(上接 C39 版)

客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
(52)中期资产管理有限公司
住所: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:北京市朝阳区建国门外光华路 14 号中期大厦 8 层
法定代表人:姜新
联系人:方艳美
联系电话:010-65807865
客服电话:010-65807865
公司网址:www.cifcofund.com
(53)浙江金观诚基金销售有限公司
住所:杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦)1 幢 10 楼 1001 室
办公地址:杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富
法定代表人:徐黎云
联系人:周圣熙
联系电话:0571-88337560
客服电话:400-068-0058
公司网址:www.jincheng-fund.com
注:公司自 2019 年 2 月 1 日起暂停该机构办理本公司旗下基金的认购、申购、定期定额投资及转换等业务。
(54)上海汇付基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元
办公地址:上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼
法定代表人:金佶
联系人:甄宝林
联系电话:021-34013996
客服电话:021-34013999
公司网址:https://www.hotjijin.com
(55)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
法定代表人:林卓
联系人:徐江
联系电话:0411-88891212-119
传真:0411-84396536
客服电话:400-0411-001
公司网址:www.taichengcaifu.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:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号
法定代表人:王之光
联系人:宁博宇
联系电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
公司网址: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馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层
办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层
法定代表人:董浩
联系人:陈铭洲?
联系电话:010-65951887
传真:010-65951887
客服电话:4000681176
公司网址:www.hongdianfund.com
(58)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
办公地址:上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼
法定代表人:姚杨
联系人:孟召社
联系电话:021-20324176? ??
传真:021-20324199
客服电话:400-928-2266
公司网址:www.dtfunds.com
注:公司自 2019 年 1 月 30 日起暂停该机构办理本公司旗下基金的认购、申购、定期定额投资及转换等业务。
(59)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址: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
联系人:高皓辉
联系电话:021-63333389
传真:021-63333390
客服电话:4006-433-389
公司网址:www.vstonewealth.com
(60)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
联系人:邱湘湘
联系电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网址:www.yingmi.cn
(61)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
联系电话:0755-89460500
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn
(62)安粮期货股份有限公司
住所:安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层
办公地址:安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层(总部)
法定代表人:朱中文
联系人:梁蕾
联系电话:0551-62870125
传真:0551-62870131
客服电话:400 626 9988
公司网址:http://www.alqh.com/
(63)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 座 3 层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
联系电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.66zichan.com
(64)北京钱景基金销售有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层
法定代表人:赵荣春
联系人:陈剑炜
联系电话:010-57418813?
客服电话:400-893-6885
公司网址:www.qianjing.com
(65)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
传真:010-62020355
联系人:翟文
客户服务电话:4008188000
公司网址:www.myfund.com
(66)深圳市金斧子基金销售有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
法定代表人:赖任军
电话:0755-29330513
传真:0755-26920530
联系人:刘昕霞
客户服务电话:400-930-0660
公司网址:www.jfzinv.com
(67)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 13 号楼浦项中心 B 座 19 层
法定代表人:齐剑辉
电话:4006236060
传真:010-82055860
联系人:王英俊
客户服务电话:400-623-6060
公司网址:www.niuniufund.com
(68)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
法定代表人:黄欣
电话:021-33768132
传真:021-33768132-802
联系人:戴珉微
客户服务电话:4006767523
公司网址:www.zhongzhengfund.com
(69)乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
住所:北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人:王兴吉
联系人:高雪超
联系电话:18601207732
传真:010-82057741
客服电话:4000888080
公司网址:www.qiandaojr.com
(70)上海基煜基金销售有限公司
住所: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
联系人:蓝杰
电话:021-65370077-220
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网址:www.jiyufund.com.cn
(71)北京懒猫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
电话:010-57649619
传真:010-57649620
联系人:朱翔宇
客户服务电话:010-57649619
公司网址:www.lanmao.com
(72)一路财富(北京)信息科技有限公司
住所:北京市西城区阜成门大街 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
电话:+86(10)88312877
传真:+86(10)88312877
联系人:徐越
客户服务电话:400-001-1566
公司网址:http://www.yilucaifu.com/
(73)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:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:王锋
电话:025-66996699-887226
传真:025-66008800-887226
联系人:张慧
客户服务电话:95177
公司网址:www.snjijin.com
(74)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
电话:010-61840688
传真:010-61840699
联系人:吴季林
客户服务电话:4000618518
公司网址:https://danjuanapp.com
(75)上海景谷基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k
法定代表人:袁飞
电话:61621602
传真:61621602*819
联系人:袁振荣
客户服务电话:61621602
公司网址:www.g-fund.com.cn
(76)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 A 座 1108 室
办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室
法定代表人:王伟刚
电话:010-56251471
传真:010-62680827
联系人:熊小满
客户服务电话:400-619-9059
公司网址:www.hcjijin.com
(77)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
法定代表人:陈洪生
电话:0592-3122672
传真:0592-3122701
联系人:梁云波
客户服务电话:400-9180808
公司网址:www.xds.com.cn
(78)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 号楼为明大厦 C 座
法定代表人:赵芯蕊
电话:010-62675768
传真:010-62676582
联系人:赵芯蕊
客户服务电话:010-62675369
公司网址:www.xincai.com
(79)天津国美基金销售有限公司
住所:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-1 室
办公地址:北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层
法定代表人:丁东华
电话:010-59287984
传真:010-59287825
联系人:郭宝亮
客服电话:400-111-0889
公司网址:www.gomefund.com
(80)上海华信证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址:上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼
法定代表人:郭林
电话:021-63898427
传真:021-68776977-8427
联系人:徐璐
客户服务电话:400-820-5999
公司网址:www.shhxzq.com
(81)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
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 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
法定代表人:程刚
电话:010-58160168
传真:010-58160173
联系人:张旭
客户服务电话:400-810-5919
公司网址:www.fengfd.com
(82)上海云湾基金销售有限公司
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
办公地址:上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼
法定代表人:戴新装
电话:021-20538888
传真:021-20538999
联系人:江辉
客户服务电话:400-820-1515
公司网址:www.zhengtongfunds.com
(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:上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
联系电话:021-51327185
传真:021-50710161
客服电话:400-821-0203
公司网址:www.520fund.com.cn
(84)杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所:杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室
办公地址:杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼
法定代表人:陈刚
联系人:张丽琼
联系电话:0571-85262700
传真:0571-85269200
客服电话:0571-86915761
公司网址:www.cd121.com
(85)北京植信基金销售有限公司
住所:北京市密云县兴盛南路 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
法定代表人:杨纪锋
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
传真:010-67767615
客服电话:400-680-2123
网址:www.zhixin-inv.com
(86)北京肯特瑞基金销售有限公司
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:北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座
法定代表人:江卉
联系人:赵德赛
电话:4000988511/ 4000888816
传真:010-89188000
客服电话:95118
网址:http://fund.jd.com/
(87)上海朝阳永续基金销售有限公司
住所:浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室
办公地址:上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼
法定代表人:廖冰
联系人:郑秋月
联系电话:021-802348888-6694
传真:021-80234898
客服电话:4006991888
公司网址:www.998fund.com
(88)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
联系人:徐英
电话:010-59336539
传真:010-59336500
客服电话:4008-909-998
(89)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 8 层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋玥
电话:010-88066632
传真:010-63136184
客服电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
(90)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)第七幢 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)第七幢 23 层 1 号 4 号
法定代表人:陶捷
联系人:陆锋
客户服务电话:4000279899
公司网址:www.buyfunds.cn
(91)和耕传承基金销售有限公司
住所:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
法定代表人:李淑慧
联系人:罗聪
客户服务电话:0371-85518396
公司网址:www.hgccpb.com
(92)徽商期货有限责任公司
住所:安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层,6 号楼 1、2 层
办公地址:安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层,6 号楼 1、2 层
法定代表人:吴国华
联系人:申倩倩
客户服务电话:4008878707
公司网址:www.hsqh.net
(93)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 号景山财富中心 341?
办公地址:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341
法定代表人:季长军
联系人:何鹏
客户服务电话:400-819-6665?
公司网址:www.buyforyou.com.cn?
(94)成都华羿恒信基金销售有限公司
住所:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号
办公地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号
法定代表人:赵壁
联系人:徐莉
客户服务电话:400-8010-009
公司网址:http://www.huayihengxin.com
(95)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
联系人:李娟
联系电话:021-50810687
客服电话:021-50810673
公司网址: www.wacaijijin.com
(96)上海大智慧基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 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 单元
法定代表人:申健
联系人:宋楠
联系电话:021-20219988
客服电话:021-20292031
网址:https://www.wg.com.cn/
(97)北京加和基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404
法定代表人:徐福星
联系人:李美
电话:010-68292940
传真:010-68292964
客户服务电话:400-600-0030
网址:www.bzfunds.com
(98)北京晟视天下基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层 &28 层
法定代表人:蒋煜
联系人:刘聪慧 / 徐晓荣
电话:010-58170905/010-58170876
传真:010-58100800
客户服务电话:400-818-8866
网址:www.shengshiview.com.cn
(99)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:李悦章
联系人:曹庆展
客户服务电话:400-066-8586
公司网址:www.igesafe.com
(100)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:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
客户服务电话:400-100-3391
公司网址:http://www.dianyingfund.com/
(101)万家财富基金销售(天津)有限公司
住所: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:李修辞
联系人:邵玉磊
客户服务电话:010-59013825
公司网址:http://www.wanjiawealth.com/
(102)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:上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦
法定代表人:陈宏
联系人:付佳
联系电话:021-23586603
客服电话:95357
公司网址:http://www.18.cn
(二)登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
办公地址:上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
法定代表人:杨皓鹏
总经理:杨皓鹏
电话:021-38429808
传真:021-68419328
联系人:周琳
(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
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陈颖华
经办律师:黎明、陈颖华
(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)
住所:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
办公地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
执行事务合伙人:毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58153000
联系人:徐艳
经办会计师:徐艳、蔺育化

四、基金的名称
中海添瑞定期开放混合型证券投资基金

五、基金的类型
混合型证券投资基金

六、基金的投资目标
本基金在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人取得超越基金业绩比较基准的收益,实现基金资产的稳健增值。

七、基金的投资范围
本基金的投资范围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)、股指期货、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。
基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%。开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%, 在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略
包括资产配置策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和开放期投资策略。
1、资产配置策略
本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策变化、不同行业发展趋势等分析判断,采取自上而下的分析方法,比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征,动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。
2、债券投资策略
1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。
利用宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。
2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。
在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。
子弹组合,即使组合的现金流尽量集中分布;
杠铃组合,即使组合的现金流尽量呈两极分布;
梯形组合,即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。
3)债券类别配置 / 个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。
本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、资产支持证券等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债等利率债券,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。
个券选择:基于各个投资品种具体情况,自下而上的资产配置。
个券选择应遵循如下原则:
相对价值原则:同等风险中收益率较高的品种,同等收益率风险较低的品种。
流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。
3、可转换债券投资策略
可转换债券兼具债券和股票的相关特性,其投资风险和收益介于债券和股票之间。在进行可转换债券筛选时,本基金将首先对可转换债券自身的内在债券价值(如票面利息、利息补偿及无条件回售价格)、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究;然后对可转换债券的基础股票的基本面进行分析,形成对基础股票的价值评估;最后将可转换债券自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投资的可转换债券品种。
4、资产支持证券投资策略
本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。
5、股票投资策略
在股票投资中,本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法,精选其中具有核心竞争优势的上市公司,结合投研团队的综合判断,构造股票投资组合。其间,本基金也将积极关注当前已经完成定向增发,且还处于锁定期的上市公司,当二级市场股价跌破定向增发价时,通过深入研究增发新股的上市公司的基本面,并结合当前股价在技术面的情况,在其二级市场股价达到一定的破发幅度后择机买入,在定向增发股票解禁日逐渐临近或定向增发股票解禁后择机卖出,以实现破发回补的收益。
6、股指期货投资策略
本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,参与股指期货投资。本基金将通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,结合对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析,与现货组合进行匹配,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将在股指期货套期保值过程中,定期测算投资组合与股指期货的相关性,根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,提高基金运作效率,降低投资组合的整体风险。
7、权证投资策略
本基金在中国证监会允许的范围内适度投资权证,权证投资策略主要从价值投资的角度出发,将权证作为套利和锁定风险的工具,采用包括套利投资策略、风险锁定策略和股票替代策略进行权证投资。由于权证市场的高波动性,本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险,寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。
8、开放期投资策略
本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。

九、基金的投资限制
1、组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)本基金股票资产占基金资产的比例为 0% - 30%;
(2)开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
(3)本基金持有一家公司发行的证券,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公司发行的证券,不超过该证券的 10%;基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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,不得超过该权证总量的 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)本基金应投资于信用级别评级为 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)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟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%,本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
(15)开放期内,本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;封闭期内,本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 200%;
(16)本基金参与股指期货投资,需遵守下述限制:
在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;封闭期内,本基金在任何交易日日终,持有的买入股指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 100%;开放期内,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;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%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的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%;所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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
(17)开放期内,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、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前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(18)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;
(19)法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。
因证券 / 期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项约定外,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。
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)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
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其他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的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。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。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。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、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

十、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:
中证全债指数收益率×70%+ 沪深 300 指数收益率×30%
中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。
沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。
根据本基金的投资范围和投资比例,设定本基金的业绩比较基准为:"中证全债指数收益率×70%+ 沪深 300 指数收益率×30%",该基准能客观衡量本基金的投资绩效。
如果今后法律法规发生变化,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比较基准时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后,适当调整业绩比较基准并在指定媒介上及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

十二、基金投资组合报告
1.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,053,577.00	77.94
	其中:债券	11,053,577.00	77.94
	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	2,919,267.09	20.58
8	其他资产	208,988.26	1.47
9	合计	14,181,832.35	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。
1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本基金在本报告期末未持有沪港通股票投资。
1.3 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
注:本基金本报告期末未持有股票。
1.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,053,577.00	78.26
	其中:政策性金融债	11,053,577.00	78.26
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	11,053,577.00	78.26

1.5 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	018007	国开 1801	75,000	7,556,250.00	53.50
2	018006	国开 1702	32,900	3,373,895.00	23.89
3	018008	国开 1802	1,200	123,432.00	0.87

1.6 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
1.7 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
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
1.8 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
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。
1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.10.1 本期国债期货投资政策
根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。
1.10.3 本期国债期货投资评价
根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1
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门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
1.11.2
报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,579.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	207,408.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	208,988.26

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
本基金由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、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。
基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截至 2019 年 12 月 31 日):

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.01.19-2018.12.31	3.56%	0.05%	-4.01%	0.41%	7.57%	-0.36%
2019.1.1-2019.12.31	3.45%	0.21%	13.93%	0.36%	-10.48%	-0.15%
自基金合同生效起至今	7.13%	0.15%	9.35%	0.39%	-2.22%	-0.24%

注:本基金合同生效日为 2018 年 1 月 19 日,基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十四、基金的费用与税收
(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、基金的销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券 / 期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、账户开户费用和账户维护费用;
10、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
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。
若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
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 0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.20%÷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
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。
若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
3、基金销售服务费
本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:
H＝E×0.10%÷当年天数
H 为每日应计提的基金销售服务费
E 为前一日的基金资产净值
基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人根据基金管理人的划款指令于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给销售机构。
若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
上述"(一)基金费用的种类"中第 4－10 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。

十五、对招募说明书更新部分的说明
(一)在"重要提示"部分,对相关内容进行补充。
(二)在"绪言"部分,对相关法律法规的名称进行了更新。
(三)在"释义"部分,对相关释义进行了补充和更新。
(四)在"基金管理人"部分,对"高级管理人员"、"基金管理人的职责"的相关内容进行了更新。
(五)在"基金份额的申购和赎回"部分,对"申购与赎回场所"、"申购与赎回的数额限制"、"巨额赎回的情形及处理方式"、"暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告"的相关内容进行了更新。
(六)在"基金的收益分配"部分,对"收益分配方案的确定、公告与实施"的相关内容进行了更新。
(七)在"基金的会计与审计"部分,对"基金的年度审计"的相关内容进行了更新。
(八)在"基金的信息披露"部分,对"信息披露义务人"、"本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息"、"本基金公开披露的信息应采用中文文本"、"公开披露的基金信息"、"信息披露事务管理"、"信息披露文件的存放与查阅"的相关内容进行了更新。
(九)在"基金合同的变更、终止与基金财产的清算"部分,对"基金合同的变更"、"基金财产的清算"、"基金财产清算的公告"的相关内容进行了更新。
(十)在"基金合同的内容摘要"部分,根据最新《中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金合同》进行了更新。
(十一)在"基金托管协议的内容摘要"部分,根据最新《中海添瑞定期开放混合型证券投资基金托管协议》进行了更新。
(十二)在"其他应披露的事项"中,披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司
二〇二〇年七月四日