

(上接B065版)

78 长城证券股份有限公司 报业大厦14层,深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14,16,17层 法定代表人:黄耀华 联系人:胡君 电话:0755-23516299 传真:0755-23515667 客服电话:400-666-6888 网址:www.cgs.com

79 光大证券股份有限公司 地址:上海市静安区新闸路1508号 法定代表人:薛峰 联系人:陈伟 电话:021-22616901 传真:021-22619134 客服电话:95625 网址:www.ebscn.com

80 广州证券股份有限公司 地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层 办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层 法定代表人:邵三发 联系人:蔡微 电话:020-87389099 客服电话:95396 网址:www.gzsc.com.cn

81 大同证券有限责任公司 注册地址:山西省太原市市长治路111号山西世贸中心A座12层 法定代表人:董祥 联系人:薛峰 电话:(0351)4130322 客服电话:400-7121-212 网址:www.dzsec.com.cn

82 平安证券股份有限公司 超大厦16-20层 办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 法定代表人:谢永林 联系人:胡晶 电话:021-38637436 传真:021-38383096 客服电话:95511-8 网址:https://ctck.pingan.com

83 华安证券股份有限公司 地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路190号 办公地址:合肥市政务文化新区南二环路960号财智中心华安证券B1座32层 法定代表人:李工 联系人:池晓 电话:0551-65161021 传真:0551-65161672 客服电话:95318 网址:www.hazzq.com

84 东莞证券股份有限公司 地址:东莞市莞城区可园南路一号金融中心 法定代表人:张运勇 客服电话:(0769)-611130 网址:www.dzq.com.cn

85 申万宏源西部证券有限公司 地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号1号综合楼20楼2005室 法定代表人:许建农 联系人:唐娟 电话:(010)8806-2666 传真:(010)8806-2615 客服电话:400-800-0562 网址:www.hysec.com

86 中泰证券股份有限公司 地址:山东省济南市经七路96号 法定代表人:李玮 联系人:吴阳 电话:(0931)4890208 传真:(0931)4890339 电话:(0931)489-3888 网址:www.zts.com.cn

87 华龙证券股份有限公司 地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦 办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦 法定代表人:李晓安 联系人:刘鹏怡 电话:(0931)4890208 传真:(0931)4890339 电话:(0931)489-3888 网址:www.zts.com.cn

88 中国国际金融股份有限公司 地址:北京市建国门大街1号国贸大厦2座27、28层 法定代表人:丁东华 联系人:宋雷 电话:(010)9553670988-6035 传真:(010)9553670935 客服电话:400-910-1166 网址:www.cicc.com.cn

89 华鑫证券有限责任公司 地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦25层 法定代表人:王平 小单元 办公地址:深圳市福田区安联大厦25层 法定代表人:杨丽娟 联系人:徐雷 电话:(021)540672002 客服电话:400-100-918, (021)32109999, (029)63018998 网址:www.ccex.com.cn

90 联讯证券股份有限公司 地址:广东省惠州市惠城区江北三路惠州广播电视新闻中心三楼 办公地址:广东省惠州市惠城区江北三路惠州广播电视新闻中心三楼 法定代表人:徐刚 联系人:孙海 电话:(0752)-2119700 客服电话:95564 网址:www.ccex.com.cn

91 国金证券股份有限公司 地址:成都市东城根上街96号 办公地址:成都市东城根上街96号 法定代表人:冉云 联系人:刘勇 电话:(028)-8660067-028-8660068 传真:(028)-8660068 客服电话:95310 网址:www.jjzq.com.cn

92 华宝证券有限责任公司 地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心67层 法定代表人:陈林 联系人:孙川 电话:(021)63677790 传真:(021)63677792 客服电话:4008-209-898 网址:www.nrbstock.com

93 英大证券有限责任公司 地址:深圳市福田区深南中路华能大厦十三至三十一层 办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦十三至三十一层 法定代表人:吴骏 联系人:李慧灵 电话:(0755)-83070159 传真:(0755)-8307034 客服电话:400-018-9688 网址:www.ydsdc.com.cn

94 华融证券股份有限公司 地址:北京市西城区金融大街8号 办公地址:北京市朝阳区朝来门北大街18号中国人寿中心15层 法定代表人:祝献忠 联系人:李慧灵 电话:(010)-65661100 传真:(010)-65661613 客服电话:400-896-9999 网址:www.hrcsc.com.cn

95 天风证券股份有限公司 地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路高科大厦17层 办公地址:武汉市东湖新技术开发区关东园路高科大厦17层 法定代表人:余磊 联系人:杨晶 电话:(027)-87610622 传真:(027)-87618953 客服电话:400-880-5000 网址:www.tfcz.com

96 大通证券股份有限公司 地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座大连期货大厦38层 办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座大连期货大厦38层 法定代表人:李光军 联系人:刘立军 电话:(0411)-39991807 传真:(0411)-22626001 客服电话:400-168-1689 网址:www.wdton.com

97 开源证券股份有限公司 地址: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:王兆华 联系人:任福利 电话:(0755)-83180910 传真:(0755)-83181121 (三)律师事务所和经办律师 名称:广东达信律师事务所 注册地址:北京市海淀区益田金融中心4层 办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼12层 法定代表人:杨剑涛 联系人:郭红霞 经办律师:张富根、郭红霞 电话:(010)-88095688 传真:(010)-88091199

(二)登记机构 名称:前海开源基金管理有限公司 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(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7006号万科富春东方大厦22楼 法定代表人:王兆华 联系人:任福利 电话:(0755)-83180910 传真:(0755)-83181121 (三)律师事务所和经办律师

名称:广东达信律师事务所

注册地址:北京市海淀区益田金融中心4层

办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼12层 法定代表人:杨剑涛 联系人:郭红霞

经办律师:张富根、郭红霞 电话:(010)-88095688 传真:(010)-88091199

四、基金名称 前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型 混合型

开放式

(一)投资目标 本基金主要通过精选投资与大安全主题相关的优质证券,在合理控

制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

六、基金的安全性是国家的基本利益,是一个国家处于没有危险的客观状态。中国共产党中央国家安全委员会于2013年11月12日正式成立,将国家安全提升至前所未有的高度。在国家安全的大背景下,国家必将加大对相关领域的投资和政策支持,这些领域主要包括:国防军工、信息安全、生态安全、食品安全、国民安全、经济安全和其他一些涉及国家安全的领域。

(二)投资范围 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)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、权证、股指期货以及外汇交易保证金、利率互换、信用衍生品种等,但应当符合中国证监会的有关规定。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的,应当根据风险管理的原则,并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例,应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前,应与托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、上市公司合并、股权分置改革、市场环境变化等原因导致基金投资比例不符合上述规定的,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。

基金管理人当自基金合同生效之日起6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,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定,基金管理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。

法律法规或监管机构取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,可取消上述限制。

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,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格以及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(三)投资策略 本基金的投资策略主要有以下五方面内容:

1.大类资产配置

在大类资产配置中,本基金综合运用定性和定量的分析手段,在对宏观经济因素进行充分研究的基础上,判断宏观经济周期所处阶段。本基金管理人将根据宏观经济周期、结合证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率的评估,制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控,根据经济运行周期变化、市场利率变化、市场估值、证券市场价格变化等因素以基金资产的流动性、安全性、收益性为标准评估其参与市场基本要素的变动,调整各类资产在基金投资组合中的比例。

2.股票投资策略

本基金将精选具有较高增值潜力的,与大安全主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。大安全主题的股票投资策略将从行业分类、市场地位、竞争优势、盈利能力、创新能力等多种因素,定量方面考量公司估值、资产负债率及财务状况,比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

3.债券投资策略

在债券投资策略方面,本基金将以大安全主题相关债券为主线,在综合研究的基础上实现积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券投资。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的最优权重。

4.基金投资策略

本基金将根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。基金管理人可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十)本基金的融资组合

本基金将根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等信息,保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

5.股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资的决策由基金经理负责,并根据宏观经济、政策及法规因素和资本市场因素,结合对宏观经济的判断和分析,确定投资比例和投资策略,调整各资产类别在基金投资组合中的比例。

6.基金的估值方法

本基金将基金的估值作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据基金对应公司基本面是否形成实质性影响,对基金投资组合的估值、风险收益状况,比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

7.基金的资产配置

本基金将基金的资产配置分为大安全主题相关基金的资产配置和大安全主题相关基金的资产配置,并根据宏观经济、政策及法规因素和资本市场因素,结合对宏观经济的判断和分析,确定投资比例和投资策略,调整各资产类别在基金投资组合中的比例。

8.基金的资产配置

基金经理根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等信息,保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

9.基金的资产配置

本基金将基金的资产配置分为大安全主题相关基金的资产配置和大安全主题相关基金的资产配置,并根据宏观经济、政策及法规因素和资本市场因素,结合对宏观经济的判断和分析,确定投资比例和投资策略,调整各资产类别在基金投资组合中的比例。

10.基金的资产配置

基金经理根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等信息,保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

11.基金的资产配置

本基金将基金的资产配置分为大安全主题相关基金的资产配置和大安全主题相关基金的资产配置,并根据宏观经济、政策及法规因素和资本市场因素,结合对宏观经济的判断和分析,确定投资比例和投资策略,调整各资产类别在基金投资组合中的比例。

12.基金的资产配置

基金经理根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等信息,保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

13.基金的资产配置

本基金将基金的资产配置分为大安全主题相关基金的资产配置和大安全主题相关基金的资产配置,并根据宏观经济、政策及法规因素和资本市场因素,结合对宏观经济的判断和分析,确定投资比例和投资策略,调整各资产类别在基金投资组合中的比例。

(一)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的价值,合计(轧差计算)比例为0%-95%。

(二)本基金在任何交易日(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净资产的20%。

(三)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的,应当根据风险管理的原则,并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例,应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前,应与托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、上市公司合并、股权分置改革、市场环境变化等原因导致基金投资比例不符合上述规定的,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。

基金管理人当自基金合同生效之日起6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,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定,基金管理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。

法律法规或监管机构取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,可取消上述限制。

14.本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值不得超过基金净资产的10%。

15.本基金在任何交易日(不包括平仓)持有的买入股指期货合约价值不得超过基金净资产的40%;保证金余额不得超过买入股指期货合约价值的80%。

16.本基金持有的全部股票市值不得超过基金净资产的20%。

17.本基金在任何交易日(不包括平仓)持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金净资产的10%。

18.本基金在任何交易日(不包括平仓)持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金净资产的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。

19.本基金在任何交易日(不包括平仓)持有的卖出股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金净资产的20%。基金管理人应当按照中国金融期货交易所的要求,完成对交易账户、交易权限、交易代码、交易密码、资金账户、交易对手、交易时间、交易金额等信息的设置,并按照中国金融期货交易所的规定,向中国金融期货交易所报告。

20.本基金所持有的股票总市值不得超过基金净资产的100%。

21.由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

八、基金管理人的名称

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。基金的过往业绩并不代表未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金管理人的基金招募说明书。

前海开源大安核心精选灵活配置混合型证券投资基金

前海开源大安核心精选灵活配置混合型证券投资基金

前海开源大安核心精选灵活配置混合型证券投资基金

前海开源大安核心精选灵活配置混合型证券投资基金

前海开源大安核心精选灵活配置混合型证券投资基金