

(上接B074版)

电话:021-20665952
联系人:宁博宇
客服电话:4008219031
63)北京虹点基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区东三环北路17号恒安大厦10层
法定代表人:郑毓栋
客服电话:400-618-0707
64)大泰金石基金销售有限公司
住所:南京市建邺区江东中路102号708室
法定代表人:陈达伟
客服电话:400-928-2266
65)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号财富中心341、342室
法定代表人:季长军
客服电话:400-188-5687
66)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
67)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
68)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
69)类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(入驻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
70)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
71)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
72)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:020-89629094
联系人:黄敏嫦
客服电话:020-89629066
73)北京徽谏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
74)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:段鹏磊
客服电话:400-001-1566
75)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
76)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:祝中社
客服电话:0755-83999907
77)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:齐剑冲
客服电话:400-623-6060
78)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:江晖
客服电话:400-820-1515
79)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
80)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
81)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
82)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
83)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:黄伟
电话:021-51327185
联系人:徐亚丹
客服电话:400-799-1888
84)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

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:钱昊斐
客服电话:4008-909-998
109)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
110)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:杨捷
电话:010-65309516
联系人:李海燕
客服电话:400-673-7010
111)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:余永健
客服电话:400-021-8850
112)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
电话:010-52858244
联系人:魏晨
客服电话:400-6099-200
113)和耕财富基金销售有限公司
住所:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路由、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
114)民商基金销售有限公司(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:袁惠琴
客服电话:021-50206003
115)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12号
法定代表人:王荻
客服电话:0851-88235678
116)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
117)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
118)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
119)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:韩霖
客服电话:400-000-5767
120)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
121)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
122)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
123)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
124)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:马永涛
客服电话:021-50701082
基金管理人可根据有关法律法规的要求增加、更换其他机构销售本基金,并在管理人公司网站公示。
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
电话:010-56517000
传真:010-56517001
联系人:李同庆
网址:www.zrfund.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号南新仓国际大厦A座502室
办公地址:北京市东城区东四十条甲22号南新仓国际大厦A座502室
负责人:云大慧
电话:010-64096085
传真:010-64096188
联系人:唐珏
经办律师:云大慧、唐珏
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

中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金类型、运作方式与存续期间

1. 基金类型:混合型。
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

本基金通过积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的优势上市公司,同时通过优化风险收益配比来追求绝对收益,力求实现基金资产的长期稳定增值。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资对象是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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,以及债券等固定收益类金融工具(包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、债转股、银行存款、货币市场工具等)、国债期货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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为0-95%;权证投资比例为基金资产净值的0-3%。本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略

1. 大类资产配置
从宏观经济环境和证券市场走势进行研判,综合考虑相关类别资产的风险收益水平,动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例,优化投资组合。
2. 股票投资策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略,从宏观经济转型、政策制度导向、产业的升级与变革等多个角度,前瞻性地判断下一阶段可能涌现出的新机遇领域和板块,同时从定性和定量的角度,自下而上地分析上市公司的基本面情况和估值水平,精选受益于“新机遇”具有投资价值个股。
在行业的配置选择上,本基金将持续跟踪、研究分析受益于新机遇发展的典型产业,选择其中受益程度高、成长性好的相关主题行业进行重点配置,并积极更新调整新机遇主题的范畴界定。

在个股的具体选择策略上,采取自上而下的方式,主要从定量分析、定性分析两个方面对上市公司进行考察,精选个股。并根据市场走势与上市公司基本面的变化,适时调整股票投资组合。

定量分析

- (1)成长性指标:主营业务收入增长率、净利润增长率等;
- (2)财务指标:毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等;
- (3)估值指标:市盈率(PE)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市销率(PS)和总市值。绝对估值与相对估值相结合。

定性分析

- (1)公司的核心竞争力,体现在行业地位、市场占有率、产品、技术、品牌、营销、资源、渠道等多个方面;
- (2)具有良好的公司管理能力和治理结构。

3. 债券投资策略

通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。固定收益类资产中,本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略,在不同券种之间进行配置。

4. 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保值综合考虑:

- (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性;
- (3)通过股指期货进行套期保值交易的必要性;

本基金将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。

5. 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。

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。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中等预期收益产品。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2020年6月12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2020年3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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	47,343,243.97	66.46
	其中:股票	47,343,243.97	66.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,422,885.00	7.61
	其中:债券	5,422,885.00	7.61
	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:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,196,201.09	26.54
8	其他资产	279,267.96	0.39
9	合计	71,241,688.02	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、渔业	3,666,300.00	5.40
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,482,640.00	62.31
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	410,500.00	0.61
F	批发和零售业	947,127.11	1.40
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	2,287,370.00	3.37
J	金融业	1,375,424.88	2.03
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	984,362.88	1.47
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	2,179,500.00	3.21
S	综合	-	-
	合计	47,343,243.97	69.79

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	600216	浙江医药	200,000	3,760,000.00	5.63
2	002714	亿帆股份	30,000	3,666,300.00	5.40
3	000976	新希望	100,000	3,143,000.00	4.63
4	000641	长春高新	5,000	2,740,000.00	4.04
5	002107	华明机械	140,000	2,468,400.00	3.60
6	300790	迈瑞医疗	10,000	2,617,000.00	3.86
7	300413	仁东控股	50,000	2,179,500.00	3.21
8	603501	韦尔股份	13,000	2,026,700.00	2.99
9	002124	天智股份	170,000	1,982,200.00	2.92
10	603363	德克生物	90,000	1,938,000.00	2.86

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,853,460.00	5.68
4	企业债/公司债	3,853,460.00	5.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,569,420.00	2.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,422,885.00	7.99

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	106802	周开1704	38,500	3,853,460.00	5.68
2	128021	兄弟转债	10,000	1,254,300.00	1.86
3	127015	希思转债	2,000	316,120.00	0.46

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投资。

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投资。

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,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

11.2 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	123,793.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,477,108.38
5	应收申购款	8,008.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,299,207.96

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	128021	兄弟转债	1,254,300.00	1.86

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

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。基金业绩数据截至2020年3月31日。

本基金合同生效日为2015年5月4日,基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

一、本报告期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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
自基金合同生效日(2015年5月4日)起至2015年12月31日止	1.50%	0.16%	-9.43%	1.52%	10.93%	-1.36%
2016年1月1日至2016年12月31日	-2.86%	0.38%	-7.52%	1.01%	4.66%	-6.39%
2016年7月1日至2016年12月31日	1.32%	0.18%	3.40%	0.42%	-2.08%	-0.24%
2017年1月1日至2017年6月30日	0.20%	0.18%	6.03%	0.31%	-5.73%	-0.13%
2017年7月1日至2017年12月31日	-0.20%	0.23%	5.56%	0.39%	-5.76%	-0.16%
2018年1月1日至2018年6月30日	-1.10%	0.27%	-5.94%	0.64%	4.84%	-0.32%
2018年7月1日至2018年12月31日	-15.69%	1.20%	-6.68%	0.92%	-9.01%	-0.38%
2019年1月1日至2019年6月30日	8.16%	1.09%	15.53%	0.85%	-7.37%	0.24%
2019年7月1日至2019年12月31日	-8.44%	1.12%	5.02%	0.67%	-13.42%	0.65%
2020年1月1日至2020年6月30日	-7.47%	2.36%	-4.40%	1.06%	-3.07%	1.30%