

### (上接B185版)

办公地址:上海徐汇区桂阳路391号B座10层  
注册地址:上海徐汇区桂阳路391号B座10层  
联系人:董嘉楠  
联系电话:021-60907708  
公司网址:www.youyuanfund.com  
19) 上海中融基金销售有限公司  
办公地址:上海市浦东新区川沙路1099号19层 大厦五层口广场1号楼2层  
注册地址:上海市浦东新区川沙路1099号19层 大厦五层口广场1号楼2层  
联系人:陈海平  
联系电话:400-876-5716  
公司网址:www.zhongrong.com.cn  
20) 深圳前海厚朴基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址:深圳市福田区福强路202号中融汇金大厦909室  
法定代表人:杨普华  
联系人:李振  
联系电话:4001208800  
21) 北京君德汇源基金销售有限公司  
注册地址:北京市东城区东直门北大街1号华贸大厦1212B  
办公地址:北京市东城区东直门北大街1号华贸大厦1212B  
法定代表人:李振  
联系人:李振  
联系电话:400-829-1218  
公司网址:www.litium.com.cn  
22) 安信证券股份有限公司  
注册地址:深圳市福田区金田路4036号安信大厦909室  
办公地址:深圳市福田区金田路4036号安信大厦909室  
法定代表人:吕志松  
联系人:李振  
联系电话:400-004-8821  
公司网址:www.axn.com.cn  
3) 基金管理人可根据相关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登录机构  
名称:华泰证券基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区民生路1199弄上海大厦5层口16号11层  
法定代表人:贾波  
电话:(021)38601777  
公司网址:www.htsc.com.cn  
(三)销售机构名称  
名称:上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1404室  
法定代表人:高国富  
电话:(021)51102968  
传真:(021)51103898  
公司网址:www.spdb.com.cn  
(四)会计师事务所名称  
名称:普华永道中天会计师事务所(普通合伙)  
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号2层普华永道中心11楼  
法定代表人:李丹  
经办注册会计师:申晓、曹阳  
电话:(021)23238888  
传真:(021)23238888  
公司网址:www.pwcc.com.cn

四、基金名称  
华泰沪深300指数证券投资基金  
五、基金的投资目标  
本基金投资于沪深300指数成份股,追求超越业绩比较基准的投资收益。  
六、基金的投资策略  
本基金将采用主动的投资管理策略对短期证券市场进行投资,在投资中充分利用现代金融工程理论以及多种分析方法提高投资决策的及时性与合理性,在保证基金资产安全性和流动性的基础上,追求超额收益的实现。  
1. 利率预期策略:本基金将首先利用利率预期策略(Internet-Rate Expectation Strategy),通过对利率分析,综合研究国内外宏观经济走势、财政及货币政策导向、短期资金供求状况等因素,判断利率未来短期走势,根据利率未来短期走势对债券类资产的投资策略进行动态调整。若利率未来利率将上升,则降低投资组合的平均期限;反之,则增加投资组合的平均期限。本基金的平均期限指投资组合的加权平均期限。  
2. 行业轮动策略:本基金将根据宏观经济周期、行业景气度、行业估值、行业成长性、行业政策等因素,综合考量各行业的流动性、收益、风险等因素以进行行业的估值判断,合理选择不同市场中具有投资价值证券,并根据投资环境的变化作动态调整。  
3. 风险控制策略:在保持投资组合相对稳定的条件下,本基金在实际操作中将根据主要宏观经济数据、行业景气度、市场流动性、估值等因素,动态调整投资组合,并通过评估各

类资产的流动性和收益性,确定不同期限类别品种的具体资产配置比例。  
4. 流动性管理策略:本基金将在动态调整资产配置需求、季节性资金流动等因素的前提下,对基金资产进行合理配置,确保基金资产流动性充足,资产变现能力等指标,合理配置固定收益类资产,在保持基金资产流动性的前提下,确保基金资产的稳定收益,结合持续性投资的方法,将各类型资产的到期日进行均衡配置,以确保基金资产的整体变现能力。  
5. 申购赎回管理策略:本基金将根据申购赎回情况,由其中的投资群体、交易方式等市场因素,综合考虑申购赎回的流动性,对申购赎回的流动性进行动态调整,在充分论证和机会可行的基础上,寻找合适的介入时机,进行市场择时操作。  
6. 流动性风险管理:由于投资组合存在一定期限,对期限对应的交易流动性可能存在一定程度的制约,故本基金将根据流动性风险管理策略,在保持基金资产流动性的基础上,进行流动性风险管理,以增强流动性。  
7. 申购赎回操作策略:当申购赎回市场下跌或者利率走势不明时,通过对剩余期限相对较长的短期债券进行定期操作,随后再择机买入短期债券,在确保成本低于短期债券收益率时,择机策略的运用可实现正收益。  
九、基金的业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率(税后)。  
基金管理人依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在合理的市场化利率基金业绩出的情况下,可根据投资目标、投资方向和投资策略,确定变更业绩比较基准,业绩比较基准的变更须经基金管理人及基金托管人协商一致,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人应在变更前至少在一种中国证监会指定媒体上公告,并在更新的招募说明书中列明。  
十、基金的风险收益特征  
本基金属于证券投资基金中高风险、中高收益的品种,其预期风险和预期收益都高于股票型基金、混合型基金和债券型基金。  
十一、基金的投资组合报告  
投资组合报告截止日期:2019年12月31日。  
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	固定收益投资	13,896,902,909.13	46.17
	其中:债券	13,616,022,848.11	45.49
	资产支持证券	20,280,060,992.92	6.68
2	买入返售金融资产	5,465,053,152.58	18.27
	其中:买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	10,485,910,613.72	35.06
4	其他资产	19,513,284.05	0.50
5	合计	29,907,376,380.28	100.00

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券投资占基金资产净值的比例	2.92
	其中:国债投资占基金资产净值的比例	-
	其中:央行票据投资占基金资产净值的比例	-
	其中:政策性金融债投资占基金资产净值的比例	-
	其中:其他债券投资占基金资产净值的比例	-
2	报告期末债券回购投资占基金资产净值的比例	8.76
	其中:质押式回购占基金资产净值的比例	-
	其中:买断式回购占基金资产净值的比例	-

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债	13,896,902,909.13	46.17
2	地方政府债	13,616,022,848.11	45.49
3	资产支持证券	20,280,060,992.92	6.68
4	买入返售金融资产	5,465,053,152.58	18.27
5	银行存款和结算备付金合计	10,485,910,613.72	35.06
6	其他资产	19,513,284.05	0.50
7	合计	29,907,376,380.28	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149300	18国债01	2,000,000.00	200,000,000.00	0.75
2	180906	18国开06	3,000,000.00	300,000,000.00	1.01

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149300	18国债01	2,000,000.00	200,000,000.00	0.75
2	180906	18国开06	3,000,000.00	300,000,000.00	1.01

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券利息	-	-
3	应收股利	105,762,796.31	0.35
4	应收申购款	43,750,017.24	0.15
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,512,813.55	0.49

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