本基金还可投资于股票和权证等权益类资产

网址: www.5ifund.com

法定代表人:罗细安

电话:010-67000988

传真:010-67000988

53、北京增财基金销售有限公司 住所:北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址:北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

客户服务电话:400-001-8811 (上接C40版) 住所:北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 网址:www.zcvc.com.cn 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街 1号国贸大厦 2座 27层及 28层 54、上海利得基金销售有限公司 住所: 上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 法定代表人:丁学东 办公地址:上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼 电话:010-65051166 法定代表人:李兴春 联系人:赵沛然 客服电话:400-910-1166 电话:021-50583533 网址:www.cicc.com.cn 传真:021-50583633 34、平安证券股份有限公司 住所:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层 客服电话: 400-921-7755 网址: www.leadfund.com.cn 55、北京恒天明泽基金销售有限公司 住所:北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室 办公地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层(518048) 法定代表人:刘世安 联系人:周一涵 电话:021-38637436 传真:021-58991896 联系人:马鹏程 联系电话:13501068175 客服电话:95511-8 网址:stock.pingan.com 传真:010-56810628 35、东兴证券股份有限公司 客服:4008980618 住所:北京市西城区金融大街 5号新盛大厦 B座 12、15层 网址:www.chtfund.com 56、上海陆金所基金销售有限公司 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元办公地址:上海市浦东 办公地址:北京市西城区金融大街 5号新盛大厦 B座 12、15层 法定代表人:魏庆华 联系人: 夏锐 新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 电话:010-66559079 法定代表人:郭坚 传真:010-66555147 联系人:宁博宇 客服电话:95309 联系电话:021-20665952 网址:www.dxzq.net 36、国金证券股份有限公司 传真:021-22066653 客服:4008219031 住所:四川省成都市东城根上街95号 网址: www.lufunds.com 57.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:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元 办公地址:四川省成都市东城根上街 95 号 联系人:刘婧漪 电话:028-86690057 法定代表人:胡伟 联系人:牛亚楠 联系电话:010-65951887 传真: 028-86690126 客服电话:95310 网址:www.gjzq.com.cn 37、华龙证券股份有限公司 传真:010-65951887 客服:400-618-0707 住所: 兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼办公地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼 网址:www.hongdianfund.com 58、上海汇付金融服务有限公司 住所:上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 办公地址:上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人:李晓安 联系人:范坤 法定代表人:冯修敏 电话:0931-4890208 联系人: 陈云卉 联系电话: 021-33323999-5611 传真:0931-4890628 客户服务电话:95368 网址: www.hlzq.com 传直:021-33323837 38、华金证券股份有限公司 住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层 客服:400-820-2819 网址: www.chinapnr.com 59、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层 住所:上海市虹口区飞虹路 360 弄 9号 3724 室 办公地址:上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B座 12 楼 联系人:郑媛 电话:021-20655746 客户服务电话:4008211357 法定代表人:汪静波 网址:https://www.huajinsc.cn 联系人:李娟 39、民生证券股份有限公司 住所:北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层 联系电话:021-38509735 传真:021-38509777 办公地址:北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层 客服:400-821-5399 联系人:韩秀萍 网址: www.noah-fund.com 电话:010-85127999 60、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 传真:010-85127888 客户服务电话:95376 网址: www.mszq.com 法定代表人:陈继武 40、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外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层 联系人:葛佳蕊 联系电话:021-63333389 传真:021-63332523 法定代表人, 李科 客服:4000178000 客户服务电话:95510 网址: www.lingxianfund.com 61、珠海盈米财富管理有限公司 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 办公地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元 联系电话:020-89629012 传真:020-89629011 62. 大泰金石基金销售有限公司 住所: 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室 客户服务热线:95532、400-600-8008 网站: www.china-invs.cn 42、大连网金基金销售有限公司 办公地址:上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼 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:袁顾明 办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室 法人代表:樊怀东 联系人:朱海涛 联系电话:021-20324158 传真:021-20324199 电话:0411-39027810 客服电话:400-928-2266 传真:0411-39027835 客户服务热线: 4000-899-100 网址:www.dtfunds.com 63、海银基金销售有限公司 网址:www.yibaijin.com 43、上海长量基金销售投资顾问有限公司 住所:上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元 办公地址:上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼 住所:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 法定代表人:刘惠 办公地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层 联系人:毛林 联系电话:021-80133597 传真: 021-80133413 客服电话: 400-808-1016 联系人:单丙烨 电话:021-20691832 网址:www.fundhaiyin.com 64、上海联泰资产管理有限公司 传真:021-20691861 客户服务电话:400 820 2899 网址:www.erichfund.com 44、蚂蚁(杭州)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 任所:杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼 法定代表人:燕斌 联系人:陈东 法定代表人:陈柏青 联系电话:021-52822063 联系人:韩爱彬 传真:021-52975270 传真:0571-26698533 客服电话:4000-466-788 客户服务电话:400 076 6123 网址: www.66zichan.com 网址:www.fund123.cn 65、北京汇成基金销售有限公司 45、深圳众禄基金销售股份有限公司 住所:深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元 住所:北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 法定代表人:王伟刚 法定代表人:薛峰 联系电话:010-56282140 联系人: 童彩平 电话:0755-33227950 传真:010-62680827 传真:0755-33227951 客服电话:400-619-9059 客户服务电话:400 678 8887 网址: www.fundzone.cn 网址: www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com 66、凤凰金信(银川)投资管理有限公司 住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142号 14层 46、上海好买基金销售有限公司 住所:上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室 办公地址:上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室 办公地址:北京市朝阳区来广营中街甲1号 朝来高科技产业园5号楼 法定代表人:杨文斌 法定代表人:程刚 联系人:张旭 联系电话:010-58160168 联系人:张茹 电话:021-20613999 传真: 021-68596916 传真:010-58160181 客户服务电话:400 700 9665 客服:400-810-5919 网址:www.ehowbuy.com 47、上海天天基金销售有限公司 网址:www.fengfd.com 67、乾道盈泰基金销售(北京)有限公司 住所:浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室 办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼 住所:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室 办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室 法定代表人:其实 联系人:屠彦洋 联系人: 高雪超 电话:021-54509998-2010 联系电话:010-62062880 传直:021-64385308 传真:010-82057741 客户服务电话:400 1818 188 客服:400-088-8080 网址:www.qiandaojr.com 68、深圳富济基金销售有限公司 网址: www.1234567.com.cn 48、北京展恒基金销售股份有限公司 住所:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层 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 办公地址:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层 法定代表人:闫振杰 法定代表人:刘鹏宇 联系人:宋丽冉 联系人:刘勇 电话:0755-83999907-8814 电话:010-62020088 传真:010-62020355 客户服务电话:400 888 6661 传真:0755-83999926 客户服务电话: 0755-83999907 网址:www.myfund.com 49、中国国际期货有限公司 住所:北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层 网址:www.jinqianv 69、北京肯特瑞财富基金销售有限公司 位为2.5元时间测量基金,所有目标区型 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十八号院京东集团总部 办公地址:北京市朝阳区麦子店西路 3 号新恒基国际大厦 15 层 法定代表人:王兵 联系人:许黎婧 法定代表人: 江卉 电话:010-65807848 联系人,万容 传真:010-59539806 电话:18910325400 传真:010-89189289 客户服务电话:个人业务:95118 , 400 098 8511 企业业务:400 088 8816 客服电话:95162或400 888 8160 网址:www.cifco.net 50、北京钱景基金销售有限公司 住所:北京市海淀区丹楼街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 网址:fund.jd.com 70、上海基煜基金销售有限公司 办公地址:北京市海淀区丹棱街 6号 1幢9层 1008-1012 法定代表人:赵荣春 住所:上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室 办公地址:上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室 联系人:申泽灏 法定代表人:王翔 电话:010-57418813 联系人:李鑫 电话:021-65370077 传真:010-57569671 客服电话:400 678 5095 传真:021-55085991 网址:www.niuji.net 客户服务电话: 400-820-5369 51、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 网址:www.jiyufund.com.cn 71、一路财富(北京)基金销售股份有限公司 住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# 住所:北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室 办公地址:北京市海淀区奥北科技园 - 国泰大厦 9 层 办公地址:北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼7层 727 室 注定代表人,杨懿 法定代表人:吴雪秀 联系人:张燕 联系人:吕晓歌 电话:010-58325388-1588 传真:010-58325282 电话:010-88312877 传真:010-88312099 客服电话:400-166-1188 客服电话:400-001-1566 网址: 8.jrj.com.cn 网址: www.vilucaifu.com 72、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 52、浙江同花顺基金销售有限公司 住所: 杭州市文二西路 1 号 903 室 办公地址: 浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼 办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层 法定代表人:凌顺平 法定代表人:毛淮平 联系人:刘晓倩 联系人: 仲秋玥 联系电话:0571-88911818 电话:010-88066632 传真:0571-88910240 传真:010-63136184 客服电话:4008-773-772 客户服务电话: 400-817-5666

网址: www.amcfortune.com

法定代表人:赵学军

电话:010-85097570

联系人: 余永键

73、嘉实财富管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10

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:010-85097308 客户服务电话:400-021-8850 网址:www.harvest 74、上海中正达广基金销售有限公司 住所:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室 办公地址:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室 联系人:戴珉微 电话:021-33768132 传真:021-33768132*802 客户服务电话:400-6767-523 网址:www.zzwealth.cn 75、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 联系人:叶健 电话:0755-89460507 传真:0755-21674453 客户服务电话:400-684-0500 网址: www.ifastps.com.cn 76、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) , BINA 37 办公地址:深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A 法定代表人:高锋 联系人:李勇 电话:0755-83655588 传真:0755-83655518 客户服务电话:400-804-8688 网址: www.keynesasset.com 77、武汉市伯嘉基金销售有限公司 住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第7栋 23 层 1号, 4号 办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 栋 23 层 1 号、4 号 法定代表人:陶捷 联系人:孔繁 电话:027-87006003*8020 传真:027-87006010 客户服务电话: 400-027-9899 网址:www.buyfunds.cn 788. 济安财富(北京)基金销售有限公司 住所: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号北京财富中心A座46层 联系人:李海燕 电话:010-65309516 传真:010-65330699 客服电话:400-673-7010 网址: www.jianfortune.com 79、方德保险代理有限公司 住所:北京市东城区东直门南大街 3 号楼 7 层 711 办公地址:北京市朝阳门外大街 18 号丰联广场 A 座 1009 联系人:胡明哲 电话:15810201340 传真:028-62825388 客服电话:010-64068617 网址:www.jhjfund.com 80、天津市润泽基金销售有限公司 住所:天津市和平区南京路 181 号世纪都会 1606-1607 办公地址:天津市和平区南京路 181 号世纪都会 1606-1607 联系人:孟媛媛 电话:18920017760 传真:022-23297867 客户服务电话:400-706-6880 网址:www.fhcfij.com 81、泰诚财富基金销售(大连)有限公司 住所:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号 联系人:徐江 电话:18840800358 客服电话:400-0411-001 研址:www.haojyoujjiin.com 82.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:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 法定代表人:钟斐斐 联系人:侯芳芳 电话:010-61840688 客服电话:400-159-9288 网址: danjuanapp.com 83、中民财富基金销售(上海)有限公司 任所:上海市黄浦区中山南路 100号7层 05单元 办公地址:上海市莆东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1号楼 27层 法定代表人,弭洪军 联系人: 苗鹏 电话:18521506916 客服电话:400-876-5716 网址: www.cmiwm.com 893世 WWW.thinWill.toll 84、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:南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道 1号 法定代表人:王锋 电话:13016933367 客服电话:025-66996699 网站:www.snjijin.com 85、西藏东方财富证券股份有限公司 住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 办公地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 法定代表人:陈宏 联系人:付佳 电话:17717379005 客服电话:95357 网站: www.18.cn 86、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 办公地址:南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室 联系人:孙平 电话:13564999938 客服电话:025-66046166 网站: www.huilinbd.com 87、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 办公地址:广东省深圳市南山区高新南十道 深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室 法定代表人:杨艳平 联系人:莫婉 电话:13923830997 客服电话: 400-1286-800 网站: www.caiho.cn 88、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 联系人:张萌 电话:18600730680 客服电话:400-6997-719 网站: www.xiquefund.com 89,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 电话:010-59336544 客服电话:4008-909-998 网站: www.inlc.com 名称: 东方基金管理有限责任公司 住所:北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 办公地址:北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 法定代表人:崔伟 联系人:肖向辉 电话:010-66295871 传真:010-66578680 网址: www.orient-fund.com 或 www.df5888.com (四)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:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼 办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼 负责人:俞卫锋 联系人:孙睿 电话:021-31358666 传真:021-31358600 经办律师:黎明、孙睿 (五)审计基金财产的会计师事务所 名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:上海市南京东路 61 号 4 楼 办公地址:北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层 法定代表人:朱建弟 联系人:朱锦梅 电话:010-68286868 传真:010-88210608 经办注册会计师:朱锦梅、高慧丽五、基金名称和基金类型 一)本基金名称:东方双债添利债券型证券投资基金 (二)本基金类型:债券型基金(三)基金运作方式:契约型、开放式六、基金的投资目标和投资范围 (一)基金的投资目标 在适度承担信用风险并保持基金资产流动性的条件下,对固定收益类资产进行积极主动的投资管理,在此基础上通过个股精选配置权益类资产,实现基金资产 长期、稳定的投资回报。

(二)基金的投资方向

具(但须符合中国证监会相关规定)。

债券、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)、货币市场

工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工

公司债、中期票据、短期融资券、商业银行金融债与次级债、中小企业私募债券、资

本基金主要投资于国债、地方政府债、中央银行票据、政策性金融债、企业债、

产支持证券、可转换债券(含分离交易的可转换债券)、债券回购、银行存款等固定 收益类资产。本基金所指的信用债券是指企业债、公司债、中期票据、短期融资券、商业银行金融债与次级债、中小企业私募债券、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非国家信用的债券类品种。 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。 程序后,可以将具纲人投资记围。 基金的投资组合比例为:债券资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%,权证投资比例不超过基金资产净值的3%;现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中,现金不包括结 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

算备付金、存出保证金、应收申购款等。 当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产 配置比例进行适当调整。 七、基金的投资策略 一)大类资产配置策略 本基金主要投资于债券市场,在严控投资风险的基础上,通过投资于股票市场提高投资收益。本基金紧密跟踪债券市场与股票市场的运行情况和风险收益特征,结合对宏观经济环境、国家政策趋向及利率变化趋势等重点分析,判断债券市场和股票市场的相对投资价值,在债券资产与股票资产之间进行动态调整。 (二)固定收益类资产投资策略 根据资产的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素,本基金将债 券市场主要细分为一般债券(含国债、中央银行票据、政策性金融债等)、信用债券(公司债、企业债、金融债(不含政策性金融债)、资产支持证券、短期融资券、中小企 公司顺、正亚顺、金融顺(介含政原任金融顺)(为) 关行证券、短期融页券、干小正业私募债券、中期票据等)、附权债券(含可转换债券、分离交易可转换债券、含回售及赎回选择权的债券等)三个子市场。通过深入研究宏观经济发展状况、预测价格和利率变化趋势,在债券组合久期调整及期限结构配置基础上,采取积极的投资策略,确定类属资产的最优配置比例。 略, 明定吳周寅广时取记配追正时。 1、信用债券投资策略 信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基 金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析和公 司发展前景分析等细致的调查研究,分析信用债券的违约风险及合理的信用利差 水平, 对信用债券进行独立、客观的价值评估。 2、可转换债券投资策略 本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下,在综合分析 可转换债券的债性特征.股性特征等因素的基础上,选择其中安全边际较高.股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择,对成长前景 较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注,选择投资价值较高的个券进 行投资。 3、中小企业私募债券投资策略 本基金对中小企业私募债投资,主要通过期限和品种的分散投资控制流动性 风险。以买人持有到期为主要策略,审慎投资。 针对内嵌转股选择权的中小企业私募债,本基金通过深人的基本面分析及定 性定量研究,自下而上精选个债,在控制风险的前提下,谋求内嵌转股权潜在的增 思收益。 基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制订严格的投资决 策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。 4、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握 市场交易机会等积极策略。在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳 (三)权益类资产投资策略 本基金分债券型基金。主要投资于固定收益类资产,权益类资产作为本基金增强收益的手段,将在风险控制的基础上谋求资产增值。 1、股票投资策略 本基金可适当投资于股票,增强基金资产收益。本基金股票投资部分将重点投资于成长性好、估值水平具有一定安全边际的股票,同时参考公司的历史分红情况和分红能力。本基金将全面考察公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征等对公司的投资价值进行分析和比较、挖 掘具备投资价值的股票。 2、权证投资策略 本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可能持有的权证品种的收益率、流动性及风险收益特征,在风险 可控的基础上,追求较高风险调整后收益。(四)其他金融工具的投资策略 知法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲),遥传汉风。 八、基金的业绩比较基准 本基金采用"中债综合全价指数收益率×80%+ 沪深 300 指数收益率×20%"作 为投资业绩比较基准。 本基金选择中债综合全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中 本基並选择中间标言主旷捐数收益率作为间券投资和方的业场几枚基准。中 债综合全价指数样本具有广泛的市场代表性、涵盖主要交易市场(银行间市场、交 易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期,短期等),是中国目 前最权威,应用也最广的指数。中债综合全价指数的构成品种基本覆盖了本基金的 债券投资标的,反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。 本基金选择沪深 300 指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场 60%左右的市值,具有良好的市场代表性和可投资性。 若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较 基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。 九、基金的风险收益特征 本基金为债券型基本证本基金。属证券投资基金中的较低风险品种,理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。 小园中间89份在市场1000年至3000年至3000年至3000年至3000年至3000年至3000年, 十、投资组合报告 本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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 基金托管人根据本基金合同规定,已复核了本投资组合报告中的财务指标、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 本投资组合报告所载数据截至 2019 年 12 月 31 日。 一)报告期末基金资产组合情况 占基金总资产的比例 (%) 序号 项目 金额(元) 又益投资 69,732,589.74 14.24 中:股票 69,732,589.74 14.24 78.45 定收益投资 384,162,401.33 中:债券 78.45 384,162,401.33 资产支持证券 贵金属投资 融衍生品投资 买人返售金融资产 7,000,000.00 1.43 其中:买断式回购的买人返售金融资 银行存款和结算备付金合计 24,259,008.76 4.95 其他各项资; 4.558.831.76 0.93 489,712,831.59 (二)报告期末按行业分类的股票投资组合 行业类别 占基金资产净值比例(%) 代码 公允价值(元) A 农、林、牧、渔业 B 采矿业 1,168,700.0 C 制造业 46,628,530.5 11.26 电力、热力、燃气及水生产 和供应业 D E 建筑业 2,652,200. G 交通运输、仓储和邮政业 1,205,500. 0.29 H 住宿和餐饮业 信息传输、软件和信息技z 服务业 I 0.69 2,865,180.0 J 金融业 5.442.060.0 1.31 1.00 房地产业 4,154,400. L 租赁和商务服务业 4,460,399. 科学研究和技术服务』 水利、环境和公共设施管 居民服务、修理和其他服务 0 Q 卫生和社会工作 文化、体育和娱 S 综合 69,732,589.74 (三)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 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 海螺水泥 3,288,000. 60,00 600887 伊利股份 99,911 3,091,246. 601318 3,076,560 4 000651 格力电器 40,000 2,623,200 0.63 300760 14,000 2,546,600 0.61 002027 2,503,499. 399,92 300059 东方财富 150.00 2.365,500 600031 一重工 130,000 2,216,500 0.54 600048 130,00 2,103,400. 0.51600570 恒生电子 (四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合 国家债券 央行票据 3 金融债券 21.035.500.0 5.08 其中:政策性金融债 21,035,500.0 5.08 4 企业债券 191,935,599.3 46.34 5 企业短期融资 20,100,000.0 4.85 6 中期票据 10,164,000.0 2.45 7 可转债(可交换债) 140,927,302.0 34.03 8 同业存单 9 其他 10 合计 384,162,401.33 (下转C42版