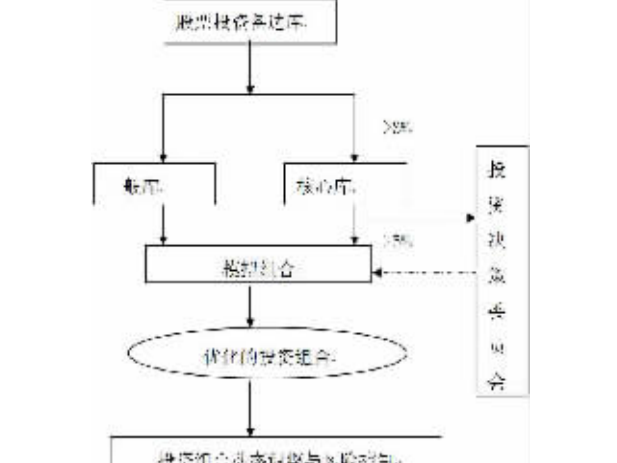
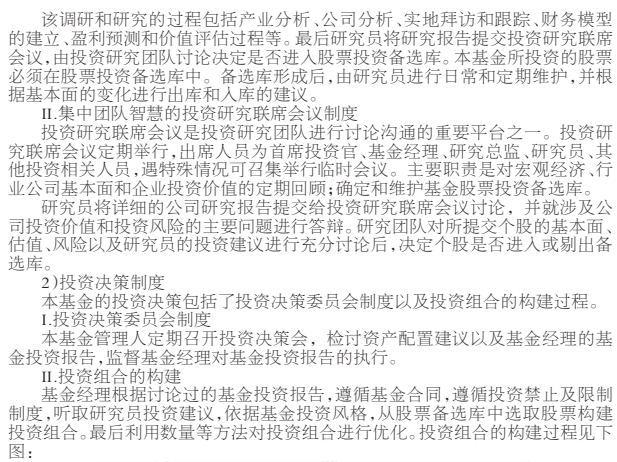


(上接 B3版) 法定代表人:郭林 联系人:陈媛 客服电话:4008205999 传真:021-68774818 公司电话:021-63898952 公司网址:www.dhbx.com (50)一路财富信息科技有限公司 (77)北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 法定代表人:吴雪秀 客服电话:400 001 1566 网站:www.yihufu.com (51)北京恒天明泽基金销售有限公司 注册地:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层 法定代表人:李悦 联系人:张晔 电话:010-56642602 网站:http://hmz.lhvcn.com/ (52)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司 注册地: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:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A 法人代表:高峰 联系电话:0755-83655588 传真号码:0755-83655518 客服电话:400-804-8688 公司网址:www.keenest.com (53)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 注册地:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦A座707 法定代表人:张彦 联系电话:010-83363101 公司传真:010-83363072 客服电话:400-168-1188 官网网址:http://jr.jr.com.cn/ (54)北京君得特瑞财富管理咨询有限公司 注册地: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十八号院京东集团总部 法人代表:陈超 联系电话:010-89189285 公司传真:010-89189566 客服电话:个人业务:95118 企业业务:400 088 8816 官网网址:http://jr.jd.com (55)上海中正达广基金销售有限公司 注册地:上海市徐汇区龙漕路2815号302室 办公地址:上海市徐汇区龙漕路2815号302室 法人代表:黄欣 联系电话:021-33768132 公司传真:021-33768132-802 客服电话:400-6767-523 官网网址:http://www.zwzwh.com (56)上海嘉惠基金销售有限公司 注册地: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:上海市杨浦区昆明路518号A1002室 法定代表人:王翔 电话:021-65370077-220 传真:021-55085991 网址:www.jiweifund.com 客户服务电话:021-65370077 (57)上海朔阳永承基金销售有限公司 注册地:上海浦东新区上丰路977号1幢B座812室 办公地址:上海市浦东新区碧城路600号4号楼2楼 法人代表:廖冰 联系电话:021-80234888 官网地址:www.998fund.com 客服电话:4009987172 (58)武汉市信嘉基金销售有限公司 注册地:武汉市江汉区中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4、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)第七幢23层1号4、4号 法人代表:陶捷 公司传真:027-87006010 客服电话:400-027-9899 官网网址:www.buymfunds.com (59)贵州神州聚财基金销售有限公司 注册地:贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区C栋标准厂房 办公地址:贵州省贵阳市云岩区北京路9号君源大厦16楼 法人代表:李陆军 公司传真:0851-86090950 客服电话:400-839-1818 官网网址:www.bzhtfund.com (60)上海大智慧基金销售有限公司 注册地:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元 法人代表:申健 联系电话:021-20219988 公司传真:021-20219988 客服电话:021-20292031 官网网址:https://8.gw.com.cn (61)通华财富(上海)基金销售有限公司 注册地: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 联系电话:021-60818588 设立时间:2013/2/8 法人代表:钱慧 客服电话:400-66-95156 公司网址:www.tonghuafund.com (62)中期资产管理有限公司 注册地:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号 办公地址:北京市朝阳区光华路16号A座4层 法人代表:姜新 联系人:李慧恒 联系电话:13520314419 客服电话:010-65807865 公司官网:www.cifcofund.com (63)上海挖财金融信息服务有限公司 注册地: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 法人代表:胡晓莺 联系人:樊璐璐 联系电话:021-50810673 客服电话:021-50810687 公司官网:www.wacaijin.com (64)厦门市鑫鼎盛控股有限公司 注册地:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼 法人代表:陈进生 联系人:陈承智 联系电话:0592-3122673 客服电话:400-918-0808 公司官网:www.xds.com.cn (65)万联证券股份有限公司 办公地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18层 法定代表人:张建军 客服电话:400888133 网站:www.wljz.com (66)天津万家财富资产管理有限公司 注册地: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:李磊 电话:010-59190666 网站:www.wjcfund.com (67)济安财富(北京)资本管理有限公司 注册地:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室 法定代表人:杨健 联系人:李海婧 (68)北京嘉实基金销售有限公司 注册地:北京市朝阳区望京东路2号1号楼36层3603室 办公地址:北京市朝阳区朝明门北大街8号富华大厦F座12B 法人代表:程刚 客服电话:400-100-3391 公司官网:www.bjzfund.com (69)北京格上富信基金销售有限公司 注册地: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:李悦 电话:010-85994745 传真:010-85932427 客服电话:400-066-8586 官网网址:www.igesafe.com (70)中民财富管理(上海)有限公司 注册地:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元 办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层 联系人:蒋洪军 联系电话:021-3335392 公司传真:021-63353736 客服电话:400-876-5716 官网网址:www.cmiwm.com (71)民商基金销售有限公司 注册地:北京市朝阳区东三环北路H区东恒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 联系电话:021-50206003 网站:www.msfc.com (72)北京蛋卷基金销售有限公司 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 法定代表人:钟建华 电话:010-61840688 网站:https://danjuanapp.com (73)大连网金基金销售有限公司 注册地:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦202室 办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦202室 客服电话:400899100 网站:http://www.yibaijin.com/ (74)北京盈泰有限责任公司 注册地:北京市朝阳区科技中一路西苑高新新发展大厦7层8层 办公地址:深圳南山区科技中一路西苑高新新发展大厦7层8层 法人代表:黄扬录 客服电话:95329 网站:http://www.zsqj.com (75)广州证券股份有限责任公司 注册地:广州市天河区珠江新城西苑5号广州国际金融中心19-20楼 客服电话:95398 网站:http://www.gzs.com.cn (76)嘉实财富管理有限公司

注册地:上海市浦东新区世纪大道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 联系人:李雯 公司电话:400-6084236 客服电话:400-021-8850 官网地址:www.harvestwm.com (77)东海证券股份有限公司 地址:上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法人代表:赵俊 客服电话:95531 网站:http://www.longone.com.cn (79)北京君得特瑞财富管理咨询有限公司 注册地:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B 法人代表:李振 客服电话:400-829-1218 官网网址:www.kstrea.com (80)北京植信基金销售有限公司 注册地:北京市密云县云来街8号院2号楼106室-67 办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号 法人代表:于龙 联系电话:010-56075718 公司传真:010-67767615 客服电话:400-6802-123 官网网址:www.zhixin-inv.com (81)深圳前海汇联基金销售有限公司 注册地: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:深圳南山区高新南路6大道6号迈科大厦1901室 法人代表:薛峰 联系人:周强 联系电话:0755-26900826-8125 客服电话:400-9928-211 官网网址:www.xmzfund.com 基金管理人可根据有关法律、法规的要求,增加其他符合要求的机构代理销售 本基金,并及时公告。 (二)登记机构 名称:中信保诚基金管理有限公司 住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层 法定代表人:张朔 客服电话:400-6660066 联系人:金芬芳 电话:021-68649788 网站:http://www.citicprcfund.com.cn/ (三)出具法律意见书的律师事务所 名称:上海市通力律师事务所 住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼 办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼 负责人:俞卫锋 经办律师:黎明、孙睿 电话:021-31358666 传真:021-31358600 联系人:孙睿 (四)审计会计师事务所 名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展恒大厦6楼 办公地址:上海市浦东新区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼 负责人:朱建弟 经办会计师:陈熹、赵钰 四、基金的名称 信诚幸福消费混合型证券投资基金 五、基金的类型 契约型开放式 六、基金的投资目标 本基金主要投资于消费服务行业中具有持续增长潜力的优质上市公司,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳定增值。 七、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(含中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、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:本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的60%-95%;其中投资于上市公司发行的股票市值不低于基金资产的60%,其中投向消费服务行业上市公司发行的股票市值不低于非现金基金资产的80%;其中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;权证不超过基金资产净值的3%。 八、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,将其纳入基金的投资范围。 九、基金的投资策略 (1)大类资产配置策略 本基金在大类资产配置过程中,以对宏观经济和股票市场的前瞻性判断作为主要依据,并将优先考虑对于股票类资产的配置,主要考虑指标包括:宏观经济因素、微观经济指标、政策环境因素、股票市场因素等。 (2)股票投资策略 1)对消费服务行业的界定 基于对消费服务行业发展形势和未来趋势的深刻理解,本基金对于消费服务行业的界定为:在传统消费行业基础上,根据居民对于该行业产品或服务的需求的依赖程度可以分为主要消费品行业和可选消费品行业。主要消费品指与居民的基本生活需求高度相关的商品或服务;可选消费品指居民生活必需的、主要用于改善居民生活品质的商品和服务,居民可以自行选择是否进行消费。此外,一些行业虽然目前尚未被列入传统消费行业,但是其属性已经具备消费服务行业属性,形成实际的消费需求,并带动一系列相关的行业发展。本基金也将与相关上市公司合作,定义其为消费服务行业,包括但不限于金融地产、医药卫生、信息技术、电信业务以及工业行业中消费服务属性明显的特殊行业等。 2)行业配置策略 本基金将结合各行业国家政策、经济周期和行业估值等三个维度对消费服务行业各个子行业进行研究和分析,并在此基础上实现基金权益资产在各个子行业之间的合理配置和灵活调整。主要的考虑因素如下:国家政策、经济周期、行业估值。 3)个股精选策略 本基金在进行个股筛选时,主要从定性和定量两个角度对行业内上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司。 A. 定性分析 根据对消费服务行业各个上市公司的发展情况和盈利状况的判断,从公司的管理经营能力、核心竞争力、主营产品或服务、市场占有率、现金流分析等多个方面,选取与相关行业内上市公司能够带来的投资回报相匹配的上市公司。 B. 定量分析 在精选消费服务行业股票的基础上,主要考察上市公司的成长性、盈利能力和其估值指标,选取具备成长性良好、估值合理的股票。 (3)债券投资策略 本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下,实现预期与风险相匹配的投资收益。主要的债券投资策略有: 1)久期控制策略 在对利率变化和趋势判断的基础上,确定恰当的久期目标,合理控制利率风险。根据对市场利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获取债券价格上升带来的收益;在预期利率上升时,缩短组合久期,以规避债券价格下降的风险。 2)类属策略 通过研究宏观经济状况、货币市场及债券市场资金供求关系,以及市场投资热点,分析国债、金融债、企业债等各类债券品种的利差水平,评价不同债券类属的相对投资价值,确定资产在不同债券类属之间的配置比例。 3)收益率曲线配置策略 通过对央行货币政策、经济增长率、通货膨胀率 and 货币供应量等多种因素的分析来预测收益率曲线形状的风险变化,在长期限确定的基础上,充分把握收益率曲线的非平行移动带来的机会,根据利率曲线预期,选择哑铃型组合、子弹型组合或梯型组合。 4)可转换公司债券投资策略 本基金在综合分析可转债债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上,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,并且其基础股票的基本面良好、具有较好盈利能力和成长前景、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,能在内含收益率、折溢价水平、久期、凸性等要素构建可转换公司债券投资组合,获取稳健的投资回报。 5)资产支持证券投资策略 本基金将深入分析资产支持证券定价的多种影响因素,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、违约率等,采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。 6)回购套利 本基金将在相关法律法规以及基金合同规定的比例内,适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率,比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险套利操作。 (4)权证投资策略 本基金将根据相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金在进行权证投资时,将在对权证标的证券基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合。 (5)股指期货投资策略 基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中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。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。 (6)基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序 本基金管理人制定了严格的投资研究流程和投资决策制度,以保证本基金产品的投资目标、投资理和和资产策略的贯彻实施。 1)投资研究流程 本基金管理人通过严格的投资研究流程充分体现团队智慧,最大限度地降低对上市公司基本面判断错误带来的风险。本基金的投资研究流程见下图:



(四)投资限制 1.组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1)本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的60%-95%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的60%,其中投向消费服务行业上市公司发行的股票的比例不低于非现金基金资产的80%; (2)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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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; (3)本基金持有以上一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%; (4)本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%; (5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%; (6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%; (7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%; (8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%; (9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%; (10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%; (11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%; (12)本基金投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出; (13)本基金参与股指期货交易,本基金持仓的合约金额不超过本基金的总资产,本基金持仓的股票市值不超过该次发行股票公司本次发行股票的总量; (14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%; (15)本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等; (16)本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%; (17)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%; (18)本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值不得超过基金资产净值的15%;因市场波动,上市公司股票停牌,基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条前述比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (19)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。 (20)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除上述第(2)、(12)、(18)、(19)项以外,因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人以外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,法律法规或监管部门取消上述限制,从该规定之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起实施。 法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人可在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。 2.禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动: (1)承销证券; (2)违反规定向他人贷款或者提供担保; (3)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动; (4)买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外; (5)向基金管理人、基金托管人出资; (6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动; (7)法律、行政法规和国务院证券监督管理机构禁止的其他活动。 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循持有人利益优先原则,公平对待投资者,建立健全内部审批机制和评估机制,按照公平合理价格执行,相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应经基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事批准。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。 法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。 九、基金的业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中证综合债指数收益率(%) 十、基金的风险收益特征 本基金属于混合型基金,预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。 十一、基金投资组合报告(未经审计) 本基金管理人董事会及董事保证本报告所载数据不存在虚假记载、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。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同的约定,于2019年4月17日复核了本报告投资说明书中的投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 本投资组合报告的投资数据截至2019年3月31日。 1.报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 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 本基金本报告期内未进行贵金属投资。 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 本基金本报告期内未持有权证。 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期内未进行股指期货投资。 2) 本基金投资股指期货的投资政策 基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中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。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 1) 本期国债期货投资政策 本基金本报告期末未持有国债期货投资。 2) 报告期末未持有国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期内未进行国债期货投资。 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投资。 11. 股指期货投资情况 1) 本基金本报告期末前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内因违规公开证券、处罚。 2) 本基金本报告期末前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。 3) 其他资产构成

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

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。 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不存在流通受限情况。 十二、基金的业绩 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。基金业绩数据截至2019年3月31日。



注:1. 本基金建仓期自2014年4月29日至2014年10月31日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同约定。 2. 自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中信综合债指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

(二) 费用概况 1. 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事务所、律师事务所和诉讼费; 5. 基金的销售服务费; 6. 基金的银行汇兑费用; 7. 基金的投资过程中发生的基金合同项下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。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。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,及时联系托管人协商解决。 2. 基金托管人的托管费 本基金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。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。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,及时联系托管人协商解决。 上述“一、基金费用的种类”中第3—8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。 十四、对招募说明书更新部分的说明 本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理更新,对原《信诚幸福消费混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下: 1. 在“基金管理人”部分更新了相应日期 2. 在“基金管理人”部分“主要人员情况”部分,更新了相关成员的内容。 3. 在“五、相关服务机构”部分,根据实际情况对销售机构的相关内容进行了更新。 4. 在“八、申购与赎回的数量限制”部分,更新了申购与赎回数量与份额限制的描述。 5. 在“九、基金的投资”部分,更新了“基金投资组合报告”,财务数据截止至2019年3月31日。 6. 在“基金业绩”部分,更新了该节的内容,数据截至至2019年3月31日。 7. 在“二十一、其他应披露事项”部分,披露了自2018年10月30日以来涉及本基金的相关公告。

注:1. 本基金建仓期自2014年4月29日至2014年10月31日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同约定。 2. 自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中信综合债指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。 (二) 费用概况 1. 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事务所、律师事务所和诉讼费; 5. 基金的销售服务费; 6. 基金的银行汇兑费用; 7. 基金的投资过程中发生的基金合同项下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。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。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,及时联系托管人协商解决。 2. 基金托管人的托管费 本基金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。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。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,及时联系托管人协商解决。 上述“一、基金费用的种类”中第3—8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。 十四、对招募说明书更新部分的说明 本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理更新,对原《信诚幸福消费混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下: 1. 在“基金管理人”部分更新了相应日期 2. 在“基金管理人”部分“主要人员情况”部分,更新了相关成员的内容。 3. 在“五、相关服务机构”部分,根据实际情况对销售机构的相关内容进行了更新。 4. 在“八、申购与赎回的数量限制”部分,更新了申购与赎回数量与份额限制的描述。 5. 在“九、基金的投资”部分,更新了“基金投资组合报告”,财务数据截止至2019年3月31日。 6. 在“基金业绩”部分,更新了该节的内容,数据截至至2019年3月31日。 7. 在“二十一、其他应披露事项”部分,披露了自2018年10月30日以来涉及本基金的相关公告。

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 本基金本报告期末未持有港股通投资股票。 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