

# 信息披露 Disclosure

(上接B065版)

78	长城证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层 办公地址: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:黄伟耀 联系人:胡启春 电话:0755-83516289 传真:0755-83516567 客服电话:400-666-6888 网址:www.cgws.com
79	光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路1506号 法定代表人:薛峰 联系人:刘刚 电话:(021)2219901 传真:(021)22191394 客服电话:95625 网址:www.ebscn.com
80	广州证券股份有限公司 注册地址:广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心主楼19层、20层 办公地址:广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心主楼19层、20层 法定代表人:邱三发 联系人:张敏 电话:(020)88839999 客服电话:956366 网址:www.gzscc.com.cn
81	大同证券有限责任公司 注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层 办公地址:山西省太原市长治路111号山西国贸中心12、13层 法定代表人:董祥祥 联系人:薛瑾 电话:(0351)4130322 客服电话:4007-121-212 网址:www.dtscc.com.cn
82	平安证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层 办公地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层 法定代表人:谢永林 联系人:周一 电话:(021-38637436 传真:(021-33830385 客服电话:95511-8 网址:http://stock.pingan.com
83	华安证券股份有限公司 注册地址:合肥市蜀山区文化新区天鹅湖路198号 办公地址:合肥市蜀山区二环路960号财富中心华安证券10层027室 法定代表人:李工 联系人:范迪 电话:(0651)8516121 传真:(0651)8516172 客服电话:95318 网址:www.haazq.com
84	东莞证券股份有限公司 地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 法定代表人:张美云 客服电话:(0769) 991310 网址:www.dgzq.com.cn
85	申万宏源西部证券有限公司 注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人:许建平 联系人:王媛 电话:(010)88095268 传真:(010)88095196 客服电话:400-800-0562 网址:www.byscn.com
86	中泰证券股份有限公司 地址:山东省济南市经七路86号 法定代表人:李玮 联系人:吴刚 电话:(0631)68889155 客服电话:95638 网址:www.zts.com.cn
87	华龙证券股份有限公司 注册地址: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:李刚 电话:(0931)4890208 传真:(0931)4890628 客服电话:400-689-8888 网址:www.hlzq.com.cn
88	中国国际金融股份有限公司 地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27、28层 法定代表人:丁学东 联系人:秦丽 电话:(010)85679888-4035 传真:(010)85675353 客服电话:400-910-1166 网址:www.cicc.com.cn
89	华鑫证券有限责任公司 注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦A01、301(1)单元 办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号 法定代表人:俞萍 联系人:陈明顺 电话:(021)54967022 客服电话:400-091-0918、(021)32109999、(020)9103882 网址:www.cfsc.com.cn
90	联讯证券股份有限公司 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 法定代表人:徐刚 联系人:徐刚 电话:(0752-2117970 客服电话:95854 网址:www.lxsec.com.cn
91	国金证券股份有限公司 注册地址:四川省成都市东城根上街95号 办公地址:四川省成都市东城根上街95号 法定代表人:冉云 联系人:刘茜娟、贾鹏 电话:(028-86690057、028-86690058 传真:(028-86681012 客服电话:95310 网址:www.gjzq.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17层 法定代表人:陈林 联系人:刘川川 电话:(021)68779790 传真:(021)68777992 客服电话:4008-209-898 网址:www.cnhbstock.com
93	英大证券有限责任公司 注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十三、三十二层 (四)办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十三、三十二层 法定代表人:吴骏 联系人:王云 电话:(0755-83007133 传真:(0755-83007034 客服电话:400-018-8988 网址:www.ydazq.com.cn
94	华融证券股份有限公司 注册地址:四川省成都市东城根上街95号 办公地址:北京市西城区金融大街8号 (四)办公地址:北京市朝阳区朝朝门北大街18号中国(保利)大厦12层 法定代表人:祝晓生 联系人:李静思 电话:(010)85565610 传真:(010)85565163 客服电话:400-808-9999 网址:www.hrsec.com.cn
95	天风证券股份有限公司 注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东街42号高科大厦4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 联系人:杨涛 电话:(027)87610052 传真:(027-8761883) 客服电话:400-800-5000 网址:www.tfzq.com
96	大通证券股份有限公司 注册地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座大商国际大厦38、39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座大商国际大厦38、39层 法定代表人:李岩光 联系人:王健 电话:(0411-3999187 传真:(0411-82269801 客服电话:4000-169-169 网址:www.daton.com.cn
97	开源证券股份有限公司 注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 法定代表人:袁伟涛 联系人:袁伟涛 电话:(029)83357288 客服电话:400-800-1886 网址:www.kysec.cn

(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:任利娟  
电话:(0755) 83180910  
传真:(0755) 83181121  
(三) 律师事务所和经办律师  
名称:广东信达律师事务所  
注册地址:深圳市福田区益田路501号太平金融大厦12楼  
负责人:麻云斌  
经办律师:杨海、胡云云  
电话:(0755) 88295298  
传真:(0755) 88295337  
(四) 会计师事务所和经办注册会计师  
名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)  
注册地址:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层  
办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层  
法定代表人:杨剑涛  
联系人:郭虹霞  
经办会计师:张富根、郭虹霞  
电话:(010) 88095588  
传真:(010) 88091190

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、基金的投资  
混合型  
开放式  
(一) 基金的投资  
本基金主要通过精选投资与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。

本基金即国家安,是国家的根本利益,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。在国家安全的背景下,国家必将加大对相关领域的投资政策支持,这些领域主要包括:国防军工、信息安全、能源安全、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、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)、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)、货币市场工具、权证、股指期货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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为0-95%,投资于大安全主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交

易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的国债。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人

在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的

投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

(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

基金依据经济周期理论,结合对证券市场的系统性风险以及未来一段

时期内各大类资产风险和预期收益率的评估,制定本基金在股票、债券、

现金及大类资产之间的配置比例。

2. 股票投资策略

本基金通过个股权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的

实时跟踪,根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市

场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中,根据其

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。

3. 债券投资策略

本基金在债券投资中将安全主题相关债券作为主线,在综

合分析的基础上,实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观

市场定价两个方面进行债券资产的管理。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

与银行间市场债券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配置。

在微观市场定价分析方面,本基金以中长期利率趋势分析为基础,

结合经济趋势、货币政策不同预期品种、利率水平、流动性和信用

风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信

用质量相对较高的品种。具体投资策略采用收益率曲线策略、骑乘策

略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4. 权证投资策略

本基金将权证的研究作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据

权证定价及公司基本面研究确定权证投资的合理估值,发现市场对股票

权证的理性定价;利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合

投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。

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时机和数量的决策建立在对证券市场总

体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经

济形势、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投

资时机。基金管理人将结合股指期货的估值模型,以及中国证监会的相

关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,

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,如大额

申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体

风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前建立股指期货投资决策部门

或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资

管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准

后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新

规定,以符合法律法规和监管要求的变化。

(四) 投资决策依据及程序

1. 决策依据

(以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并

以维护基金份额持有人利益为最高准则。

2. 决策程序

(1) 投资决策委员会制定整体投资策略。

(2) 研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果,构建股票备选

库,精选库,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供个股、债券决策

支持。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的投资战略,设计和调整投资组

合,设计和调整投资组合需要考的基本因素包括:每日基金申购和回

购净现金流量、基金合同的投资限制和比例限制;研究员的投资建议;

基金经理的独立判断;绩效与风险评估小组的建议。

(4) 投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析,并形成

决策意见。

(5) 根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方

案,交由交易员执行。

(6) 交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理。

(7) 基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估,并向投

资决策委员会提交评估报告和改进方案。

(8) 风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风

险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;基金绩效评估岗

及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

(五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中证全

债指数收益率×30%。

业绩比较基准选择理由:

沪深300指数是由中证指数公司编制发布,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。样本覆盖面为沪深两市六成左右的市值,具

有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映境内债券市场和

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

和交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数公司每日

计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的

一个重要特点在于对异常价格和无效价情况下使用了模型价,能更为真实

地反映债券的实际价值和收益率水平。本基金选择该指数来衡量债券投

资部分的绩效。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、能更为市场普遍接

受的业绩比较基准推出,或在市场上出现更适用于本基金的业绩

比较基准时,本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备

案以变更业绩比较基准并予以公告,但不需要召集基金份额持有人大

会。

(六) 风险收益特征

本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险

和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

(七) 投资限制

1. 组合限制

本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0-95%,投资于大安全

主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的80%;

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交

易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以

内的政府债券;

(3) 本基金持有一家上市公司发行的证券,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上市公司发行的证券,不

超过该证券的10%;

(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(同一同一信用级别)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、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,不得超过该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(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,本基金所申报的股票数量不超过

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) 本基金在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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期

后不得展期;

(15) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会

相关规定,与基金托管人、基金托管人签订明确基金投资流通受限

证券的风险控制,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的决策流

程和投资风险控制,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风

险;(16) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的

10%,并且不得超过基金净值的10%;

(17) 本基金在任何交易日日终,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%;

(18) 本基金在任何交易日日终,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

入逆回购金融资产(不含质押式回购)等;

(19) 本基金在任何交易日日终,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%;本基金管理人应当按照中国金融期

交易所要求的内容、格式与时限向中国证监会报告交易和持有的卖出期

货合约情况;交易所及对应的证券资产情况;

(20) 本基金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)比例90%-95%;

(21) 本基金在任何交易日日内交易(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%;

(22) 本基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十;

(23) 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时,应当根据风险管理

的原则,并制定严格的投资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和的具体比例,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,应与基金托管人就股指期货

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、基金规模变动、股权分置改革中

支付对价等基金管理人以外的因素致使基金投资比例不符合上述规

定比例的,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。

基金管理人应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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自

本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人

在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

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

者活动:(1) 承销证券;(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金管理人、基金托管人发行的股票;

(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投资活