地位，其成长能力也强。

B、生产技术。技术进步快的行业，创新能力较强，生产效率高，竞争力强，其成长能力也强。

C、产业关联度。产业关联度是指产业与企业之间通过产品供需而形成的相互关联、互为存在前提的关系体系。产业关联较强的行业，成长能力也强。

D、行业集中度。行业集中度是指行业内企业数量与行业总资产之比，其成长空间也大。

E、行业在空间的转移能力。行业在空间转移能力停止，一般可以说明行成长达到市场预期边界，成长期也就结束尾声。

F、产业结构调整变化。在行业成长过程中，一般伴随着行业中企业组织不断向集团化、大型化方向发展。

3)影响行业发展的主要因素

一个行业的兴衰会受到技术进步、产业政策、产业结构创新、社会习惯改变和经济全球化等因素的影响而发生发展，这些因素都会对行业在其生命周期上的发展轨迹造成影响。基金管理人将密切关注可能影响行业发展的主要因素，及时发现并积极投资于处于高速增长期行业。

3、个股投资策略

个股投资策略适用于对于资产配置策略的具体落实。本基金将在资产配置策略的框架下，精选优质股票构建投资组合，在获取投资收益实现资产配置收益的同时，最大化个股投资收益。

(1) 选股原则

备选股票库由上市公司调研团队负责建设和维护。投资团队通过对分析上市公司公告信息、上市公司对外业务考察、上市公司实地调研等，跟踪上市公司未来盈利成长前景，并据此申请股票列入备选股票库，履行履行入库审批程序；同时，根据行业和上市公司基本面的变化对备选股票库进行动态维护和更新。

(2) 个股的选择

在完成个股选择的基础上，本基金将以“优中选优”的思路筛选出优质行业中的优质公司进行投资。以上市公司的历史成长性在未来两年的预期成长性为核心，通过对上市公司所在行业中的地位、市场占有率和盈利能力在内外部竞争优势、企业经营管理能力及研发能力等方面因素进行综合评价，选择那些预期未来发展前景好于行业平均水平，并有可能在长期持续取得较高成长性的企业进行投资。

在个股选择过程中，本基金将挑选出符合基本面良好和流动性充裕的股票。本基金将根据同行业上市公司的不同行业特征，选择不同类型的股票组合方法，包括PE、PB、PEG、EV/EBITDA等，与国内外行业龙头公司对比。市场交易活跃度、估值水平、主要财务指标处于合理水平或低于估值水平。

4、固定收益类资产投资策略

本基金在对利率走势的预期，对固定收益资产组合的收入期限进行匹配管理。当预期利率下降时，增加组合久期，以获得债券价格上涨带来的收益；当预期利率上升时，减小组合久期，以避免债券价格下跌的损失。

本基金在确定固定收益资产组合久期后，针对收益率曲线形态确定合理的组合期限结构，包括采用短期国债、短融资券和中期票种等，在长期、中期和短期债间进行动态调整。

5、权证及其他品种投资策略

本基金将结合权证定价模型及权证发行人的财务状况、信用状况、行权价格和行权时间等因素，对权证的基本面研究和未来走势预期，估算其公允价值，同时综合考虑为考虑标的流通性，谨慎进行投资。

第九部分基金业绩比较基准

业绩比较基准：沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

沪深300指数样本覆盖了沪深市场总市值最大的300只A股上市公司，具有良好的市场代表性。沪深300指数交易所第一次公布发布的反映了沪深两市整体走势的指数。它的推出，丰富了市场现有的指数体系，增加了一项用于观察沪深两市走势的指标，有利于投资者全面把握市场动向状况。

中证全债指数是由中证指数有限公司编制的反映境内债券市场和货币市场整体表现的跨市场债券指数，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由全国银行间债券市场和交易所市场国债、金融债、企业债、可转债、中证国债等每日计算日收市价的全额收盘数据及相应的债券市场成交数据，为债券投资者提供分析工具和市场参考指数。该指数的一个重要特点在于对异常价格和不利情况进行了剔除，能更为真实地反映债券市场的价值与趋势特征。

沪深300指数和中证全债指数具有广泛的市场代表性和透明度，选用该业绩比较基准能够为投资本基金的风险收益特征，同时也能够较好地体现风险和衡量本基金的投资目标、投资策略以及资产配置效果。

自未来市场环境发生变化导致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变化和基金本身的投资目标和投资策略，调整本基金业绩比较基准，业绩基准的调整须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列明，并经中国证监会备案。

第十部分基金的风险投资策略

本基金为混合型基金，具有较高风险、收益预期较高的特征，其风险和预期收益均高于货币基金市场和债券型基金，低于股票型基金。

第十一部分基金的主要投资风险

基金管理人的人事及董事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。

6、内幕信息：指未公开披露的信息，违反了证券法规定，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告期内所披露截至自基金2018年第三季度报告，所披露截至至2018年9月30日，本报告期内所有财务报表未经审计。

1 沪港深基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	517,030,941.62	82.56
	其中:股票	517,030,941.62	82.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	资产管理支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	9.58
	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	46,889,752.04	7.49
8	其他资产	2,340,769.42	0.38
9	合计	626,261,462.08	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	236,773,304.47	37.74
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	108,659,717.18	17.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	172,657,884.97	27.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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		517,030,941.62	82.77

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股股票。

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	000061	长春高新	197,119	46,717,203.00	7.48
2	600038	中直股份	1,087,260	43,736,783.00	7.03
3	300523	汇川技术	2,867,960	42,642,341.00	6.86
4	600883	航发动力	1,749,422	41,850,517.38	6.70
5	002007	华兰生物	1,047,382	39,686,777.88	6.36
6	601021	春秋航空	1,008,548	39,460,650.56	6.32
7	600670	阳光电源	702,568	38,989,834.48	6.21
8	002298	禾赛科技	1,222,420	37,440,161.69	6.00
9	603885	吉祥航空	2,763,842	36,913,744.92	5.91
10	601111	中国航航	3,954,038	32,225,400.70	5.16

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的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告

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。

1.5 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。

1.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告中国债基金买入原因,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在误差。

第十二部分 基金的业绩

本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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件。

本基金合同生效日2012年3月29日,基金业绩截止日2018年3月31日。

本报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

①中收基金成长份额股票型证券投资基金成立以来的业绩如下:

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
2012.3.29(中收基金成长份额股票型证券投资基金合同生效日)-2015.12.31	2.10%	0.75%	2.46%	0.89%	-0.36%	-0.14%
2015.1.1-2015.12.31	37.90%	15.3%	-5.64%	1.06%	43.54%	0.48%
2016.1.1-2016.12.31	32.76%	1.20%	40.69%	0.91%	-8.93%	0.29%
2017.1.1-2017.12.31	31.24%	1.22%	11.26%	1.37%	19.98%	-0.15%
2018.1.1-2018.3.31	14767%	1.23%	52.47%	1.00%	95.20%	0.23%

②中收基金成长份额股票型证券投资基金(LOP)的业绩如下:

③中收基金成长混合型证券投资基金(LOP)A类份额

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
2015.3.31(转型为中收基金成长混合型证券投资基金合同生效日)-2015.12.31	36.20%	3.08%	-3.72%	1.56%	39.92%	1.10%
2016.1.1-2016.12.31	-11.16%	1.53%	-7.71%	1.06%	-3.45%	0.48%
2017.1.1-2017.12.31	16.49%	0.82%	15.50%	0.48%	0.98%	0.34%
2018.1.1-2018.6.30	-16.60%	1.29%	-8.73%	0.89%	-7.96%	0.43%
2018.1.1-2018.9.30	-17.33%	1.37%	-9.73%	0.92%	-7.60%	0.45%
2015.3.31(转型为中收基金成长混合型证券投资基金合同生效日)-2018.9.30	16.53%	1.85%	-7.02%	1.19%	23.55%	0.66%

④中收基金成长混合型证券投资基金(LOP)C类份额

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
2015.10.8-2015.12.31	24.84%	2.00%	6.00%	1.21%	17.94%	0.79%
2016.1.1-2016.12.31	-10.94%	1.53%	-7.71%	1.06%	-3.22%	0.48%
2017.1.1-2017.12.31	16.57%	0.82%	15.50%	0.48%	0.64%	0.34%
2018.1.1-2018.6.30	-16.68%	1.29%	-8.73%	0.89%	-7.95%	0.43%
2018.1.1-2018.9.30	-17.31%	1.37%	-9.73%	0.92%	-7.58%	0.45%
2015.10.8-2018.9.30	16.93%	1.39%	3.24%	0.88%	13.69%	0.51%

⑤中收基金成长混合型证券投资基金(LOP)E类份额

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
2017.1.13-2017.12.31	16.73%	0.82%	15.69%	0.48%	1.04%	0.34%
2018.1.1-2018.6.30	-16.83%	1.29%	-8.73%	0.89%	-8.10%	0.43%
2018.1.1-2018.9.30	-17.54%	1.37%	-9.73%	0.92%	-7.81%	0.45%
2017.1.13-2018.9.30	-3.76%	1.10%	4.43%	0.71%	-8.18%	0.39%

数据来源:中收基金

基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金转型日期为2015年3月30日。

注:本基金于2015年10月8日新增E份额,图示日期为2015年10月13日至2018年09月30日。

注:本基金于2017年1月12日新增C类份额,图示日期为2017年1月13日至2018年09月30日。

第十三部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 基金管理人的管理费;
- 基金托管人的托管费;
- 基金的销售服务费;
- (基金合同)生效后与基金相关的信息披露费用;
- (基金合同)生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
- 基金份额持有人大会费用;
- 基金的证券/期货交易费用;
- 基金的银行汇划费用;
- 基金的相关账户的开户费;
- 按照国家有关规定和《基金合同》约定,应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

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:

$$H = E \times \text{年费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

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前日起个工作日内由基金管理人一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力,则顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

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:

$$H = E \times \text{年费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

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前日起个工作日内由基金管理人一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力,则顺延至最近可支付日支付。

3、基金的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.80%,销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.80%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额前一日应计提的基金销售服务费

4、为C类基金份额前一日计提的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,累计计算至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中支付到指定账户。基金销售服务费由基金管理人代收,基金管理人收到后按相关法规规定支付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力,则顺延至最近可支付日支付。

三、除管理费、托管费外的其他费用,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,列入当期基金费用。

四、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、会计师费及其他费用不得从基金财产中列支。

五、基金管理人和基金托管人有权根据基金发展情况调减基金管理费和基金托管费。基金管理人调减基金管理费,应提前公告。

六、本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。基金托管人不承担代扣代缴义务。

七、基金招募说明书根据《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》及其他有关规定,并依据本基金合同及本基金的基金合同生效后对本基金实施的投资经营策略,对基金管理人于2018年1月1日发布的《中收基金成长混合型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新,主要更新内容包括:

更新了“重要提示”部分的相关内容;

更新了“本招募说明书所载内容截止日期为2018年9月28日(特别事项注明除外),有关财务数据截止为2018年9月30日(财务数据未经审计)”。

更新了“第三部分 基金管理人”部分的相关内容;

更新了“第四部分 基金管理人、基金托管人、基金销售、投资决策委员会成员的相关信息”。

更新了“第五部分 相关服务机构”部分的相关内容;

更新了“第九部分 基金的业绩”部分的相关内容;

更新了“基金投资组合报告”,所载数据取自本基金2018年第三季度报告,所载数据截至2018年9月30日;

更新了“第十二部分 基金的投资”部分的相关内容;

更新了基金的业绩,业绩截止2018年9月30日的内容;

更新了“第十二部分 其他应披露事项”部分的相关内容;

更新了自2018年9月29日至2018年9月28日刊登于《中国证券报