(上接B164版)

法定代表人:陈达伟
客服电话:400-928-2266
67) 北京微动利基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路113号3层342
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341、342室
法定代表人:季长军
客服电话:400-188-5687
68) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所: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16层
法定代表人:洪弘
电话:010-83363101
联系人:文雯
客服电话:400-166-1188
69) 上海长量基金销售有限公司
住所: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:张跃伟
客服电话:400-820-2899
70) 上海凯石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
客服电话:400-643-3389
71) 奕丰基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
电话:0755-89460500
联系人:陈广浩
客服电话:400-684-0500
72) 北京新浪仓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518室
办公地址:北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座
法定代表人:赵芯蕊
电话:010-62675768
联系人:赵芯蕊
客服电话:010-62675369
73) 北京展恒基金销售股份有限公司
住所: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2层
法定代表人:闫振杰
电话:010-59601366-7024
联系人:李露平
客服电话:400-818-8000
74) 珠海盈米基金销售有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
电话:020-896290994
联系人:黄敏嫦
客服电话:020-89629066
75) 北京懒猫金融信息服务有限公司
住所:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
办公地址:北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号
法定代表人:许现良
客服电话:4008109580
76) 一路财富(北京)基金销售股份有限公司
住所:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
法定代表人:吴雪秀
电话:010-88312877-8028
联系人:段京璐
客服电话:400-001-1566
77) 上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:李兴春
客服电话:400-921-7733
78) 深圳富济基金销售有限公司
住所: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元
办公地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元
法定代表人:祝中村
客服电话:0755-83999907
79) 北京广源达信基金销售有限公司
住所:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
客服电话:400-623-6060
80) 上海云湾基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区
法定代表人:冯轶明
电话:021-20530224
联系人:江辉
客服电话:400-820-1515
81) 上海联泰基金销售有限公司
住所: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号楼3层
法定代表人:尹彬彬
电话:021-52822063
联系人:兰敏
客服电话:400-118-1188
82) 北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B室
法定代表人:曲馨月
电话:010-56176118
联系人:张旭
客服电话:400-100-3391
83) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE
法定代表人:高锋
客服电话:400-804-8688
84) 深圳前海财厚基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区南山大道1088号南园枫叶大厦15层15K室
法定代表人:杨艳平
客服电话:0755-86575665
85) 上海万得基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:黄祎
电话:021-51327185
联系人:徐亚丹
客服电话:400-799-1888
86) 北京汇成基金销售有限公司
住所: 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
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
法定代表人:王伟刚
客服电话:400-619-9059
87) 深圳市金斧子基金销售有限公司
住所: 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
办公地址: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
法定代表人:赖任军
电话:0755-29330513
联系人:刘昕霞
客服电话:400-930-0660
88) 北京肯特瑞基金销售有限公司
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:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人:江卉
客服电话:95118
89) 北京辉腾汇富基金销售有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1
法定代表人:许宁
电话:010-51455516
联系人:周雯
客服电话:400-829-1218
90) 万家财富基金销售(天津)有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:张军
电话:010-5901384
联系人:王芳芳
客服电话:010-59013842
91) 上海大智慧基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人:申健
电话:021-20219988
联系人:张蜓
客服电话:021-20292031
92) 和讯信息科技有限公司
住所: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:王莉
客服电话:400-920-0022
93) 上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路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号的太平金融大厦1503-1504室
法定代表人:王翔
电话:021-65370077-209
联系人:俞申莉
客服电话:400-820-5369
94) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司
住所:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:张旭
客服电话:400-810-5919
95) 南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
客服电话:95177
96) 深圳盈信基金销售有限公司
住所: 深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
办公地址:大连市中山区南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
电话:0411-66661322
联系人:王清臣
客服电话:4007-903-688
97) 乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
住所:北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
办公地址:北京市西城区德胜门外大街合生财富广场1302室
法定代表人:董云巍
客服电话:400-088-8080
98) 北京蛋卷基金销售有限公司
住所: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:北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层
法定代表人:钟斐斐
电话:010-61840688
联系人:戚晓强
客服电话:400-159-9288
99) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
办公地址:武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
法定代表人:陶捷
客服电话:400-027-9899
100) 天津国美基金销售有限公司
住所:天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层
法定代表人:丁东华
电话:010-59287105
联系人:许艳
客服电话:400-111-0889
101) 北京格上富信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:叶精一
电话:010-85594745
联系人:张林
客服电话:400-066-8586
102) 上海挖财基金销售有限公司
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:冷飞
客服电话:021-50810673
103) 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16层
法定代表人:毛淮平
客服电话:400-817-5666
104) 中民财富基金销售(上海)有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场17层
法定代表人:弭洪军
客服电话:400-876-5716
105) 深圳信诚基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元
法定代表人:周文
客服电话:0755-23946579
106) 喜鹊财富基金销售有限公司
住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
法定代表人:陈皓
客服电话:4006997719
107) 通华财富(上海)基金销售有限公司
住所:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人:沈丹义
客服电话:4001019301 / 95193
108) 沈阳麟龙投资顾问有限公司
住所:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601
办公地址:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601
法定代表人:朱荣晖
客服电话:400-003-5811
109) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人:陈洪生
客服电话:400-918-0808
110) 青岛乐弘基金销售有限公司
住所:山东省青岛市崂山区香港东路195号9号楼1001
法定代表人:张巍
客服电话: 4009-995-157
111) 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号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊旻
客服电话:4008-909-998
112) 贵州省贵文文化基金销售有限公司
住所: 贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际A栋2单元5层17号
办公地址:贵州省贵阳市南明区兴业西路CCDI大楼一楼
法定代表人:陈成
客服电话:0851-85407888
113) 济安财富(北京)基金销售有限公司
住所: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
电话:010-65309516
联系人:李海燕
客服电话:400-673-7010
114) 嘉实财富管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15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
电话:010-85097570
联系人:余永键
客服电话:400-021-8850
115) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9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1809
法定代表人:戎兵
客服电话:400-6099-200
116) 和耕传承基金销售有限公司
住所:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号国际电子城360大厦A座
法定代表人:王旋
客服电话:4000-555-671
117) 民商基金销售(上海)有限公司
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
法定代表人:贲惠琴
客服电话:021-50206003
118) 大河财富基金销售有限公司
住所: 贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号
法定代表人:王荻
客服电话:0851-88235678
119) 大连网金基金销售有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
法定代表人:樊怀东
客服电话:4000899100
120) 江苏汇林保大基金销售有限公司
住所:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
法定代表人:吴言林
客服电话:025-56663409
121) 海银基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
法定代表人:惠晓川
客服电话:400-808-1016
122) 深圳新华信通基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
法定代表人:韩森
客服电话:400-000-5767
123) 中信期货有限公司
住所: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
法定代表人:张皓
电话:13718246886/010-60834022
联系人:刘宏莹
客服电话:400-990-8826
124) 东海期货有限责任公司
住所:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
法定代表人:陈太康
客服电话:95531/4008888588
125) 大有期货有限公司
住所:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
法定代表人:颜如意
电话:0731-84409106、0731-84409130
联系人:马科、王霞
客服电话:4006-365-058
126) 阳光人寿保险股份有限公司
住所:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
法定代表人:李科
客服电话:95510
127) 玄元保险代理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马永谙
客服电话:021-50701082
基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的其他机构销售本基金,并在管理人网站上公示。

二、登记机构

名称:中融基金管理有限公司
住所: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区2号中航资本大厦17楼
法定代表人:王瑶
电话:010-56517000
传真:010-56517001
联系人:李同庆
网址:www.zrfunds.com.cn

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:北京市众一律师事务所
住所:北京市东城区东四十条甲22号南新仓商务大厦A座502室
办公地址: 北京市东城区东四十条甲22号南新仓商务大厦A座502室
负责人:云大慧
电话: 010-64096085
传真: 010-64096188
联系人:唐琨
经办律师:唐琨、李万辉

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:上会会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
办公地址:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
执行事务合伙人:张晓荣(首席合伙人)
电话:021-52920000
传真:021-52921369
经办注册会计师:陈大愚、江嘉炜
联系人:杨伟平

第四部分 基金的名称

中融竞争优势股票型证券投资基金

第五部分 基金类型、运作方式与存续期间

1. 基金类型:股票型。
2. 基金的运作方式:契约型开放式。
3. 基金存续期间:不定期。

第六部分 基金的投资目标

在注重资产安全性和流动性的前提下,主要投资于行业具有广阔发展空间、自身具备核心竞争优势及持续成长性的上市公司,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

第七部分 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(包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、权证、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、股指期货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(但须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%-95%,本基金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,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

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。

第八部分 基金的投资策略

本基金专注于自下而上的成长股深度挖掘,坚持以中长期的相对确定性应对短期的不确定性。以“理性分析价值、深度挖掘成长”为投资理念。

1、资产配置策略

本基金从宏观面、政策面、基本面和资金面等多方面进行综合分析,研判国内外经济发展趋势,在严格控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券及货币市场工具等大类资产的投资比例,并根据宏观经济形势和市场实际的变化适时进行动态调整。

2、股票投资策略

(1)行业配置

本基金股票的配置重点是具有竞争优势的上市公司,具有竞争优势的上市公司是指由于具有某种竞争优势而能够获得持续成长性的上市公司,竞争优势包括公司治理优势、商业模式优势、管理优势、技术优势、品牌优势、营销渠道优势、资源禀赋优势等方面,竞争优势为公司的持续成长提供了壁垒,保证了成长质量和成长持续性。

(2)个股选择

本基金认为竞争优势是企业持续成长的前提,在经济发展中会出现具有公司治理、管理、技术等持续竞争优势特征的企业,这些企业能够充分自如应对市场竞争,而企业的持续成长性是获得持续优秀业绩回报的因素,本基金股票资产将重点投资于能够在高速成长中保持合理估值的企业。

1)建立初选股票库

为了控制风险,本基金首先剔除存在重大违规嫌疑并被监管部门调查的公司、股价发生异常波动的公司,并在此基础上从成长性、成长质量、营运能力、偿债能力四个方面进行评估,通过主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、未来两年息税前利润复合增长率、净资产收益率等指标衡量企业的成长性,建立初选股票库。

2)建立备选股票库

本基金在初选股票库的基础上,选择具有以下一项或多项竞争优势特征的上市公司构建备选股票库。

①公司治理竞争优势

公司治理的完善、有效、合理程度直接影响着投资者的利益保护程度,也是企业持续竞争优势的基础性因素。本基金对于治理透明、制衡、高效、具有良好激励约束机制、重视并愿意增加股东权益特别是中小股东权益的具有持续公司治理竞争优势的上市公司给予重点关注。

②商业模式竞争优势

商业模式能够让企业保持竞争优势,通过构建新型的商业模式,打破现有的产业竞争规则、价值规则,获取超额收益。独特的商业模式能够保证企业核心能力顺利转换为企业在市场竞争中的竞争优势,同时市场上的竞争优势带来企业战略目标的实现,企业的发展反过来通过商业模式的调整进一步强化企业的核心能力。

③技术竞争优势

上市公司是否具有持续技术竞争优势,不仅是看公司现阶段是否拥有领先的难以复制甚至不可复制的技术优势、拥有的现代技术设施水平,更要看公司是否拥有高素质的技术创新人才和公司是否重视并拥有自主创新机制等使公司能够保持持续技术竞争优势的根本性因素。

④品牌竞争优势

品牌竞争优势是企业所独具的优势,具有不可替代的差异化能力,竞争对手很难模仿。具有竞争优势的品牌拥有高知名度和忠诚度,构建较高的竞争壁垒,具有获取超额利润的品牌溢价能力,具有使企业能够产生持续盈利的能力。3)建立股票投资组合

具有持续竞争优势的上市公司最终进入股票投资组合中,还需要经过安全边际、流动性等考核。安全边际是上市公司的内在价值或实质价值与证券市场价格的顺差,即内在价值与证券市场价格相比被低估的程度或幅度。根据上市公司的行业特征、发展阶段等因素,选择具体适用的估值方法对于上市公司进行估值。本基金将进入备选库的上市公司按照安全边际和流动性进行排序,选择具有足够的安全边际和高流动性的上市公司进入股票投资组合。

4)调整股票投资组合

股票投资组合建立后,本基金将动态跟踪经济发展、上市公司的竞争优势和估值水平等变化,适时调整,以不断优化投资组合。

3、债券投资策略

本基金在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以久期控制和结构分析策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

5、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货、权证等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

7、风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如Barra多因子模型、风险预算模型等,并结合公司现有的风险管理流程,在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。

具体而言,在大类资产配置策略的风险控制上,由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控;在个股投资的风险控制上,本基金将严格遵守公司的内部规章制度,控制单一个股投资风险。

8、股指期货投资策略

本基金认为在符合一定条件的市场环境中,有必要审慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

本基金参与股指期货套期时将综合考虑:

(1)股指期货交易品种的流动性;

(2)股指期货交易品种与现货市场的相关度;

(3)通过股指期货进行套期保值交易的必要性;

(4)股指期货套期保值交易的综合成本,来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率。

第九部分 基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%

沪深300指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数,科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现,具有一定的权威性和市场代表性,业内也普遍采用。因此,沪深300指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。中债总指数是由中央国债登记结算公司编制的具有代表性的债券市场指数。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险收益水平的基金产品。

第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2020年4月17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2019年12月31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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	83,535,624.55	90.84
	其中:股票	83,535,624.55	90.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,607,692.75	7.19
	其中:债券	6,607,692.75	7.19
	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	951,966.48	1.04
8	其他资产	859,571.94	0.93
9	合计	91,954,855.72	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,097,050.81	1.20
B	采矿业	-	-
C	制造业	69,628,772.26	76.45
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	1,539,212.44	1.69
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	1,854,142.00	2.04
J	金融业	6,485,285.00	7.12
K	房地产业	1,044,935.00	1.15
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	6,578.04	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	507,749.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	1,371,900.00	1.51
S	综合	-	-
	合计	83,535,624.55	91.72

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	002695	煌上煌	490,849	8,049,923.60	8.84
2	600984	建设机械	668,580	6,906,431.40	7.58
3	300122	智飞生物	92,200	4,578,652.00	5.03
4	000651	格力电器	69,400	4,551,252.00	5.00
5	300406	九强生物	266,300	4,330,038.00	4.75
6	000725	京东方A	859,400	3,901,676.00	4.28
7	000776	广发证券	229,500	3,481,515.00	3.82
8	002812	恩捷股份	66,019	3,333,969.50	3.66
9	600703	三安光电	173,600	3,187,296.00	3.50
10	603799	华友钴业	79,800	3,143,322.00	3.45

4、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	4,590,752.80	5.04
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)	2,016,939.95	2.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,607,692.75	7.26

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

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	019611	19国债01	45,880	4,590,752.80	5.04
2	123017	寒锐转债	14,149	2,016,939.95	2.21

6、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

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

11.1 报告期内,基金投资的前十名证券除广发证券(000776)外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国证监会2019年8月5日发布对广发证券股份有限公司的行政处罚(中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书[2019]31号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,948.41
2	应收证券清算款	620,522.20
3	应收股利	-
4	应收利息	102,856.79
5	应收申购款	108,245.54
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	859,571.94

11.4 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	123017	寒锐转债	2,016,939.95	2.21

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603799	华友钴业	3,143,322.00	3.45	重大事项公告

11.6 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,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

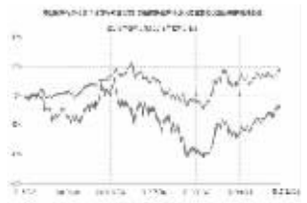
第十二部分 基金的业绩

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。基金业绩数据截止日为2019年12月31日。

一、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	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
2016年9月7日至2016年12月31日	-9.46%	0.96%	-1.21%	0.58%	-8.25%	0.38%
2017年1月1日至2017年6月30日	0.51%	1.21%	8.02%	0.46%	-7.51%	0.75%
2017年7月1日至2017年12月31日	2.16%	1.66%	7.52%	0.56%	-5.36%	1.10%
2018年1月1日至2018年6月30日	-10.81%	1.98%	-9.80%	0.92%	-1.01%	1.06%
2018年7月1日至2018年12月31日	-29.58%	2.13%	-10.82%	1.19%	-18.76%	0.94%
2019年1月1日至2019年6月30日	29.53%	1.81%	21.33%	1.23%	8.20%	0.58%
2019年7月1日至2019年12月31日	23.88%	1.10%	6.02%	0.68%	17.86%	0.42%

二、 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

第十三部分 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/期货交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的开户费用、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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

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×0.25%÷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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

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、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

(一)更新了“重要提示”中的相关内容。
(二)更新了“第三部分 基金管理人”中的相关内容。
(三)更新了“第四部分 基金托管人”中的相关内容。
(四)更新了“第五部分 相关服务机构”中的相关内容。
(五)更新了“第九部分 基金的投资”中的相关内容。
(六)更新了“第十部分 基金的业绩”中的相关内容。
(七)更新了“第二十部分 托管协议的内容摘要”中的相关内容。
(八)更新了“第二十二部分 其他应披露事项”中的相关内容。

中融基金管理有限公