客服电话:400-6099200

法人代表:陈刚

联系人:张丽琼

电话:0571-85262700

传真:0571-85269200

客服电话:0571-86915761

公司网址:www.cd121.com

(89)上海基煜基金销售有限公司

公司网址:www.yixinfund.com

(88)杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室

注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室

办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20F

(上接B096版) (上海泰和经济发展区) 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室 法定代表人:王翔 联系人:蓝杰 联系人:蔡小威 电话: 021-65370077 电话:021-63333389 传真: 021-55085991 传真:021-63333390 客服电话:400-643-3389 客服电话:4008-205-369 公司网址:www.jiyufund.com.cn 公司网址:www.vstonewealth.com (90)北京蛋卷基金销售有限公司 (73)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 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:北京市朝阳区望京SOHO T3A座19层 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 法定代表人:钟斐斐 1201-1203 法定代表人: 肖雯 电话:010-61840688 联系人:吴煜浩 电话:020-89629099 传真:010-61840699 客服电话:4000-618-518 传真:020-89629011 公司网址:danjuanapp.com 客服电话:020-89629066 (91) 乾道盈泰基金销售(北京)有限公司 网址:www.yingmi.cn (74)北京恒天明泽基金销售有限公司 注册地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室 办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室 注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 法人代表: 王兴吉 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 联系人:宋子琪 法定代表人:周斌 申话:010-62062880 联系人:陈霞 电话:010-56810307 传真:010-82057741 客服电话:4000-888-080 传真:010-56810630 公司网址:www.qiandaojr.com 客服电话:4008-980-618 (92) 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 网址:www.chtfund.com 办公地址:北京是海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 (75) 嘉实财富管理有限公司 法定代表人:江卉 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 层4609-10单元 联系人: 韩锦星 电 话:4000988511/ 4000888816 办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层 传真:010-89188000 法定代表人:赵学军 客服电话:400 098 8511 联系人:于永健 电话:010-85097570 公司官网:http://fund.id.com/ (93)深圳前海微众银行股份有限公司 传真:010-85097308 客服电话:400-021-8850 注册地址: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:广东省深圳市南山区深圳湾科技生态园7栋A座 (76)上海利得基金销售有限公司 法定代表人:顾敏 办公地址,上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼14楼 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 联系人:罗曦 法定代表人:李兴春 传真:0755-86700688 联系人:陈孜明 客服电话:400-999-8877 电话:86-021-50583533 公司网址:www.webank.com (94) 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 传真:86-021-50583633 客服电话:400-921-7755 网址:http://www.leadfund.com.cn/ 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人: 彭纯 (77)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 联系人:曹榕 办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋 电话:021-58781234 法定代表人:汪静波 传真:021-58408842 联系人:邱佳捷 客服电话:95559 公司网址:www.bankcomm.com 电话:021-80358749 (95)凤凰金信(银川)基金销售有限公司 传真:021-38509777 客服电话:400-821-5399 注册地址:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 网址:www.noah-fund.com 142号14层1402 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 (78)中证金牛(北京)投资咨询有限公司 法定代表人:张旭 注册地址: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 联系人: 汗莹 电话:010-58160168 法定代表人:钱昊旻 传真:010-58160173 联系人:沈晨 电话:010-59336544 客服电话:400-810-5919 传真:010-59336500 公司网址:www.fengfd.com (96)北京汇成基金销售有限公司 客服申话:4008909998 注册地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室 公司网址:http://www.inlc.com/ 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室 (79) 奕丰基金销售有限公司 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深 法人代表: 王伟刚 联系人:王骁骁 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 电话:010-56251471 传真:010-62680827 法人代表:TEO WEE HOWE 联系人:叶健 客服申话:400-619-9059 公司网址:www.hcjijin.com 电话:0755-8946 0507 (97)上海浦东发展银行股份有限公司 传真:0755-2167 4453 客服电话:400-684-0500 注册地址:上海市黄浦区中山东一路12号 办公地址:上海市黄浦区中山东一路12号 公司网址:www.ifastps.com.cr (80)厦门市鑫鼎盛控股有限公司 法定代表人:高国富 注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504 联系人:刘信义 电话:86-21-63611226/86-21-61618888 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504 法人代表:陈洪生 传真:86-21-63230807 客服电话:95528 联系人:梁云波 公司网址:www.spdb.com.cn 电话:0592-3122757 客服电话:400-918-0808 (98)东莞银行股份有限公司 注册地址:广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦 公司网址:www.xds.com.cr 办公地址:广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦 (81)深圳富济基金销售有限公司 法定代表人:卢国锋 注册地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、 联系人:朱杰霞 办公地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、 电话:0769-22865177 客服电话:956033 03.04单位 公司网址:www.dongguanbank.cn 法定代表人:刘鹏宇 (99)东方财富证券股份有限公司 联系人:刘勇 注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼 电话:0755-83999907-8814 办公地址:上海市徐汇区东湖路7号9幢(上海分公司) 传真:0755-83999926 法定代表人:徐伟琴 客服电话:0755-83999907 联系人:周艳琼 公司网址:www.fujifund.cn 电话:021-36537945 (82)北京创金启富基金销售有限公司 客服电话:95357 注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址:北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A综合楼712室 公司网址:www.xzsec.com (100)北京广源法信其全销售有限公司 法人代表:梁蓉 注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室 联系人:李慧慧 法人代表:齐剑辉 传真:010-63583991 客服电话:400-6262-818 联系人:姜英华 电话:010-57298634 公司网址:www.5irich.com 传真:010-82055860 (83) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司 客服电话:4006236060 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 公司网址:www:niuiniufund.com 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室 (101)海银基金销售有限公司 法人代表:张冠宇 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室 联系人:王国壮 办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼 电话:400-819-9868 法人代表:刘惠 传真:010-85932880 客服电话:400-819-9868 联系人:毛林 电话:021-80133597 公司网址:http://www.tdyhfund.com/ 传真:021-80133413 4)北京晟视天下基金销售有限公司 客服电话:400-808-1016 注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室 公司网址:www.fundhaivin.com 办公地址:北京市朝阳区朝外大街万通中心D座28层 (102)上海云湾基金销售有限公司 法定代表人, 蒸焊 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层 联系人:宋志强 电话:010-58170932 办公地址:中国上海浦东新区新金桥路27号1号楼 传真:010-58170840 法人代表:桂水发 客服电话:010-58170761 公司図址:http://www.shengshiview.com/ (85)北京新浪仓石基金销售有限公司 电话:021-20530186 传直:021-20539999 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、 客服电话:400-820-1515 -2地块新浪总部科研楼5层518室 网址:http://www.zhengtongfunds.com/ 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、 (103)北京电盈基金销售有限公司 -2地块新浪总部科研楼5层518室 注册地址,北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室 法定代表人:李昭琛 办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12B 联系人:李唯 法人代表人:曲馨月 电话:010-62675657 传真:010- 62676582 联系人:周静华 客服电话:010-62675369 传真:010-56176117 客服电话:400-100-3391 公司网址:www.xincai.com 公司网址:www.bjdyfund.com (86)武汉市伯嘉基金销售有限公司 (104)万家财富基金销售(天津)有限公司 注册地址:武汉市江汉区中央商务区泛海国际SOHO城(一期)七 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 炼23层1号4号 办公地址:武汉市江汉区中央商务区泛海国际SOHO城(一期)七 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 炼23层1号4号 法人代表人:李修辞 法定代表人:陶捷 联系人:陆锋 联系人: 王芳芳 电话:010-59013842 电话:027-83863742 清算传真:010-59013828 传真:027-83862682 客服电话:400-027-9899 客服电话:010-59013842 公司网址:http://www.wanjiawealth.com/ 公司网址:www.buyfunds.cn (105)上海有鱼基金销售有限公司 (87) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司 注册地址:上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室 注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 办公地址:上海市徐汇区桂平路391号A座五层 办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809 法人代表:林琼 法人代表:戎兵 联系人:徐海峥 联系人:魏晨 电话:021-64389188 电话:010-52858244 传真:021-64389188-102 传真:010-85800047

客服电话:021-61923815

(106)联储证券有限责任公司

法人代表:吕春卫

电话:01086499427

客服电话:4006206868

公司网址:www.lczq.con

(107)深圳盈信基金销售有限公司

联系人:丁倩云

大厦9楼

公司网址:www.youyufund.com

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

办公地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心

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:辽宁省大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1 法定代表人:苗宏升 联系人:葛俏俏 座机:0411-66889809 传真:0411-66889827 客服电话:4007-903-688 公司网址:www.fundying.com (108)开源证券股份有限公司 注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 法定代表人:李刚 联系人:袁伟涛 联系电话:029-63387256 客服电话:95325 公司网址:http://www.kysec.cn/ (109)沈阳麟龙投资顾问有限公司 注册地址:辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601 办公地址:上海市青云路158号城建大厦5楼 法定代表人:朱荣晖 联系人:钱金菊 电话:021-5109-1679 传真:021-51091674 客服电话:024-62836088 公司网址:www.linlongtougu.com (110)济安财富(北京)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 联系人:李海燕 电话:010-65309516 传真:010-65330699 客服电话;400-673-7010 公司网站:www.jianfortune.com (111)弘业期货股份有限公司 注册地址:南京市中华路50号 办公地址:南京市中华路50号弘业大厦 法定代表人: 周剑秋 联系人:张苏怡 电话:025-52278981 传真:025-52278733 客服申话:400-8281288 公司网址:www.ftol.com.cn (112)民商基金销售(上海)有限公司 注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室 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: 帝惠琴 联系人:杨一新 电话:021-50206002 传真:021-50206001 客服电话:021-50206003 网址:msftec.con (113)长江期货股份有限公司 注册地址:武汉市武昌区中北路9号长城汇T2号写字楼第27、28层 办公地址:武汉市武昌区中北路9号长城汇T2号写字楼第27层 法定代表人:谭显荣 联系人:梅晨 传真:86-27-85860102 客服电话:027-85861133 公司网址:http://www.cjfco.com.cn/main/index.html (114)方德保险代理有限公司 注册地址:北京市东城区东直门外大街46号12层02室 办公地址:北京市东城区东直门外大街46号12层02室 法定代表人:林柏均 客服电话:010-64068617 公司网站:www.fundsure.cr 基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构 代理销售本基金,并及时公告。 (二)注册登记机构 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 法定代表人:周明 电话:021-5887 2935 联系人:郑奕莉 )出具法律意见书的律师事务所 名称:上海源泰律师事务所 住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼 负责人:廖海 电话:021-5115 0298 传真:021-5115 0398 联系人:刘佳 经办律师:刘佳、范佳斐 (四)审计基金财产的会计师事务所 名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 执行事务合伙人:吴港平 住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(东 三办公楼)16层 办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼 公司电话:(021)2228 8888 公司传真:(021)2228 0000 签章会计师:蒋燕华、骆文慧 业务联系人: 蒋燕佐 四、基金的历史沿革 本基金由财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资 财诵福感定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金经 2016年11月15日中国证监会证监许可[2016]2673号文注册募集,基金管 理人为财通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公

财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金自 2016年12月19日至2017年1月18日进行公开募集,募集结束后基金管理 人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认、《财通福盛定增 定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2017年1月 25日生效,并于2017年4月21日起在上海证券交易所上市交易。 2019年11月27日财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证 券投资基金召开基金份额持有人大会,大会审议通过了《关于财通福盛 定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型有关事项的议 案》,同意变更财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资 基金的基金名称、运作方式、投资范围、投资策略、投资限制及其他相关

事项,授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜。基金份额持 有人大会决议自表决通过之日起生效。自2019年12月28日起、《财通福 盛多策略混合型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》正式生效、《财 通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》自 五、基金名称 财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金(LOF)

六、基金的类型

混合型发起式证券投资基金

七、基金的投资目标

本基金将灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投 资机会,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。 八、投资范围

本基金的投资范围为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)、债券(包括国内依法发行和 上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、 短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、 地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的 债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、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 基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票资产的比例为50%

~95%;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%,其中现 金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后

的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。 九、投资策略

、资产配置策略

本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策 变化、金融市场形势等多方面因素,通过对货币市场、债券市场和股票市 场的整体估值状况比较分析,对各主要投资品种市场的未来发展趋势进 行研判,根据判断结果进行资产配置及组合的构建,确定基金在股票、债 券、货币市场工具等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益 特征的相对变化,适时动态调整各资产类别的投资比例,在控制投资组 合整体风险基础上力争提高收益。

本基金进行综合分析的各项指标和因素主要包括:基本面分析方面 主要包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、 固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据:政策面分析方面主要 包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等各项货币政 策,财政支出总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策;金融市场分 析方面主要包括市场投资者参与度、市场资金供求变化、市场估值水平

本基金在价值投资理念的基础上,建立成长策略、主题策略以及动 量策略等多策略体系,并根据市场环境的变化进行针对性运用。具体投 资过程中,本基金通过自下而上的成长股策略,对上市公司进行基本面 研究,精选股票;通过自上而下的主题策略,研究行业轮动与市场热点, 精选行业;通过动量策略进行股票操作层面的动态调整,捕捉市场动量 效应驱动的投资机会。通过以上多种策略的综合应用,本基金建立基金 投资组合,并根据宏观经济状况、公司基本面变化等因素进行动态调整。

本基金对成长型公司的投资以新兴产业、处于周期性景气上升阶段 的拐占行业以及持续增长的传统产业为重占,并精选其中行业代表性 高、潜在成长性好、估值且有吸引力的个股进行投资。 对于新兴产业 在 对产业结构演变趋势进行深入研究和分析的基础上,准确把握新兴产业 的发展方向,重点投资体现行业发展方向、拥有核心技术、创新意识领先 并已经形成明确盈利模式的公司;对于拐点产业,依据对行业景气变化 趋势的研究 结合投资增长索等辅助判断指标 提前发和暑气度进入上 升周期的行业,重点投资拐点行业中景气敏感度高的公司;对于传统产 业,主要关注产业增长的持续性、企业的竞争优势、发展战略以及潜在发 展空间,重点投资具有清晰商业模式、增长具有可持续性和不可复制性

(2) 主题策略

本基金通过对经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势的研 究和分析,深入挖掘潜在的投资主题,并选择那些受惠于投资主题的公 司进行投资。首先,从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多 个角度出发,分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本 性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素,从而前瞻性地发掘 经济发展过程中的投资主题;其次,通过对投资主题的全面分析和评估, 明确投资主题所对应的主题行业或主题板块,从而确定受惠于相关主题 的公司,依据企业对投资主题的敏感程度、反应速度以及获益水平等指 标,精选个股;再次,通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变 化 不断地挖掘和研究新的投资主题 并对主题投资方向做出活时调整 从而准确把握新旧投资主题的转换时机,充分分享不同投资主题兴起所

(3) 动量策略 动量策略是指市场在一定时期内可呈现"强者恒强"的特征,通过 买入过去一段时期的强势股可以获得超越市场平均水平的收益。本基金 将综合分析各股票的市场价格动量特征,分析指标包括各股票的阶段累 计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率,选择动量特征明显和价格 趋势强劲的个股纳人投资组合,作为本基金的辅助投资策略 3、债券资产投资策略

债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用风

险管理和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基 (1)利率预期与久期控制策略

本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏 观经济运行的可能情景, 预测财政政策, 货币政策等政府宏观经济政策 取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测市场利率 水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升 时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。并根据 收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略, 如子弹型组 合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。 (2)个券选择策略

个券选择层面,对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析 后,进行个券选择。财务分析方面,以企业财务报表为依据,对企业规模、 资产负债结构 偿债能力和盈利能力四方面进行评分, 非财务分析方面 (包括管理能力、市场地位和发展前景等指标)则主要采取实地调研和 电话会议等形式实施。

i.价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性,建立债券的估值 模型,对当日无交易的债券计算理论价值,买进价格低于价值的债券; 相反,卖出价格高于价值的债券。

ii 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时, 可以买人期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对 高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时 债券的收益率水平将会较投资期初有所下降, 通过债券的收益率的下 滑,进而获得资本利得收益。

iii.息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将 所获得资金投资于债券以获取超额收益。

iv.利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析,对利差水平 的未来走势做出判断,从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小 时,买人收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的 缩小获得投资收益;当预期利差水平扩大时,买入收益率低的债券同时 卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。 4、股指期货的投资策略

前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性

风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活 跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期 货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值 5、资产支持证券投资策略 资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的

量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏 观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险,信用风险,提前偿还 风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线 策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证

十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指 数收益率×30%

沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深 两市指数,该指数编制合理、透明,有一定的市场覆盖、抗操纵性强,并且 有较高的知名度和市场影响力。中债综合全价指数由中央国债登记结算 有限责任公司编制 样太债券添盖的范围全面 具有广泛的市场代表性 涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限,能够很好地反映中国债券市 场总体价格水平和变动趋势。本基金的业绩比较基准能够使投资者理性 判断本基金产品的风险收益特征,合理地衡量比较本基金的业绩表现。 如果今后法律法规发生变化,或者指数编制机构调整或停止上述指

数的发布,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股票指数时,基金 管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,与基金托管人协 -致,履行适当程序后对业绩比较基准进行相应调整,并报中国证监 会备案并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。 十一、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型

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。 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020年4月21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, 本报告中财务资料未经审计。本投资组合报告所载数据截至2020年 3月31日。

1 报告期末基金资产组合情况

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(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	-	-
С	965VE	77,183,553.78	64.31
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	19,147.31	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	197,206.83	0.16
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,130,429.21	10.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,227,881.60	1.86
М	科学研究和技术服务业	5,792,081.84	4.83
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
O	卫生和社会工作	4,822,086.26	4.02
R	文化、体育和娱乐业	7,522,584.95	6.20
S	综合	-	-
	습난	110,894,971.78	9239
2.2 ‡	设告期末按行业分类的	的港股通投资股票	<b>设资组合</b>

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。 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

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 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

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 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 木基金本报告期末未持有股指期货合约。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的 前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性 风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活 跃的期货合约 木基全在进行股指期货投资时 疼通过对证券市场和期 货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 10.1 本期国债期货投资政策 本基金暂不投资国债期货, 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

11 投资组合报告附注 11.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部 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。

11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规 定的备选股票库之外的股票。 11.3 其他资产构成

序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	36,425.10
2	应收证券清算款	2,362,823.35
3	应收股利	-
4	应收利息	2,175.15
5	应收中胸款	985.22
6	其他应收款	-
7	纯他	-
8	合计	2.402.408.82

11.4 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。 11.5 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。 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项

之间可能存在尾差。 十三、基金的业绩

本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 (一)基金净值表现

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	份鄉净值增长 率①	份額净值 增长率标 准差②	业绩比较基准 收益率③	业域比较基 准收益率标 准差④	0-3	2-3
2019年12月28日-2019年12月31 日	0.25%	0.08%	1.31%	0.54%	-1.06%	-0.46%
2020年1月1日-2020年3月31日	-8.76%	2.16%	-6.37%	1.35%	-2.39%	0.81%
自基金合同生效起至今(2019年 12月28日-2020年3月31日)	-8.53%	2.11%	-5.15%	1.33%	-3.38%	0.78%
2)	II. John Den Le		Lord Laborator II	N. I. states 1		A 41.64

注:(1) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费 用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

(2)本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债 指数收益率×45%

(二)自基金合同转型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

京都の表記の対象がよりと

注:(1)本基金合同生效日为2017年1月25日,转型日期为2019年12 月28日,基金转型至披露时点不满一年:

(2)本基金建仓期为基金合同转型起6个月,截至报告期末,本基金处 建仓期,本基金的资产配置将在建仓期末符合基金契约的相关要求; (3)本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于 发布(证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行))的通知》(口

基协发(2017)6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。 十四、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、期货交易费用

7、基金的银行汇划费用: 8、基金的上市初费和月费:

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

(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×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的其余资产净值 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5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×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

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5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 3 其全会同生效前的相关费田,

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。

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。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十五、对招募说明书更新部分的说明 1、"重要提示"部分

(1)增加了本基金基金合同生效时间;

(2)增加了投资干科创板股票的风险提示: (3)更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据截止日。

2、"三、基金管理人"部分

(1)更新了主要人员情况 3、"四、基金托管人"部分

(1)更新了基金托管人基本情况; (3)更新了基金托管业务经营情况。

4、"五、相关服务机构"部分

(1)更新了直销机构方面信息;

(2)更新了代销机构方面信息。

5、"七、基金的募集"部分

(1)更新了基金的募集。

6、"八、基金合同的生效"部分

(1)更新了基金合同的生效。

7、"九、基金份额的上市交易"部分

(1)增加了本基金上市时间。

8、"十、基金份额的申购与赎回"部分

(1)增加了基金开始办理日常申购、赎回、转换业务时间。

9、"十一、基金的投资"部分

(1)增加了基金投资组合报告。 10、"十二、基金的业绩"部分

(1)增加了基金的业绩。

11、"十七、基金的会计与审计"部分 (1)更新了基金的年度审计

12、"十八、基金的信息披露"部分

(1)更新了基金的信息披露。 13、"十九、风险揭示"部分

(1)更新了本基金特有风险 14、"二十三、对基金份额持有人的服务"部分

(1)更新了对基金份额持有人的服务。 15、"二十四、其他应披露事项"部分 (1)更新了其他应披露事项。

财通基金管理有限公司

二〇二〇年六月十三日