

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金招募说明书(更新摘要)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2013年2月6日证监许可[2013]129号文核准募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书中关于基金业绩数据,已由中国证监会核准,并不表明其对基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能收回其原本投资。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,需全面了解本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分认知自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持基金份额享受基金收益,但同时需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到赎回风险;因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金管理人实施过程中产生的非系统性风险,本基金投资债券资产信用风险,以及本基金投资股指期货特有的风险等等。本基金为被动型投资指数基金,具有与债券基金类似的风险特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的投资并不构成本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同认购、申购或赎回基金份额即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年6月26日,有关财务数据均以7月报表截止日为2015年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效日期:2013年6月26日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:国联安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
法定代表人:虞启斌
成立日期:2003年4月3日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]142号
组织形式:有限责任公司
注册资本:15亿元人民币
存续期限:五十年或股东一致同意延长的其他期限
电话:(021)38992988
联系人:李斐
股权结构:

股东名称	持股比例
国寿养老保险股份有限公司	51%
招商证券股份有限公司	49%

(二)主要人员情况

1.董事会成员
(1)虞启斌先生,董事长,经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师,君安证券股份有限公司航海路营业部经理,资产管理部研究部经理,香港公司研究策划部经理,研究发展中心主任,经纪管理部总经理,债券部总经理,副总裁,国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证券股份有限公司执行董事,党委委员,国联安基金管理有限公司董事长。

(2)Andrew Douglas Eu(余义斌)先生,副董事长,工商管理硕士。历任德意志证券投资有限公司高级风险分析师,投资经理,董事(亚太区业务),资产管理部有限公司创始人之一兼基金总监,现任安联环球投资亚太区行政总裁,安联全球银行委员会办公室主任,安联集团亚太区公司董事。

(3)叶楠楠女士,董事,会计学学士,高级注册会计师,上海市注册会计师协会,历任瑞银银行香港分行会计经理,财务总监,瑞士银行集团财务董事,亚太区财务变更计划负责人及项目总监,瑞银环球资产管理(中国)有限公司首席财务官及常务董事,瑞银证券投资管理(中国)有限公司财务总监及公司监事,瑞银环球资产管理(日本)有限公司法定核数师;国投瑞银基金管理有限公司监事,监事长。现任国联安证券投资亚太区首席财务总监,安联环球投资亚太区有限公司董事,德盛安资产管理公司(日本、新加坡、台湾)董事。

(4)汪卫杰先生,董事,经济学硕士,会计师职称。1994年起进入金融行业,历任君安证券股份有限公司财务部主管、稽核部副总经理,资金计划部副总经理,长沙营业部总经理,财务总监助理,深圳分公司总经理助理,计划财务部总经理,国泰君安证券股份有限公司计划财务部总经理,资产负债管理委员会专职主任委员、主任助理兼小组主任。

(5)程静萍女士,独立董事,高级经济师职称。历任上海市财政局副科长、副处长,局长助理,上海市财政局、税务局局长,上海市计划委员会、上海市发展和改革委员会主任兼上海市副市长,上海市发展和改革委员会主任,第十届全国人大常委会、上海市决策咨询委员会专家,上海市委副秘书长及常务董事,上海市现代服务业行业协会会长。

(6)王鸿敏女士,独立董事,法学士。历任台湾海康资产管理旗下的怡富证券投资信托有限公司副总经理,怡富证券投资顾问公司经理,中国摩根资产管理董事总经理,上投摩根基金管理有限公司总经理。现主要从事教育工作和公益事业。

(7)胡斌先生,独立董事,特许金融分析师(CFA),美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA),上海交大管理学院工商管理博士。历任纽约摩根瑞隆资产管理公司担任Standish Mellon量化分析师,公司副总裁,Coefficient Global公司创始人之一兼基金经理。2007年11月起,担任梅隆资产管理中国区负责人,2010年7月离职,于摩根瑞隆西部基金管理有限公司担任管理顾问(总经理)。现任上海数股权投资基金管理合伙企业(有限合伙)担任总经理。

2.监事会成员
(1)元浩伟先生,监事会主席,北京大学光华管理学院工商管理硕士。历任中国建设银行大连分行出纳,会计,信息技术等工作,1992年担任工商银行信托公司证券部副主任;1994年加入君安证券任大连营业部总经理助理,期间兼任君安证券有限公司总经理;1996年担任国泰君安证券大连西岗路营业部副总经理;2004年起任大连营业部总经理;2005年起担任辽宁营销总部副总经理;2007年起担任辽宁营销总部总经理;2009年起担任辽宁分公司总经理;2012年起任财富管理总部总经理,现任国联安基金管理有限公司监事会主席。

(2)庄小慧女士,监事,法律硕士。历任Bell, Temple见习律师,McCague, Peacock, Bortack, McInnis & Lloyd大律师及事务法律顾问,金杜律师事务所律师事务所律师,瑞士再保险(中国)法律顾问。现任安联环球投资亚太区法律顾问。

(3)朱慧女士,职工监事,经济学学士,历任国泰证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司财务部副经理,现任国联安基金管理有限公司财务总监。

(4)刘智女士,职工监事,经济学学士,现任国联安基金管理有限公司财务部副总监。

3.公司高级管理人员
(1)虞启斌先生,董事长,经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师,君安证券股份有限公司航海路营业部经理,资产管理部研究部经理,香港公司研究策划部经理,研究发展中心主任,经纪管理部总经理,债券部总经理,副总裁,国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证券股份有限公司执行董事,党委委员,国联安基金管理有限公司董事长。

(2)谭晓女士,公司总经理,经济学硕士,国务院特殊津贴专家,高级经济师。历任君安证券有限公司研究所行业部研究员,二级研究员及高级研究员,国泰君安证券股份有限公司研究所副所长,咨询部总经理及财富管理总部副总经理。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

(3)周浩先生,督察长,法学硕士。曾先后任职于中国证券监督管理委员会和上海航运产业资产管理有限公司。2012年2月加盟国联安基金管理有限公司,现担任国联安基金管理有限公司督察长。

(4)李树女士,副总经理,经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部,上海联合财务有限公司资金财务部副经理,财务,营运负责人兼内部审计师,公司副总经理,国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理,现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(5)魏东先生,副总经理,经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司;2003年1月加盟华宝兴业基金管理公司,先后担任任交易部总经理,华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理和宝华兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理,投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司,先后担任任总经理助理,投资总监的职务。2009年9月起,担任国联安德盛精选股票证券投资基金的基金经理。2009年12月至2011年9月,兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金的基金经理。2014年3月起,兼任国联安上海大宗商品股票交易开放式证券投资基金的基金经理。2015年12月起至今,兼任国联安上海大宗商品股票交易开放式证券投资基金联接基金基金经理。

4.投资决策委员会成员
投资决策委员会是公司基金投资最高决策机构,投资决策委员会由公司副总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益业务负责人、研究部负责人及高级基金经理1-2人(根据需要)组成。投资决策委员会成员为:

谭晓江(总经理) 投资决策委员会主任
魏东(投资总监) 投资决策委员会执行主席
曹新江(投资组合管理部总监)
杨子江(研究部总监)
冯俊(固定收益部负责人)
高级基金经理1-2人(根据需要)

5.上述人员之间不存在近亲属关系。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。

(一)基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监字[1998]12号

联系人:田青
客户服务电话:(010)6759 5096
网址:www.ccb.com.cn

中国建设银行拥有悠久的历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立成立,承接了原中国建设银行的商业银行业务及相关资产和负债。中国建设银行股票代码为9397于2006年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开启交易。

A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利润收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。

截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%。其中,客户贷款和垫款总额1,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%。其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长7.41%。

截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.36万户,增长6.64%;个人客户352.6万户,较上年末增加921万户,增长13.17%。网上银行1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.312亿户,增长12.56%。

截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大;自助设备2.128台,较上年末增长3.115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达96.55%,较上年末提升1.15个百分点。

2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额位列全球第3位,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志2014全球500强排名第3位,较上年上升12位。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财和信托资产市场处、OFI托管处、养老金托管处、清收处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况
魏东,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷管理部、公司业务部,长期从事总行的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
李黎,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行托管业务部、个人银行业务部,历任办公室、长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张方,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部,公司业务部,并在总行集团客户部和中國建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供稳健、专业的托管服务。经过多年稳健发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金和个人银行、OFI、企业年金等多项业务的体系,是目前国内托管品种最全的商业银行之一。截至2014年9月末,中国建设银行已托管38只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”;获和讯网的中国“最佳托管银行”奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖;中央国际媒体记录有限责任公司授予的“优秀托管机构”奖。

二、基金托管人的内部控制制度
(一)内部控制目标
作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和本行有关管理规定,守法经营、规范运作,严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构
中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行监督和检查。投资托管业务部专门设立了监督稽核处,配备了专职内控合规人员负责投资托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

(三)内部控制制度及措施
投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作规范,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资产严格保管,制约机制严格有效;业务操作专人负责,防止遗漏,实施操作监控;业务信息专取专线传输,专人负责安全保密,业务实现自动化处理,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
(一)监督方法
依照《基金法》及其他法律法规和基金合同的约定,监督基金托管人的投资运作,利用自行开发的“托管业务综合系统—基金监督子系统”,严格按照相关法律法规及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资品种等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程
1.每日工作日日终通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。
3.根据中国证监会基金投资运作监管情况,定期对基金托管人的监督情况,对各基金投资运作的合法合规情况、投资独立性、基金资产净值等方面进行评估,并向中国证监会报告。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构
(一)基金销售机构
(1)直销机构
名称:国联安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
法定代表人:虞启斌
联系人:李斐
客户服务电话:400-700-0365(免长途话费)、96-21-3878

网址:www.wjip-funds.com或www.GTJA-Allianz.com

(2)销售机构
1)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:王洪章
联系电话:010-67596004
联系人:王琳
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

2)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海中山东一路12号
办公地址:上海中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系电话:(021)61616206
联系人:李慧云
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

3)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
联系电话:021-58781234
联系人:曹畅
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

4)招商银行股份有限公司
注册地址:中国广东省深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:中国广东省深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建强
联系电话:(0755)83077278
联系人:邓耀鹏
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

5)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
电话:(021)38676161
联系人:芮敬祺
客户服务电话:95521
网址:www.gtja.com

6)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-46层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-46层
法定代表人:宫少林
联系电话:0755-82943079
联系人:吴少彬
客户服务电话:95565或400-8888-111
网址:www.newone.com.cn

7)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人:何如
联系电话:(0755)82133066

联系人:李刚
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

8)中国光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人:唐双宁
联系电话:010-63636225

联系人:张清
客户服务电话:95595
网址:www.cebbank.com

9)天风证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系电话:027-87188822

联系人:董耀
客户服务电话:400-8006-000
网址:www.tfzq.com

10)中国国际期货有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街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:赵春

联系电话:010-59539864
客服电话:95162,400-8888-160
网址:www.cifco.com

11)中山证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址:深圳市福田区益田路新世界中心
法定代表人:杨义涛
联系电话:0755-82570566

联系人:罗艺琳
客户服务电话:400-1022-011
网址:www.zszq.com

12)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座27及28层
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座27层及28层
法定代表人:李勇
联系电话:0755-82570566

联系人:罗艺琳
客户服务电话:400-1022-011
网址:www.zszq.com

13)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
电话:010-66496608

联系人:尹玲
客户服务电话:010-66465555
网址:www.txsec.com

14)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层
法定代表人:陈柏青
联系电话:0571-28829790

联系人:周慧娜
客户服务电话:400-0766-123
网址:www.fund123.com

15)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
法定代表人:其实
联系电话:021-54509998

联系人:陈兰兰
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com

16)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区江南大道3588号12层
办公地址:上海市浦东新区江南大道3588号12层
法定代表人:陈柏青
联系电话:0571-28829790

联系人:周慧娜
客户服务电话:400-0766-123
网址:www.fund123.com

17)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区华严北里1号院2号楼6层
办公地址:北京市朝阳区华严北里1号院2号楼6层
法定代表人:闫振涛
联系电话:010-62000088

联系人:宋海彬
客户服务电话:400-9986-661
客户服务电话:010-59198822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

联系人:周琳
客户服务电话:400-920-0022
网址:llike@hexun.com

2)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号长量国际大厦16层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691835

联系人:单丙辉
客户服务电话:400-820-2889
网址:www.erichfund.com

3)名称:上海海利基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1818号19楼B18楼
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:李虹
电话:021-68419822

量不符合市场交易惯例等市场因素发生时,本基金将根据市场情况,结合经验判断,选取关键特征和相关成份券类似的非成份券或者非成份券组合进行替代。

由于本基金组合中债券券种和品种并非完全被动复制标的指数,因此本基金投资组合中债券券种和品种的指数跟踪误差可能会大于成份券组合并可能存在一定差异。

3.股指期货的投资
为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货,本基金利用股指期货较好的交易成本低和杠杆操作特点,通过股指期货对冲本基金投资组合对标的指数的拟合误差进行及时,有效调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或建仓时,可运用股指期货有效减少基金投资组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数的跟踪效果。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制制度并报批董事会审议。

十、标的指数及业绩比较基准
1.标的指数
本基金的标的指数为中国中证股债动态策略指数。

中证股债动态策略指数策略是多元资产配置策略,由股票和债券两类资产,按两类资产分别由沪深300指数和中证全债指数代表,中证股债动态策略指数策略在模拟中证股债动态策略指数的资产配置进行及时,有效调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或建仓时,可运用股指期货有效减少基金投资组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生