（上接B700版）

77	弘业期货股份有限公司	注册地址：南京市秦淮区中华路50号 办公地址：南京市秦淮区中华路50号弘业大厦2-10楼 法定代表人：周剑秋 联系人：孙朝旺 电话：025-52278870 传真：025-52250114 客服电话：4008281288 网址：www.ftol.com.cn
78	诺亚正行基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋 法定代表人：汪静波 联系人：张韵 电话：021-80359127 传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
79	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客服电话：4006-788-887 网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com
80	上海好买基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室；上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 电话：021-20613999 传真：021-68596916 客服电话：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com
81	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬 客服电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn
82	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层 法定代表人：张跃伟 联系人：张佳琳 电话：021-20691831 传真：021-20691861 客服电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com
83	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190号2号楼2层 办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座大楼（东方财富大厦） 法定代表人：其实 联系人：黄妮娟 电话：021-54509998 传真：021-64385308 客服电话：95021 网址：www.1234567.com.cn
84	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层 法定代表人：闫振杰 联系人：罗红 电话：010-59601366 传真：010-62020355 客服电话：4008188000 网址：www.myfund.com
85	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室 办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号 同花顺大楼4层 法定代表人：凌顺平 联系人：吴强 电话：0571-88911818-8653 传真：0571-86800423 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com
86	中期资产管理有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号 办公地址：北京市朝阳区光华路16号中期大厦2层 法定代表人：姜新 联系人：尹庆 电话：010-65807865 传真：010-65807864 客服电话：010-65807609 网址：http://www.cifcfund.com
87	众升财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室 办公地址：北京市朝阳区望京凯德广中心A座10层04-08 法定代表人：李招弟 联系人：李艳 电话：010-59497361 传真：010-64788016 客服电话：400-876-9988 网址：www.zscffund.com
88	和讯信息科技有限公司	注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人：王莉 联系人：刘洋 电话：010-85650628 传真：010-65884788 客服电话：4009200022 网址：licaike.hexun.com
89	宜信普泽（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809 法定代表人：戎民 联系人：魏巍 电话：010-52413385 传真：010-85894285 客服电话：4006099200 网址：www.yixinfund.com
90	浙江金观诚基金销售有限公司	注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室 办公地址：杭州市拱墅区登云路43号金诚集团（锦昌大厦）13楼 法人：徐黎云 联系人：宋舒岚 电话：0571-88337888 传真：0571-88337666 客服电话：400-068-0058 网址：www.jincheng-fund.com
91	泛华普益基金销售有限公司	注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 办公地址：四川省成都市成华区锦江区东大街99号平安金融中心1501室 法定代表人：于海锋 联系人：陈全红 电话：18891998779 传真：028-84262474-801 客服电话：400-8588588 网址：http://www.puyifund.cn
92	嘉实财富管理有限公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 法定代表人：赵学军联系人：顾娟 电话：021-20289890 传真：021-20280110 客服电话：400-021-8850 网址：www.harvestwm.cn
93	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：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28号富卓大厦16层 法定代表人：马勇 联系人：文雯 电话：010-83363101 传真：010-83363072 客服电话：400-166-1188 网址：https://8.jrj.com.cn
94	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市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北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室 法定代表人：周斌 联系人：祖杰 电话：010-53509636 传真：010-57756199 客服电话：4008980618 网址：www.chtfund.com
95	北京钱景基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区万柳ironi6号1幢9层1008-1012 办公地址：北京市海淀区万柳ironi6号1幢9层1008-1012 法定代表人：赵荣春 联系人：李超 电话：010-56200948 传真：010-57569671 客服电话：400-893-6885 网址：qianjing.com
96	北京创金启富基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 法定代表人：梁蓉 联系人：魏素清 电话：010-66154828-8006 传真：010-63582991 客服电话：400-6262-818 网址：www.5irich.com
97	海银基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室 办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼 法定代表人：刘惠 联系人：刘晨 电话：021-60206991 传真：021-80132413 客服电话：400-808-1016 网址：www.fundhaiyin.com
98	北京植信金基金销售有限公司	注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67 办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼 法定代表人：于龙 联系人：吴鹏 电话：010-56075718 传真：010-67767615 客服电话：4006-802-123 网址：http://www.zhixin-inv.com
99	上海联泰资产管理有限公司	注册地址：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座3层 法定代表人：燕斌 联系人：陈东 电话：021-52822063 传真：021-52075270 客服电话：400-166-6788 网址：http://www.66zichan.com
100	上海利得基金销售有限公司	注册地址：上海市宝山区富川路5476号1033室 办公地址：上海浦东新区锦山路91弄61号10号楼12楼 法定代表人：李兴春 联系人：郑茂 电话：021-50583533 传真：021-60196218 客服电话：400-021-7755 网址：www.leadfund.com.cn
101	上海汇付金融服务有限公司	注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层 上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼 法定代表人：金佶 联系人：陈云卉 电话：021-33323999 传真：021-33323837 客服电话：400-821-3999 网址：http://tty.chinapnr.com
102	厦门市鼎鼎盛控股有限公司	注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 法定代表人：陈洪生 联系人：柴云波 电话：0592-3122757 传真：0592-3122701 客服电话：400-918-0808 网址：www.xds.com.cn
103	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址：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：胡学勤 联系人：宁博宇 电话：021-20669652 传真：021-20666653 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com
104	北京加和基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层 办公地址：北京市西城区金融街11号703 法定代表人：徐福贺 联系人：张巍 电话：010-5086 6176 传真：010-5086 6173 客服电话：400-600-0030 网址：www.bzfunds.com
105	北京虹点基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层 法定代表人：胡伟 联系人：陈铭洲 电话：18513699505 客服电话：400-068-1176 网址：www.hongdianfund.com
106	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区北正西路中关村软件园二期西扩N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室 办公地址：北京市海淀区北正西路中关村软件园二期西扩N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室 法定代表人：李昭琛 联系人：吴翠 电话：010-60619607 客服电话：010-62675369 网址：http://www.xincai.com
107	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址：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1201-1203室 法定代表人：肖雯 联系人：邱湘湘 电话：020-89629099 传真：020-89629011 客服电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn
108	深圳富济基金销售有限公司	注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位 办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位 法定代表人：刘鹏宇联系人：刘鹏 电话：0755-83999907-811 传真：0755-83999926 客服电话：0755-83999907 网址：www.jinrongjiaowo.cn
109	北京鼎鼎耀华基金销售有限公司	注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋2230室 办公地址：北京朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A座303 法定代表人：张鑫 联系人：刘美薇 电话：010-53570572/13121820670 传真：010-59200100 客服电话：400-819-9868 网址：http://www.tdyhfund.com/
110	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址：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：黄玮 电话：021-63333389-230 传真：021-63333390 客服电话：4006-433-389 网址：www.vstonewealth.com
111	大泰金石基金销售有限公司	注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2106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：袁颖明 联系人：孟召社 电话：15621569619 传真：021-20324199 客服电话：400-021-2266/021-22267995 网址：www.dtfunds.com
112	济安财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：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 财富中心A座46层 法定代表人：杨健 联系人：李海燕 电话：010-65309516 传真：010-65330699 客服电话：400-673-7010 网址：http://www.jianfortune.com
113	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	注册地址：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号新华社第三工作区5F 法定代表人：钱昊旻 联系人：孙雯 电话：010-59336519 传真：010-59336500 客服电话：4008-909-998 网址：www.jrjc.com
114	鼎信汇金（北京）投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区大月园3号楼5层521室 办公地址：北京市海淀区大月园3号楼5层521室 法定代表人：齐凌峰 联系人：阮志凌 电话：010-82050520 传真：010-82098110 客服电话：400-158-5050 网址：www.9ifund.com
115	深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路A栋201 办公地址：深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座 法定代表人：顾敏 客服电话：4009998877
116	北京汇成基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村大街11号1108 办公地址：北京市海淀区中关村大街11号1108 法定代表人：王伟刚 联系人：丁向坤 电话：010-56282140 传真：010-62680827 客服电话：4006199059 网址：www.hcjj.com
117	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人：钱燕飞 联系人：王锋 电话：025-66996699-887226 传真：025-66996699 客服电话：95177 网址：www.snjrjn.com
118	北京广源达信投资管理有限公司	注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层606室 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层 法定代表人：齐剑辉 联系人：姜英华 电话：4006236060 传真：010-82055860 客服电话：4006236060 网址：www.niuniufund.com
119	上海万得基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座 办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼 法定代表人：王廷富 联系人：徐亚丹 电话：021-50712782 传真：021-50710161 客服电话：400-821-0203
120	北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 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：吴季林 电话：010-61840688 传真：010-61840699 客服电话：4000618518 网址：https://www.danjuanapp.com
121	上海云湾基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层 法定代表人：戴新装 联系人：江辉 电话：021-20538888 传真：021-20538999 客服电话：400-820-1515 网址：www.zhengtongfunds.com
122	上海中正达广基金销售有限公司	注册地址：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 法定代表人：黄欣联系人：戴聚微 电话：021-33768132 传真：021-33768132-802 客服电话：400-6767-523 网址：www.zhongzhengfund.com
123	南京途牛基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号 办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号 法定代表人：宋时琳 联系人：贺杰 电话：025-86853969-66727 客服电话：4007-999-999 网址：http://jr.tuniu.com
124	上海基煜基金销售有限公司	注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区） 办公地址：上海市昆明路518号北美广场A栋1002-1003室 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-35385521 传真：021-55085991 客服电话：400-820-5369 网址：www.jiyufund.com.cn
125	深圳市金斧子基金销售有限公司	注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层 办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元7层 法定代表人：赖任军 联系人：刘昕霞 电话：0755-29330513 传真：0755-29320530 客服电话：400-930-0660 网址：www.jfzinv.com
126	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：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18号院京东总部A座17层 法定代表人：江卉 联系人：徐伯宇 电话：010-89188256 传真：010-89189566 客服电话：95118 网址：jcjd.com
127	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址：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：毛准平 联系人：仲秋玥 电话：010-88066522 传真：010-88066552 客服电话：400-817-5666 网址：www.amcfortune.com
128	大河财富基金销售有限公司	注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号 办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号 法定代表人：王庆联系人：潘建 电话：0851-85406006 传真：0851-85406002 客服电话：0851-88235678 网址：www.urainf.com
129	上海挖财基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室 法定代表人：胡燕亮联系人：李娟 电话：021-50810687 传真：021-58300279 客户服务电话：021-50810673 网址：www.wacai.com
130	和耕传承基金销售有限公司	注册地址：郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北8号楼6楼602、603房间 办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6F 法定代表人：李淑慧 联系人：胡静华 电话：0371-85618396 传真：0371-85618397 客服电话：4000-555-671 网址：http://www.hgccpb.com/
131	中民财富基金销售（上海）有限公司	注册地址：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：龚洪军 联系人：李娜 电话：021-33357030 传真：021-63353736 客服电话：400-876-5716 网址：www.cmiwm.com
132	大连网金金融信息服务有限公司	注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室 办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室 法定代表人：卜勇 客服电话：4000-899-100 网址：http://www.yibaijin.com/
133	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.2 登记机构

南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

法定代表人：张海波

电话：（0755）82763849

传真：（0755）82763889

联系人：古和鹏

3.3 出具法律意见书的律师事务所

北京市盈科（深圳）律师事务所

注册地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座3层

负责人：姜敏

电话：(0755) 88604192

传真：(0755) 36866661

经办律师：戴瑞冬、付强

3.4 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：曹阳

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、曹阳

§4 基金名称

南方安泰混合型证券投资基金

§5 基金的类型

混合型证券投资基金

§6 基金的投资目标

本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。

§7 基金的投资范围

本基金的投资对象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）、股指期货、权证、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等）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的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于70%，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。 本基金管理人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上述相关规定。

§8 基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金在资产配置方面采用优化的恒定比例投资组合保险策略（优化CPPI）。CPPI策略是国际通行的一种投资组合保险策略，优化的CPPI策略是对CPPI策略的一种优化，它主要是通过金融工程技术和数量分析等工具，根据市场的波动来动态调整风险资产与稳健资产在投资组合中的比重，以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，以达到增强组合收益的效果。该策略的具体实施主要有以下步骤： 第一步，确定基金价值底线。根据投资组合期末最低目标价值和合理的折现率设定当前应持有的稳健资产的数量，即投资组合的价值底线，计算投资组合现时净值超过价值底线的数额； 第二步，确定风险资产。将相当于净值超过价值底线的数额特定倍数的资金投资于风险资产（如股票等），以实现最低目标价值的增值。第三步，调整风险乘数及资产配置比例。本基金将根据市场波动的特点以及预期的风险与收益的匹配关系，定期计算风险乘数上限并对实际风险乘数进行监控，一旦实际风险乘数超过当期风险乘数上限，则重复前两个步骤的操作，对风险乘数进而整体资产配置比例进行动态调整。 2、债券投资策略

本基金将密切关注经济运行的质量与效率，把握领先指标，预测未来走势，深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。本基金对宏观经济运行中的价格指数与中央银行的货币供给与利率政策研判将成为投资决策的基本依据，并作为债券组合的久期配置的依据。在宏观分析及其决定的久期配置范围下，本基金将进行类属配置以贯彻久期策略。对不同类属债券，本基金将对其收益和风险情况进行评估，评估其为组合提供持有期收益和价差收益的能力，同时关注其利率风险、信用风险和流动性风险。本基金的债券投资策略还包括以下几方面：

（1）综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。这部分投资包括中长期的国债、金融债、企业债，以及中长期逆回购等等。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会，利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性、控制风险等等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。

（2）利用银行间市场和交易所市场现券存量进行债券回购所得的资金积极参与新股申购、新股增发和配售，以获得股票一级市场的可能投资回报。

（3）利用未来可能推出的利率远期、利率期货、利率期权等金融衍生工具，有效地规避利率风险。

本基金投资中小企业私募债券，由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资人数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

3、股票投资策略

本基金注重对股市趋势的研究，在股票投资限额内，精选优势行业和优势个股，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。本基金依据稳健投资的原则，以低风险性、具备中期上涨潜力为主要标准，构建股票组合，同时兼顾股票的流动性。

根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与价值链分布来确定优势行业，以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。在行业选择中，本基金注重宏观经济景气状况及所处阶段，主要分析目前经济增长的构成、来源、景气状况，寻找增长空间较大、持续性较强的行业，寻找经济转型中受益程度最高的行业，结合动态分析行业发展周期、与上下游关系与谈判地位，寻找产业链中由弱转强或优势扩大的行业。

在个股的选择上，首先按照风险性由低至高、中期上涨潜力由高至低和流动性由高到低对股票池内的股票进行排名，累加三项排名得到综合排名，取综合排名靠前的股票构建股票组合，进行组合投资。

本基金通过选择风险低的股票，保证组合的稳定性；通过选择具中期上涨潜力的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、组合投资和流动性管理，降低个股集中性风险和流动性风险。

4、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

（1）利用股指期货调整风险资产的比例和投资组合的β值

本基金管理人将根据CPPI策略与市场的变化不断调整风险资产和安全资产之间的比例。在需要调整风险资产的头寸时，本基金将适当通过买卖股指期货对风险资产头寸进行调整。当需要增加风险资产头寸时，通过做多股指期建立多头头寸；反之，当需要降低风险资产头寸时，通过做空股指期货建立股指期货空头头寸。另一方面，本基金管理人还将利用股指期货调整投资组合的β值，利用股指期货在弱市中降低风险资产组合的β值，在强市中提高风险资产组合的β值，以提升组合的业绩表现。

（2）α策略

在投资组合中分离出系统风险，寻求具有长期稳定的超额收益的投资品种，并利用股指期货规避股票市场的系统风险。

本基金的股指期货投资将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

5、权证投资策略

本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，主动进行部分权证投资。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

§9 基金业绩比较基准

沪深300指数收益率×15%＋上证国债指数收益率×85%

本基金是以债券投资为主的混合型基金，以“沪深300指数收益率×15%＋上证国债指数收益率×85%”作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资人判断本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会。

§10 基金的风险收益特征

本基金为债券投资为主的混合型基金，属于中低风险、中低收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

§11 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本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复核了本报告中的财务指标、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日（未经审计）。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	135,813,732.83	16.16
	其中：股票	135,813,732.83	16.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	682,206,873.28	81.25
	其中：债券	682,206,873.28	81.25
	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	-	-
	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	9,451,555.48	1.13
8	其他资产	12,123,173.89	1.44
9	合计	839,595,335.48	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	75,127,382.79	10.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,354,647.85	0.19
E	建筑业	3,980,641.00	0.57
F	批发和零售业	13,768,343.04	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	8,160,035.63	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	31,733,696.38	4.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,607,760.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	135,813,732.83	19.43

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

1.3 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	601166	兴业银行	840,600	12,104,640.00	1.73
2	601009	南京银行	1,205,995	9,322,341.35	1.33
3	000786	北新建材	330,900	6,131,577.00	0.88
4	002511	中顺洁柔	637,000	6,000,540.00	0.86
5	600511	国药股份	218,900	5,899,355.00	0.84
6	000651	格力电器	123,794	5,836,887.10	0.83
7	000333	美的集团	100,724	5,289,807.28	0.75
8	601229	上海银行	287,539	4,531,614.64	0.65
9	000895	双汇发展	160,615	4,241,842.15	0.61
10	600741	华域汽车	173,300	4,110,676.00	0.59

1.4 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	80,038,000.00	11.45
	其中：政策性金融债	50,665,000.00	7.25
4	企业债券	332,622,100.00	47.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	219,934,000.00	31.46
7	可转债（可交换债）	1,722,773.28	0.25
8	同业存单	47,890,000.00	6.85
9	其他	-	-
10	合计	682,206,873.28	97.59

1.5 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	136434	16葛洲03	630,000	60,895,800.00	8.71
2	101469017	14国家核电MTN002	500,000	50,785,000.00	7.26
3	140209	14国开09	500,000	50,665,000.00	7.25
4	101454034	14中南为MTN001	500,000	50,385,000.00	7.21
5	101654092	16津城建MTN003	500,000	48,970,000.00	7.01

1.6 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的