

网址: www.tfzq.com

1 大通证券股份有限公司
注册地址：大连市中山区人民路24号
法定代表人：李红光
联系人：谢立军
电话：0411-39991807
传真：0411-39673219
客户服务专线：4008-169-169
网站：www.daton.com.cn
(8) 宏信证券有限责任公司
办公地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
法人代表人：吴玉明
客服电话：4008366366
联系人：刘文义
电话：02886196765
传真：02886196633
网站：http://www.hx818.com
(9) 联储证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
办公地址：上海市浦东新区安度路5号院3号楼中建华国际中心27层联储证券
法定代表人：吕昌臣
联系人：丁静云
联系电话：010-8649427 13051850661
传真：0755-23947482
客服电话：400-620-6988
网站：http://www.lczq.com/
(10) 华瑞保险销售有限公司
注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通里财富广场1号楼B座13、14层
办公地址：上海市浦东新区向城路288号国人寿金融大厦8层806
法定代表人：杨国梁
联系人：郭勇军
联系电话：021-68595698
传真：021-68556766
客服电话：52303
网站：http://www.huaruisales.com/
(12) 玄元保险代理有限公司
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人：马永涛
联系人：尹亚明
联系电话：021-50701003
传真：021-50701063
客服电话：400-800-8208
网站：www.lxcmofang.cn
(13) 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大街12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
电话：010-86632771
传真：010-86632773
联系人：王超
客服电话：96510
公司网站：http://fundsinosig.com/
(14) 天相投资顾问有限公司
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人：林文相
客服电话：010-66045678
联系人：尹静
传真：010-66045627
网站：www.txsec.com
(15) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
法定代表人：杨海
联系人：张燕
联系电话：010-58325388/1588
网站：www.xinlan.com
客服电话：400-166-1188
(16) 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号泛利大厦10层
法定代表人：王利
联系人：刘洋
联系电话：021-20835785
传真：021-20835879
客服电话：400-930-0202
网站：http://licaike.hexun.com
(17) 上海挖财基金销售有限公司
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：冷岱
客服电话：021-50810673
网站：www.wacaijin.com
(18) 北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
办公地址：北京市海淀区信息路9号壹力大厦
法人代表人：张旭阳
公告联系人：杨琳
公共电话：010-61962702
公共传真：010-61961007
客服电话：96055-9
网站：www.baifengfund.com
(19) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人：王海波
联系人：徐诚
客服电话：021-38509639
网站：www.noah-fund.com
(100) 深圳弘球基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区笋岗街道和园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人：薛峰
联系人：董彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-52090798
网站：www.zlfund.cn
客服电话：4006-788-887
(101) 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195号3C座9楼
法人代表：其实
电话：021-54509998
传真：021-64385788
客服电话：400-1818-188
网站：www.1234567.com.cn
(102) 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：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
联系人：张磊
联系电话：021-58870011
传真：021-68909616
网站：www.howbuy.com
(103) 科威国际（中国）基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市西湖区云栖路18号黄龙时代广场B座6F
法人代表：陈柏青
联系人：韩爱彬
电话：021-68897840
传真：0571-26697013
客服电话：4000-768-123
网站：www.fund123.cn
(104) 上海长量基金销售有限公司
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：4008200289
联系人：胡燕芳
电话：021-20691931
传真：021-20691961
网站：www.erichfund.com
(105) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表：凌顺平
联系人：林海明
电话：0571-88911818-8580
传真：0571-88911818-8002
客服电话：4008-773-772网站地址：www.5ifund.com
(106) 上海得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕪川路6475号103室
办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号14层1414
法定代表人：李永春
电话：021-50683833
传真：021-50683833
客服电话：400-921-7765
网站：www.1661fund.com.cn
(107) 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号上海国金中心二期20层B312-15层15元
法定代表人：赵学军
电话：010-65215688
传真：010-65711215
联系人：李雯
联系人邮箱：liwen@harvestwm.cn
客服电话：400-021-8850
网站：www.harvestwm.cn
(108) 南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：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：王峰
客服电话：96177
网站：http://www.snjjin.com/
(109) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人：周斌
电话：4008980618
网站：www.bhtfund.com
(110) 北京汇成基金销售有限公司
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王刚
联系人：丁明坤
电话：010-56281240
传真：010-62808207
客服电话：400-619-9069
网站：http://www.hcjin.com
(111) 北京晟视天下投资管理有限公司
办公地址：北京市朝阳区九渡河黄村镇735号03室
法定代表人：蒋煜
电话：010-58170823
传真：010-58170800
客服电话：400-818-8866
网站：http://fundshengshiwealth.com
(112) 北京钱景基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢0层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：魏善
网站：www.qianjing.com
客服电话：400-893-6885
(113) 北京中融汇基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区东三环北路中融国际软件园二期（西扩）N-1、N-2地块中融汇总部科研楼6层
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6层
法定代表人：李曜琛
联系人：李晖
联系电话：010-58862465
传真：010-62676562
客服电话：010-62675369
网站：http://www.fundsinia.com.cn
(114) 上海万得基金销售有限公司
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号1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：黄伟
联系人：徐丹
电话：021-50712782
传真：021-50710711
客服电话：400-799-1888
网站：www.52fund.com.cn
(115) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址：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18号楼
法定代表人：张旭
联系人：汪莹
联系电话：010-58160084
传真：010-58160173
客服电话：400-810-9319
网站：http://www.fhxfund.com/
(116) 上海聚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 层 3 层
法定代表人：燕斌
联系人：丁敏
电话：021-52222063

(四)作为市场风险控制的主要技术指标，利用可转换债券溢价率来判断转债股性，运用转股溢价率、一级市场价格、纯债券价值及期权价值管理来积极投资，获取超额收益。

本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下方面：主要采用市价法等多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资价值参考；根据权证实务和公司基本面研究结论，结合权证理论价值进行权证的投资选择；权证证券衍生工具的特性，通过权证与债券的组合替代，来达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于行权交割策略、看跌保护组合等，保持组合成本优势、获利保值增值、买入跨式投资策略等。

本基金法律文件规定或者监管机构允许的前提下，利用未来推出的金融衍生品工具，增强收益，规避风险。

（五）基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中债综合指数

本基金选择市场上同度较高的沪深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，具有良好的市场代表性。本基金股票资产比例区间为60%-90%，债券资产比例区间为40%-40%，选择75%作为基准指数中股票资产所权重比例长期平均权重，选择25%作为债券资产的长期平均权重。因此，本基金的业绩比较基准确定为75%×沪深300指数+25%×中债综合指数。

今后若因法律法规发生变化或，或者有更权威、更能作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业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩基准并公告。

（六）基金的风险收益特征

本基金是混合型基金，其预期收益及十二个月低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。本基金管理人将本着诚实信用原则，勤勉尽责地为基金份额持有人提供优质服务，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人不对任何单一投资者承诺本金不受损失或者取得最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“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，由投资者自行负担。

（七）基金投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	142,097,925.60	88.34
2	其中：股票	142,097,925.60	88.34
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	银行存管和待结算资产合计	18,020,019.42	11.20
8	其他资产	743,013.62	0.46
9	合计	160,860,968.64	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按公允价值计量的境内股票投资组合

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔、农业	-	-
B	采矿业	14,696,058.60	9.19
C	制造业	63,368,757.41	58.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,349,611	14.06
E	建筑业	78,940,611	0.15
F	批发和零售业	78,940,611	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	6,614,937.00	4.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	127,773.26	0.08
J	金融业	15,331,624.00	9.59
K	房地产业	38,282.72	0.02
L	租赁和商务服务业	1,989,552.00	1.25
M	科学研究和技术服务业	17,552.08	0.01
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	9,383.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	9,616,849.00	6.14
S	综合	-	-
合计	-	142,097,925.60	88.34

三、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末未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	002327	富宸微	2,269,801	15,461,288.68	9.72
2	601226	陕西海能	1,964,180	14,696,058.60	9.19
3	600352	浙江龙盛	1,181,500	14,071,660.80	8.89
4	002232	杰赛科技	1,356,600	12,906,700.00	8.07
5	003337	众兴股份	706,189	12,262,098.47	7.63
6	300788	中国国旅	247,900	9,816,940.00	6.14
7	600036	招商银行	216,700	9,574,240.00	5.99
8	002120	韵达股份	294,000	6,614,937.00	4.14
9	002415	智翔威视	221,300	6,174,270.00	3.90
10	600690	海尔智家	42,000	6,076,800.00	3.86

四、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末未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

报告期末未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

报告期末未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

报告期末未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

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

2、本基金股指期货投资的投资政策

本基金未参与股指期货投资。

3、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资的政策

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

3、本期国债期货投资的情况

五、报告期末基金资产组合附注

1、报告期内基金投资的前十只证券的发行主体本期无被监管部门立案调查，或在报告编制日前受到公开谴责、处罚的情形。

2、报告期内基金投资的前十只股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、基金的其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存在担保投资	144,562.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,854.10
5	应收申购款	694,597.20
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	743,013.62

六、报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

七、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

八、报告期末基金资产组合附注的其他文字描述部分

九、报告期内基金管理人及基金经理发生变化的情况说明

十四、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策前，应仔细阅读基金合同及招募说明书全文，了解基金的风险收益特征，并根据基金的投资目标、策略、费率、期限等因素，自主判断基金是否适合作为个人投资者的投资品种。

基金业绩评价表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
2014.4.22~2014.12.31	20.08%	0.22%	46.06%	0.91%	-16.08%	-0.69%
2015.1.1~2015.12.31	46.31%	0.29%	7.76%	1.80%	38.55%	0.52%
2016.1.1~2016.12.31	1.06%	1.46%	-17.5%	1.05%	18.1%	0.40%
2017.1.1~2017.12.31	30.06%	0.68%	66.10%	0.68%	-21.06%	0.29%
2018.1.1~2018.12.31	-31.19%	1.20%	17.76%	1.09%	-54.60%	0.20%
2019.1.1~2019.12.31	7.99%	1.82%	27.87%	0.65%	-19.88%	0.58%
2020.1.1~2020.12.31	-9.26%	1.77%	-6.81%	1.46%	-2.44%	0.32%
2014.4.22~2020.12.31	77.69%	1.67%	66.33%	1.14%	12.36%	0.53%

自基金转型以来(2014年4月2