

**(上接 C24 版)**

80)北京格上富信基金销售有限公司  
住所: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:叶倩一  
客服电话:400-066-8586

81)上海挖财基金销售有限公司  
住所: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  
法定代表人:冷飞  
客服电话:021-50810673

82)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  
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层  
法定代表人:毛淮平  
客服电话:400-817-5666

83)中民财富基金销售有限公司  
住所:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元  
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号外滩国际广场17层  
法定代表人:弭洪军  
客服电话:400-876-5716

84)深圳信诚基金销售有限公司  
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:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元  
法定代表人:周文  
客服电话:0755-23946579

85)嘉聘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  
客服电话:4006997719

86)通华财富(上海)基金销售有限公司  
住所: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  
法定代表人:沈丹文  
客服电话:4001019301 / 95193

87)沈阳麟龙投资顾问有限公司  
住所:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601  
办公地址:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601  
法定代表人:朱荣娜  
客服电话:400-003-5811

88)厦门市鑫鼎盛控股有限公司  
住所:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室  
法定代表人:陈洪生  
客服电话:400-918-0808

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内大街甲1号环球国际中心A座5层  
法定代表人:钱昊旻  
客服电话:4008-909-998

90)贵州省贵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

91)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:李海慧  
客服电话:400-673-7010

92)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:010-85907570  
联系人:余永健  
客服电话:400-021-8850

93)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:010-5285244  
联系人:魏晨  
客服电话:400-6099-200

94)和耕传承基金销售有限公司  
住所:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路东、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

95)民商基金销售(上海)有限公司  
住所: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:黄惠琴  
客服电话:021-50206003

96)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1.2号  
法定代表人:王荻  
客服电话:0851-88235678

97)大连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:贾伟东  
客服电话:4000899100

98)尚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

99)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

100)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:陈大康  
客服电话:95531/4008888888

101)宏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,并在管理网站网上公示。

二、注册登记机构  
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  
法定代表人:王璇  
电话:010-56517000  
传真:010-56517001  
联系人:李同庆  
网址:www.zrfunds.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层  
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层  
负责人:俞卫锋  
电话:021-31358666  
传真:021-31358600  
经办律师:安冬、孙睿  
联系人:安冬  
四、审计基金财产的会计师事务所  
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:张瑞荣(首席合伙人)  
电话:021-52920000  
传真:021-52921369  
经办注册会计师:陈大愚、江嘉祯  
联系人:杨伟平

全部权证,其市值不得超过该基金资产净值的3%;本基金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。

**第八部分 基金的投资策略**

一、大类资产配置策略  
采用自上而下的策略,对国内外宏观经济环境、政策环境、市场利率走势以及证券市场走势等因素进行分析研判,综合考虑相关类别资产的风险和收益水平,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。

二、债券投资策略  
通过全面对宏观经济、货币政策、市场供需和利率走势的研究,对固定收益类资产和货币资产等的预期风险和收益水平进行动态跟踪,从而决定其配置比例。策略上,以久期管理策略、收益率曲线策略、类属配置策略为主,选择流动性较好、信用资质优良、具有估值优势的券种构建固定收益资产组合。保持投资组合稳定收益和充分流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。

三、股票投资策略  
将密切关注宏观经济运行情况、政策环境、产业运行周期变化等因素,自上而下深入分析各行业的发展现状、运行周期、景气程度及政策影响,对处于景气周期中、具有良好发展前景、增长空间大、具备政策支持等的行业进行重点配置。

在具体标的选择策略上,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  
A.成长性指标:主营业务收入增长率、净利润增长率等;  
B.财务指标:毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净现金流/利润总额等;

C.估值指标:市盈率(P/E)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市净率(P/B)和总市值。  
绝对估值与相对估值相结合。

定性分析  
(1)公司在市场、产品等方面具备核心竞争力;  
(2)具有良好的公司管理能力和治理结构。

4. 中小企业私募债券投资策略  
本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程,投资授权审批机制,集中交易制度等保障审慎投资于私募债券。本基金依据内部信用评级,以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,并及时跟踪其信用风险的变化。

对于中小企业私募债券,本基金的投资策略以持有到期为主,所投资的中小企业私募债券的剩余期限不超过每一运作周期的剩余封闭运作期限。在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。

5. 权证投资策略  
权证为本基金辅助性投资工具,其投资原则为控制下跌风险,实现保值增值以及锁定收益。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,立足于无风险套利,尽量减少组合净值波动率,力求稳健的超额收益。

6. 资产支持证券的投资策略  
本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略,自上而下投资策略指本公司在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上,运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析,对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

**第九部分 基金的业绩比较基准**

沪深300指数收益率\*50%+上证国债指数收益率\*50%

如果今后证券市场中有其他代表性更强,或者指数编制单位停止编制该指数,或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,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,根据实际情况在履行适当的程序并经基金托管人同意后变更业绩比较基准进行相应调整,而无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照,不决定也不必然反映本基金的投资策略。

**第十部分 基金的风险收益特征**

本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中等风险、中高预期收益的品种。

**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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金基金合同约定,于2019年9月6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2019年6月30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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	760,308.75	53.94
	其中:股票	760,308.75	53.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,936.00	5.67
	其中:债券	79,936.00	5.67
	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:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	520,899.02	36.95
8	其他资产	48,429.32	3.44
9	合计	1,409,573.09	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	-	-
B	采矿业	61,445.82	4.43
C	制造业	240,089.70	17.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,816.00	4.89
E	建筑业	53,572.00	3.86
F	批发和零售业	-	-
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	135,554.86	9.78
J	金融业	108,816.17	7.85
K	房地产业	36,153.00	2.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	37,141.20	2.68
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	19,720.00	1.42
S	综合	-	-
	合计	760,308.75	54.83

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	300012	华测检测	3,439	37,141.20	2.68
2	000002	万科A	1,300	36,153.00	2.61
3	600050	中国联通	5,800	35,728.00	2.58
4	300271	华宇软件	1,800	34,200.00	2.47
5	300383	光环新网	2,038	34,177.26	2.46
6	002241	歌尔股份	3,800	33,782.00	2.44
7	000895	双汇发展	1,350	33,601.50	2.42
8	600795	国电电力	12,800	32,512.00	2.34
9	600588	用友网络	1,170	31,449.60	2.27
10	601100	恒立液压	1,000	31,380.00	2.26

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	国家债券	79,936.00	5.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,936.00	5.76

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	019611	19国债01	800	79,936.00	5.76

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。

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。

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 本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	1,289.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	939.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	46,200.00
7	其他	-
8	合计	48,429.32

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。基金业绩数据截止日为2019年6月30日。

一、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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效日(2017年2月17日)起至2019年6月30日	2.11%	0.16%	3.50%	0.30%	-1.39%	-0.14%
2017年7月1日至2017年12月31日	0.41%	0.17%	5.07%	0.35%	-4.66%	-0.18%
2018年1月1日至2018年6月30日	-3.88%	0.42%	-5.15%	0.58%	1.27%	-0.16%
2018年7月1日至2018年12月31日	-14.49%	0.91%	-5.83%	0.75%	-8.66%	0.16%
2019年1月1日至2019年6月30日	6.41%	0.96%	14.27%	0.78%	-7.86%	0.18%

二、自基金合同生效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的比较

中融基金交元富信资管证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2017年02月17日至2019年06月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

**第十三部分 基金的费用与税收**

一、基金费用的种类

- 基金管理人的管理费;
- 基金托管人的托管费;
- 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
- 基金份额持有人大会费用;
- 基金的证券交易费用;
- 基金的银行汇划费用;
- 基金的开户费用、账户维护费用;
- 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0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:  
H=E×0.80%÷当年天数  
H为每日应计提的基金管理费  
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  
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,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约定,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、费用不列入基金费用:  
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。

**第十四部分 对招募说明书更新部分的说明**

本招募说明书依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:  
(一)更新了“重要提示”中的相关内容。  
(二)更新了“第二部分 基金管理人”中的相关内容。  
(三)更新了“第五部分 相关服务机构”中的相关内容。  
(四)更新了“第二部分 对基金份额持有人的服务”中的相关内容。  
(五)更新了“第二十二部分 其他应披露事项”中的相关内容。