

(上接B043版)

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼
法定代表人：王作义
客户服务电话：4008-888-228
联系人：马贤清
网站：www.jyzq.cn
(34) 德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市静安区600号城建国际中心26楼
法定代表人：姚文平
客服电话：400-888-8128
联系人：朱磊
公司网站：www.tebon.com.cn
(35) 安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单

元
元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单
法定代表人：王连志
客服电话：400-800-1001
联系人：陈剑虹
网站：www.essence.com.cn
(36) 东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
联系人：王一萍
客服电话：95531;400-8888-588
网站：www.longone.com.cn
(37) 国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
(100007)
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
(100007)
联系人：黄静
客户服务电话：400-818-8118
网站：www.guoducm.com
(38) 财富证券有限责任公司
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
(410005)
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
(410005)
法定代表人：蔡一兵
联系人：郭磊
客服电话：95317
网站：www.cfzq.com
(39) 长江证券股份有限公司
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运训
客户服务热线：95579或4008-888-999
联系人：李良
长江证券客户服务热线：www.95579.com
(40) 国金证券股份有限公司
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
注册地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
客服电话：95310
公司网站：www.gjzq.com.cn
(41) 国靖鑫、贾鹏
(41) 中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）

3001室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：郑慧
公司网站：http://www.cs.ecitic.com/newsite/
客服热线：95548
(42) 西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市宛平南路88号金座
法定代表人：陈宏
联系人：周俊琼
公司网站：www.xzsec.com
客服热线：95357
(43) 西部证券股份有限公司
注册地址：陕西省西安市东新街319号八幢10000室
办公地址：陕西省西安市东新街319号八幢10000室
法定代表人：刘建武
联系人：梁承华
公司网站：www.westsecu.com
客服热线：95582
(44) 中汇证券有限责任公司
注册地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层
办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层
法定代表人：林炳城
联系人：罗艺琳
公司网站：www.zszq.com
客服热线：95329
(45) 万联证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址：广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层
法定代表人：张建军
联系人：甘蕾
公司网站：www.wljq.com.cn
客服热线：400-888-8133
(46) 中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人：姜晓琳
客服热线：95548
联系人：刘晓明
公司网站：http://sd.citics.com/
(47) 西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人：吴坚
联系人：张煜
公司网站：www.swsc.com.cn
客服热线：400-809-6096、95355
(48) 上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海黄浦区南京西路399号明天广场22楼
法定代表人：郭林
客服电话：4008-205-999
联系人：李颖
公司网站：www.shhxxzq.com
(49) 中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张磊
联系人：刘宏奎
公司网站：www.citicsf.com
客服电话：400-990-8826
(50) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路7650号205室
办公地址：上海市静安区长阳路1687号2号楼
法定代表人：汪静波
公司网站：www.noah-fund.com
客服电话：400-821-5399
(51) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人：薛峰
客服电话：4006-788-887
公司网站：www.zlfund.com;www.jmmw.com
(52) 上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区南汇1118号鄂尔多斯国际大厦二楼
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
公司网站：www.ehowbuy.com
(53) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：杭州市西湖区天目山路266号黄龙时代广场B座支付支
法定代表人：陈柏青
客服电话：400-076-6123
(54) 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：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人：其实
客服电话：400-1818-188
公司网站：www.1234567.com.cn
(55) 上海长量基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张经纬
客服电话：4008202899
公司网站：www.erichfund.com
(56) 和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王利
客服电话：400-920-0022
公司网站：http://licaike.hexun.com/
(57) 北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层
法定代表人：闫振杰
客服电话：400-818-8000
公司网站：www.myfund.com
(58) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大厦4层
法定代表人：凌顺平
客服电话：4008-773-772
公司网站：www.5ifund.com
(59) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号院2号通新世界大厦A座2208
法定代表人：吴雪勇
客服电话：400-001-1566
公司网站：www.yilucaifu.com
(60) 上海汇付基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A056单元
办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业园2期C5栋2楼
法定代表人：金浩
客服电话：021-34013966
公司网站：https:// www.hotijijin.com
(61) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：王之光
客服电话：400-821-9031
公司网站：www.lufund.com
(62) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座6层
法定代表人：马勇
客服电话：400-166-1188
公司网站：http://8r.jrj.com.cn/
(63) 上海联泰基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
客服电话：400-166-6788
公司网站：www.66zichan.com
(64) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区泛海国际SOHO城（一期）2301室
办公地址：湖北武汉市江汉区台北一路环亚大厦B座6楼
法定代表人：陶建
客服电话：4000279899
公司网站：www.buyfund.com
(65) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市西城区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人：周斌
客服电话：400-8960-618
公司网站：www.chtwm.com
(66) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
客服电话：4001599288
公司网站：https://danjuanapp.com/
(67) 北京广源达信基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层606室
办公地址：北京市西城区金融大街9号英蓝国际金融中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
客服电话：400-623-6060
公司网站：http://www.1minifund.com
(68) 北京展晟天下基金销售有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21-28层
法定代表人：蒋煜
客服电话：010-58107061
公司网站：www.shengshiview.com
(69) 北京新良金基基金销售有限公司
注册地址：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518室
办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦
法定代表人：李昭琛
客服电话：010-62675369
公司网站：http://www.xincn.com/
(70) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
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1201-1203室
法定代表人：肖雯
客服电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
(71) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址：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）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
公司网站：www.jiyufund.com.cn
(72) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1138号
法定代表人：王伟刚
客服电话：400-619-9069
公司网站：www.hcjjjin.com
(73) 上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥桥27号、明月路1257号1幢11层103-1、103-2办公区
办公地址：上海市浦东新区新金桥金桥路27号1号楼
法定代表人：冯献明
客服电话：400-820-1515
公司网站：www.zhengtongfunds.com
(74) 上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
客服电话：4007991888
公司网站：www.520fund.com.cn
(75) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院a座 17 层
法定代表人：江卉
客服电话：95518/4000888816
公司网站：http://fund.jd.com
(76) 北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人：杨健
客服电话：400-673-7010
公司网站：www.jianfortune.com
(80) 万家财富基金销售有限公司（天津）有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦

2-2413
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人：李修齐
客服电话：010-59013825
公司网站：www.wanjiawealth.com
(81) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号soho现代城C座18层1809
法定代表人：戎兵
客服电话：400-6099-200
公司网站：www.yixinfund.com
(82) 阳光人寿保险股份有限公司
注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦
12层
法定代表人：李科
客服电话：95510
公司网站：http://fund.sinosig.com/
(83) 北京曙腾汇富基金销售有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门内大街8号富华大厦F座12层B
办公地址：北京市东城区朝阳门内大街8号富华大厦F座12层B
法定代表人：李振
客服电话：400-829-1218
公司网站：www.htfund.com
(84) 江苏汇林保大基金销售有限公司
注册地址：南京市高淳区经济开发区古槐大道47号
办公地址：南京市鼓楼区中山北路中环国际1413室
法定代表人：吴言林
客服电话：025-56663409
公司网站：www.huilinbd.com
(85) 嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期505室512-15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
客服电话：400-021-8850
公司网站：www.harvestwm.cn
(86) 深圳盈信基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
办公地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
法定代表人：苗宏升
客服电话：4007903688
公司网站：http://www.fundying.com/
(87) 上海挖财基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼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楼01、02、03室
法定代表人：冷飞
客服电话：400-711-8718
公司网站：www.wacaijijin.com
(88) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址：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：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法定代表人：张卫平
客服电话：400-819-9868
公司网站：https://www.tdyhfund.com
(89) 海银基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人：廖晓鸣
客服电话：400-908-1016
公司网址：www.fundhaiyin.com
(90) 上海中正达广基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欣
客服电话：400-6767-523（021-33635338）
公司网站：www.zhongzhengfund.com
(二) 注册登记机构
名称：泰达宏利基金管理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层
法定代表人：闫莉梅
联系人：石楠
联系电话：010-6657769
传真：010-6657760
(三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
注册地址：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、陈颖华
联系人：陈颖华
（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
法定名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址：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：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心

11楼
法定代表人：赵柏基
电话：021-23238888
客服电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
(71) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址：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）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
公司网站：www.jiyufund.com.cn
(72) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1138号
法定代表人：王伟刚
客服电话：400-619-9069
公司网站：www.hcjjjin.com
(73) 上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥桥27号、明月路1257号1幢103-1、103-2办公区
办公地址：上海市浦东新区新金桥金桥路27号1号楼
法定代表人：冯献明
客服电话：400-820-1515
公司网站：www.zhengtongfunds.com
(74) 上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
客服电话：4007991888
公司网站：www.520fund.com.cn
(75) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院a座 17 层
法定代表人：江卉
客服电话：95518/4000888816
公司网站：http://fund.jd.com
(76) 北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人：杨健
客服电话：400-673-7010
公司网站：www.jianfortune.com
(80) 万家财富基金销售有限公司（天津）有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦
2-2413
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人：李修齐

（5）可转换公司债券投资策略
在综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上，本基金采用Black-Scholes期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，并且基础股票基本面优良、具有较强盈利能力和成长前景好、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种，以合理价格买入并持有。根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等要素构建可转换公司债券投资组合，获取超额投资回报。此外，本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值，通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求选择被市场低估的品种。
3、资产支持证券投资策略
资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将在债券市场宏观分析基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。
4、股票投资策略
本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金将综合运用内部开发的量化选股模型分散化选取具有超额收益潜力的股票。具体而言，本基金的股票投资策略包括多因子选股模型和事件驱动选股模型等。
（1）多因子选股模型
本基金主要运用泰达宏利量化多因子选股模型，从上市公司的成长能力、盈利能力、运营能力以及相关股票的市场情绪、估值、波动等多个维度对股票进行量化分析，获得综合评分，选取其中基本面扎实估值合理的股票，根据投资组合的风险约束，进行分散化投资。
（2）事件驱动模型
本基金将深入分析高管增持、定向增发、并购重组等多类事件对上市公司基本与股价的影响，在充分控制风险的前提下，批量选取具有潜在超额收益可能的股票，提高组合收益。
5、股指期货投资策略
本基金将根据股指期货管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要利用的期货合约数量，对这个数量进行跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。
6、权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的；同时，充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会，实现基金资产的增值。在权证投资中，本基金将对权证证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进行定价。
九、基金的业绩比较基准
1、本基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。
2、选择比较基准的理由
本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数由中证指数有限公司编制，是由沪深A股中规模大、流动性中规模大、流动性好的最具代表300只股票组成，可以综合反映沪深A股市场整体表现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选择是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，以沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。
如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数，更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
十、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
十一、基金的投资组合报告（未经审计）
重要提示
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。
本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月5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。
本投资组合组合报告所载数据截止2019年06月30日，本报告中列财务数据未经审计。
1 报告期末基金投资组合情况

（6）上海联泰基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
客服电话：400-166-6788
公司网站：www.66zichan.com
(64) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区泛海国际SOHO城（一期）2301室
办公地址：湖北武汉市江汉区台北一路环亚大厦B座6楼
法定代表人：陶建
客服电话：4000279899
公司网站：www.buyfund.com
(65) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市西城区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人：周斌
客服电话：400-8960-618
公司网站：www.chtwm.com
(66) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
客服电话：4001599288
公司网站：https://danjuanapp.com/
(67) 北京广源达信基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层606室
办公地址：北京市西城区金融大街9号英蓝国际金融中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
客服电话：400-623-6060
公司网站：http://www.1minifund.com
(68) 北京展晟天下基金销售有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21-28层
法定代表人：蒋煜
客服电话：010-58107061
公司网站：www.shengshiview.com
(69) 北京新良金基基金销售有限公司
注册地址：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518室
办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦
法定代表人：李昭琛
客服电话：010-62675369
公司网站：http://www.xincn.com/
(70) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
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1201-1203室
法定代表人：肖雯
客服电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
(71) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址：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）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
公司网站：www.jiyufund.com.cn
(72) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1138号
法定代表人：王伟刚
客服电话：400-619-9069
公司网站：www.hcjjjin.com
(73) 上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥桥27号、明月路1257号1幢103-1、103-2办公区
办公地址：上海市浦东新区新金桥金桥路27号1号楼
法定代表人：冯献明
客服电话：400-820-1515
公司网站：www.zhengtongfunds.com
(74) 上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
客服电话：4007991888
公司网站：www.520fund.com.cn
(75) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院a座 17 层
法定代表人：江卉
客服电话：95518/4000888816
公司网站：http://fund.jd.com
(76) 北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人：杨健
客服电话：400-673-7010
公司网站：www.jianfortune.com
(80) 万家财富基金销售有限公司（天津）有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦
2-2413
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人：李修齐

（5）可转换公司债券投资策略
在综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上，本基金采用Black-Scholes期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，并且基础股票基本面优良、具有较强盈利能力和成长前景好、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种，以合理价格买入并持有。根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等要素构建可转换公司债券投资组合，获取超额投资回报。此外，本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值，通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求选择被市场低估的品种。
3、资产支持证券投资策略
资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将在债券市场宏观分析基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。
4、股票投资策略
本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金将综合运用内部开发的量化选股模型分散化选取具有超额收益潜力的股票。具体而言，本基金的股票投资策略包括多因子选股模型和事件驱动选股模型等。
（1）多因子选股模型
本基金主要运用泰达宏利量化多因子选股模型，从上市公司的成长能力、盈利能力、运营能力以及相关股票的市场情绪、估值、波动等多个维度对股票进行量化分析，获得综合评分，选取其中基本面扎实估值合理的股票，根据投资组合的风险约束，进行分散化投资。
（2）事件驱动模型
本基金将深入分析高管增持、定向增发、并购重组等多类事件对上市公司基本与股价的影响，在充分控制风险的前提下，批量选取具有潜在超额收益可能的股票，提高组合收益。
5、股指期货投资策略
本基金将根据股指期货管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要利用的期货合约数量，对这个数量进行跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。
6、权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的；同时，充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会，实现基金资产的增值。在权证投资中，本基金将对权证证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进行定价。
九、基金的业绩比较基准
1、本基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。
2、选择比较基准的理由
本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数由中证指数有限公司编制，是由沪深A股中规模大、流动性中规模大、流动性好的最具代表300只股票组成，可以综合反映沪深A股市场整体表现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选择是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，以沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。
如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数，更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
十、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
十一、基金的投资组合报告（未经审计）
重要提示
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。
本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月5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。
本投资组合组合报告所载数据截止2019年06月30日，本报告中列财务数据未经审计。
1 报告期末基金投资组合情况

（6）上海联泰基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
客服电话：400-166-6788
公司网站：www.66zichan.com
(64) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区泛海国际SOHO城（一期）2301室
办公地址：湖北武汉市江汉区台北一路环亚大厦B座6楼
法定代表人：陶建
客服电话：4000279899
公司网站：www.buyfund.com
(65) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市西城区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人：周斌
客服电话：400-8960-618
公司网站：www.chtwm.com
(66) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
客服电话：4001599288
公司网站：https://danjuanapp.com/
(67) 北京广源达信基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层606室
办公地址：北京市西城区金融大街9号英蓝国际金融中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
客服电话：400-623-6060
公司网站：http://www.1minifund.com
(68) 北京展晟天下基金销售有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21-28层
法定代表人：蒋煜
客服电话：010-58107061
公司网站：www.shengshiview.com
(69) 北京新良金基基金销售有限公司
注册地址：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518室
办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦
法定代表人：李昭琛
客服电话：010-62675369
公司网站：http://www.xincn.com/
(70) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
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1201-1203室
法定代表人：肖雯
客服电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
(71) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址：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）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
公司网站：www.jiyufund.com.cn
(72) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1138号
法定代表人：王伟刚
客服电话：400-619-9069
公司网站：www.hcjjjin.com
(73) 上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥桥27号、明月路1257号1幢103-1、103-2办公区
办公地址：上海市浦东新区新金桥金桥路27号1号楼
法定代表人：冯献明
客服电话：400-820-1515
公司网站：www.zhengtongfunds.com
(74) 上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
客服电话：4007991888
公司网站：www.520fund.com.cn
(75) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院a座 17 层
法定代表人：江卉
客服电话：95518/4000888816
公司网站：http://fund.jd.com
(76) 北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人：杨健
客服电话：400-673-7010
公司网站：www.jianfortune.com
(80) 万家财富基金销售有限公司（天津）有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦
2-2413
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人：李修齐

（5）可转换公司债券投资策略
在综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上，本基金采用Black-Scholes期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，并且基础股票基本面优良、具有较强盈利能力和成长前景好、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种，以合理价格买入并持有。根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等要素构建可转换公司债券投资组合，获取超额投资回报。此外，本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值，通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求选择被市场低估的品种。
3、资产支持证券投资策略
资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将在债券市场宏观分析基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。
4、股票投资策略
本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金将综合运用内部开发的量化选股模型分散化选取具有超额收益潜力的股票。具体而言，本基金的股票投资策略包括多因子选股模型和事件驱动选股模型等。
（1）多因子选股模型
本基金主要运用泰达宏利量化多因子选股模型，从上市公司的成长能力、盈利能力、运营能力以及相关股票的市场情绪、估值、波动等多个维度对股票进行量化分析，获得综合评分，选取其中基本面扎实估值合理的股票，根据投资组合的风险约束，进行分散化投资。
（2）事件驱动模型
本基金将深入分析高管增持、定向增发、并购重组等多类事件对上市公司基本与股价的影响，在充分控制风险的前提下，批量选取具有潜在超额收益可能的股票，提高组合收益。
5、股指期货投资策略
本基金将根据股指期货管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要利用的期货合约数量，对这个数量进行跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。
6、权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的；同时，充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会，实现基金资产的增值。在权证投资中，本基金将对权证证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进行定价。
九、基金的业绩比较基准
1、本基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。
2、选择比较基准的理由
本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数由中证指数有限公司编制，是由沪深A股中规模大、流动性中规模大、流动性好的最具代表300只股票组成，可以综合反映沪深A股市场整体表现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选择是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，以沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。
如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数，更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
十、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
十一、基金的投资组合报告（未经审计）
重要提示
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。
本基金托管人