(上接 C89 版)

47、上海天天基金销售有限公司
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
法定代表人:其实
联系人:屠彦洋
电话:021-54509998-2010
传真:021-64385308
客户服务电话:400 1818 188
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
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
联系人:宋丽冉
电话:010-62020088
传真:010-62020355
客户服务电话:400 888 6661
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
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
电话:010-65807848
传真:010-59539806
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:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
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
联系人:申泽灏
电话:010-57418813
传真:010-57569671
客服电话:400 678 5095
网址:www.niuji.net
51、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#
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
法定代表人:杨懿
联系人:张燕
电话:010-58325388-1588
传真:010-58325282
客服电话:400-166-1188
网址:8.jrj.com.cn
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
法定代表人:凌顺平
联系人:刘晓倩
联系电话:0571-88911818
传真:0571-88910240
客服电话:4008-773-772
网址:www.5ifund.com
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
法定代表人:罗细安
联系人:史丽丽
电话:010-67000988
传真:010-67000988
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn
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
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
联系人:赵沛然
电话:021-50583533
传真:021-50583633
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:北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层
法定代表人:梁越
联系人:马鹏程
联系电话:13501068175
传真:010-56810628
客服:4008980618
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:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
联系电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服:4008219031
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
法定代表人:胡伟
联系人:牛亚楠
联系电话:010-65951887
传真:010-65951887
客服:400-618-0707
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:冯修敏
联系人:陈云卉
联系电话:021-33323999-5611
传真:021-33323837
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
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
法定代表人:汪静波
联系人:李娟
联系电话:021-38509735
传真:021-38509777
客服:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
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
法定代表人:陈继武
联系人:葛佳蕊
联系电话:021-63333389
传真:021-63332523
客服:4000178000
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
联系人:李孟军
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
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:袁顾明
联系人:朱海涛
联系电话:021-20324158
传真:021-20324199
客服电话:400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
63、海银基金销售有限公司
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
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
联系电话:021-80133597
传真:021-80133413
客服电话:400-808-1016
网址:www.fundhaiyin.com
64、上海联泰资产管理有限公司
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:燕斌
联系人:陈东
联系电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-466-788
网址:www.66zichan.com
65、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
办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
联系电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:400-619-9059
网址:www.fundzone.cn
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 1402 办公用房
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:程刚
联系人:张旭
联系电话:010-58160168
传真:010-58160181
客服:400-810-5919
网址:www.fengfd.com
67、乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
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:王兴吉
联系人:高雪超
联系电话:010-62062880
传真:010-82057741
客服:400-088-8080
网址:www.qiandaojr.com
68、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:刘鹏宇
联系人:刘男
电话:0755-83999907-8814
传真:0755-83999926
客户服务电话: 0755-83999907
网址:www.jinqianwo.cn
69、北京肯特瑞财富基金销售有限公司
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
法定代表人:江卉
联系人:万容
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
网址:fund.jd.com
70、上海基煜基金销售有限公司
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
法定代表人:王翔
联系人:李鑫
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话: 400-820-5369
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: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
法定代表人:吴雪秀
联系人:吕晓歌
电话:010-88312877
传真:010- 88312099
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.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
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
客户服务电话: 400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
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 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
联系人:余永健
电话:010-85097570
传真:010-85097308
客户服务电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
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)
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
78、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.fhcfjj.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
网址:www.haojiyoujijin.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
住所:上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元
办公地址:上海市浦东新区民生路 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:黄鹏
电话:18521506916
客服电话:400-876-5716
网址: www.cmiwm.com
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
联系人:张云飞
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
法定代表人:吴言林
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
联系人:沈晨
电话:010-59336544
客服电话:4008-909-998
网站:www.jnlc.com
(三)登记机构
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
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具(但须符合中国证监会相关规定)。
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、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、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。
本基金还可投资于股票和权证等权益类资产。
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。
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。
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。以买入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，本基金通过深入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强收益。
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，以期获得长期稳定收益。
(三)权益类资产投资策略
本基金为债券型基金，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
如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比例，谨慎投资。
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。
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带责任。
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、误导性陈述或者重大遗漏。
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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,732,589.74	14.24
	其中:股票	69,732,589.74	14.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	384,162,401.33	78.45
	其中:债券	384,162,401.33	78.45
	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	7,000,000.00	1.43
	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	24,259,008.76	4.95
8	其他各项资产	4,558,831.76	0.93
9	合计	489,712,831.59	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,168,700.00	0.28
C	制造业	46,628,530.54	11.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,652,200.00	0.64
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,205,500.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,865,180.00	0.69
J	金融业	5,442,060.00	1.31
K	房地产业	4,154,400.00	1.00
L	租赁和商务服务业	4,460,399.20	1.08
M	科学研究和技术服务业	745,500.00	0.18
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	410,120.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	69,732,589.74	16.84

(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	600585	海螺水泥	60,000	3,288,000.00	0.79
2	600887	伊利股份	99,911	3,091,246.34	0.75
3	601318	中国平安	36,000	3,076,560.00	0.74
4	000651	格力电器	40,000	2,623,200.00	0.63
5	300760	迈瑞医疗	14,000	2,546,600.00	0.61
6	002027	分众传媒	399,920	2,503,499.20	0.60
7	300059	东方财富	150,000	2,365,500.00	0.57
8	600031	三一重工	130,000	2,216,500.00	0.54
9	600048	保利地产	130,000	2,103,400.00	0.51
10	600570	恒生电子	26,000	2,020,980.00	0.49

(四)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	21,035,500.00	5.08
	其中:政策性金融债	21,035,500.00	5.08
4	企业债券	191,935,599.30	46.34
5	企业短期融资券	20,100,000.00	4.85
6	中期票据	10,164,000.00	2.45
7	可转债(可交换债)	140,927,302.03	34.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	384,162,401.33	92.75

(五)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	110059	浦发转债	240,000	26,217,600.00	6.33
2	143734	18 金隅 02	240,000	25,036,800.00	6.04
3	1280455	12 桂交投债	200,000	21,310,000.00	5.15
4	155229	19 阳煤 01	200,000	20,314,000.00	4.90
5	155296	19 西南 01	200,000	20,136,000.00	4.86

(六)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。
(七)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。
(八)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。
(九)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。
(十)投资组合报告附注
1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明
本基金所持有的三一重工(600031.SH)于 2019 年 12 月 13 日公告，其公司高管李京京被上海证券交易所通报批评。主要违法违规事实:违反了《公司法》关于高级管理人员在任职期间每年转让股份不得超过其所持有公司股份总数 25%的相关规定。对于超额减持部分，李京京未按照规定在减持的 15 个交易日前披露减持计划。
本基金所持有的格力电器(000651)于 2019 年 2 月 1 日公告，公司被中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函的行政监管措施，主要内容为“经查，你作为珠海格力电器股份有限公司(以下简称格力电器)董事长，在 2019 年 1 月 16 日下午召开的格力电器 2019 年第一次临时股东大会上发布了格力电器 2018 年营业收入和净利润等有关业绩信息，而格力电器在股东大会结束后的当天晚间才发布 2018 年度业绩预告。”
本基金所持有的保利地产(600048.SH)于 2019 年 6 月 1 日公告，公司副总经理吴章焰被广元市监察委员会立案调查并采取留置措施。目前，公司已对相关工作进行了妥善安排，公司生产经营情况正常。
本基金所持有浦发转债(110059.SH)，发行人上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“公司”)，受到行政处罚。于 2019 年 1 月至 2019 年 12 月期间，因分行业务违规受到银保监会的行政处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。
本基金决策依据及投资程序:
(1)研究:本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台，由研究部负责，采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势进行分析，深入研究国家宏观经济走势、政策走向和利率变化趋势。通过对信用利差的分析判断，可转债的投资价值分析等，深入研究各类债券合理的投资价值。在全面深入研究的基础上，提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。
(2)资产配置决策:投资决策委员会依据上述研究报告，对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议，根据自己对未来一段时期内宏观经济走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和久期设置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。
(3)组合构建:大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后，基金经理参考研究员的投资建议，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。
(4)交易执行:交易管理部负责具体的交易执行，依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。
(5)风险监控:本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控，定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况，责令投资不规范的基金经理进行检讨，并及时调整。
(6)风险绩效评估:风险管理部定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估，并提供相关报告，使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略，并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整和优化投资组合。
(7)组合调整:基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，以及组合风险与绩效的评估结果，结合基金申购和赎回的现金流量情况，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。
本基金投资上述公司主要基于以下原因:
基于基本面进行选股，选择盈利增速较高、基本面向好、估值较低等符合选股标准的股票进行分散投资。
除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。
2、本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。
3、报告期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,167.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,490,251.65
5	应收申购款	4,413.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,558,831.76

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	110053	苏银转债	11,739,000.00	2.83
2	113026	核能转债	6,815,340.00	1.65
3	110043	无锡转债	6,637,800.00	1.60
4	113014	林洋转债	5,794,620.00	1.40
5	113024	核建转债	5,159,430.00	1.25
6	113511	千禾转债	5,148,327.60	1.24
7	128013	洪涛转债	3,854,800.00	0.93
8	113021	中信转债	3,394,200.00	0.82
9	128051	光华转债	3,371,100.00	0.81
10	128034	江银转债	3,156,172.80	0.76
11	110045	海澜转债	3,046,200.00	0.74
12	127006	敖东转债	2,976,480.00	0.72
13	113516	苏农转债	2,806,845.30	0.68
14	123011	德尔转债	2,742,300.00	0.66
15	128064	司尔转债	2,094,767.29	0.51
16	110058	永鼎转债	1,457,960.00	0.35
17	110041	蒙电转债	1,410,480.00	0.34
18	127012	招路转债	1,260,490.00	0.30
19	128049	华源转债	902,236.00	0.22
20	123019	中来转债	702,060.00	0.17
21	113534	鼎胜转债	660,720.00	0.16
22	113508	新风转债	602,530.40	0.15
23	127013	创维转债	591,350.00	0.14
24	128048	张行转债	584,500.00	0.14
25	113027	华钰转债	538,850.00	0.13
26	128054	中宠转债	502,080.00	0.12
27	128057	博亚转债	472,320.00	0.11
28	123023	迪森转债	456,139.70	0.11
29	113530	大丰转债	451,760.00	0.11
30	128022	众信转债	419,800.00	0.10
31	113535	大业转债	401,400.00	0.10
32	123018	溢利转债	363,540.00	0.09
33	110055	伊力转债	341,640.00	0.08
34	128037	岩土转债	335,930.00	0.08
35	128025	特一转债	334,830.00	0.08
36	123026	中环转债	327,120.00	0.08
37	128044	岭南转债	318,827.95	0.08
38	113012	骆驼转债	315,990.00	0.08
39	128056	今飞转债	301,320.00	0.07
40	127004	模塑转债	284,970.00	0.07
41	128023	亚太转债	281,970.00	0.07
42	128026	众兴转债	278,970.00	0.07
43	113527	维格转债	275,760.00	0.07
44	128062	亚药转债	268,410.00	0.06
45	123028	清水转债	259,575.00	0.06
46	110051	中天转债	222,460.00	0.05
47	113536	三星转债	219,440.00	0.05
48	113525	台华转债	216,960.00