

信息披露Disclosure

上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金合同生效日期:2015年6月2日
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示:

1. 投资有风险,投资者认购(或申购)基金前应认真阅读招募说明书;
2. 基金过往业绩并不预示其未来表现;本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。

3. 基金合同约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自认购(或申购)基金份额起,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表明其对本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。

4. 基金投资人了解基金情况应仔细阅读基金合同、基金招募说明书及基金业绩的数据截止日为2019年3月31日。

5. 本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债券发行人,通常为中小微企业,存在着公司治理结构不完善、企业经营风险高、流动性不足、非标准化程度高、信用评级和信用风险与流动性风险同时存在等特点。本基金可以参与中小企业私募债券的投资,应详细查阅基金合同。

6. 本基金可以参与科创板股票的投资。本基金投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中度风险、市场风险、系统风险、股价波动风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场条件的变化,选择将部分基金资产投资于科创板股票,但不将基金资产投资于科创板股票,且基金资产亦不必将投资于科创板股票。

7. 本招募说明书摘要所载内容截止日为2019年6月1日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2019年3月31日。

一、基金管理人概况

本基金的管理人为上投摩根基金管理有限公司,基本信息如下:

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区城南路99号震旦国际大楼25层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区城南路99号震旦国际大楼25层
法定代表人:陈兵

总经理:王大为
成立日期:2004年5月12日
注册资本:人民币10亿元
股权结构及持股比例:上投摩根资产管理有限公司 51%
JPMorgan Asset Management (UK) Limited 49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2004]65号文批准,于2004年5月12日成立的证券投资基金管理人。2005年4月12日,基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。目前本基金保持不变更,股东及出资比例分别为上海国信信托有限公司67%和摩根资产管理(英国)有限公司33%变更为目前的61%和40%。

2006年6月6日,基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”,该更名申请于2006年4月29日获得中国证监会的批准,并于2006年6月2日在国家工商总局完成更名登记手续。

2009年3月31日,基金管理人的注册资本由一亿五千万人民币增加至二亿五千万人民币,公司股东的出资比例不变。该变更事项于2009年3月31日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何处罚记录。

主要人员情况:

1. 董事会成员基本情况:

董事长:陈兵
博士研究生,高级经济师。
曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理,上海浦东发展银行总行资金部总经理助理,上海浦东发展银行总行个人银行总部管理总部总经理助理,上海国信信托有限公司总经理兼董事会秘书,上海国信信托有限公司党委书记、总经理。

现任上海国信信托有限公司党委书记、总经理;上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事:Paul Bateman
大学本科学历,曾任 Fleming Asset Management Limited 全球总监、摩根资产管理全球投资管理部行政总裁。

现任摩根资产管理全球主席、资产管理委员会成员及投资委员会成员。

董事:Daniel J. Watkins
学士学位。

曾任上海浦东发展银行行政、摩根资产管理欧洲业务首席运营官、全球投资运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册证券投资总监、卢森堡运营总监、欧洲注册证券投资及伦敦股权投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。

现任摩根资产管理亚洲业务首席执行行政、资产管理委员会成员、集团亚太区管理经理。

董事:王大智
曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投资董事长期摩根资产管理中国区负责人。

现任上海浦东发展银行股份有限公司总经理。

董事:潘卫东
硕士研究生,高级经济师。

曾任上海浦东发展银行基金金融部处长(挂职)、上海国际集团有限公司副董事长、上海国信信托有限公司党委书记。

现任上海浦东发展银行股份有限公司副行长、上海国际信托有限公司董事长。

董事:陈海宁
研究生学历,经济师。

曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总管理融资融券部总经理、武汉证券副行长、武汉证券党委书记、行长。

现任上海浦东发展银行总行资产负责管理总部总经理兼总行战略发展部总经理。

董事:丁蔚
硕士研究生。

曾就职于中国建设银行上海分行个人银行业务部副总经理,上海浦东发展银行个人银行总部资产部总经理,个人银行总部副总经理兼董事卡部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理。

独立董事:俞飏
经济学博士。

曾任上海财经大学公共管理学院经济与金融学教授及公共金融与治理中心主任、现任在加利利大学经济学院、新加坡国立大学经济学院、复旦大学金融系等职位任教。

独立董事:刘红忠
国际金融系金融学博士。

曾任复旦大学经济学院教授,复旦大学金融研究中心副主任;同时兼任华泰证券股份有限公司、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:戴卫宁
获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长、上海农村商业银行为股份有限公司、申银万国期货有限公司、上海海通证券有限公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

住所: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:毛淮平
联系电话:010-6759 5096
客户服务热线:400-817-6666

(27) 上海万得基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号1幢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
客户服务电话:400-799-1888

(28) 嘉实财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人:赵学军
客服电话:400-021-8850

网站:www.harvestwm.cn
(29) 渣打银行(中国)有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦13层、16层(实际楼层15层)、17层(实际楼层16层)、18层4室(实际楼层17层4室)、19层(实际楼层18层)、20层1室(实际楼层19层1室)、21层1、3、4室(实际楼层20层1、3、4室)、23层(实际楼层22层)、25层2、4室(实际楼层22层2、4室)、27层2室(实际楼层25层2室)、28层(实际楼层26层)

法定代表人:李德威
客服电话:4008888003
网站:www.sc.com.cn

(30) 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川北路388弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1188号鄂尔多斯大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9656

公司网站:www.ehowbuy.com
(31) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
法定代表人:李海斌
客服电话:4006-788-887

公司网站:www.zlfund.cn www.jimwm.com
(32) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道一西路969号3幢5层569室
办公地址:浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼
法定代表人:吴源斌
客服电话:4000-776-772

公司网站:www.fund123.cn
(33) 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:上海市徐汇区龙田路195号3C层9楼
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188

网站:www.1234567.com.cn
(34) 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9号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市西湖区新龙路1号元茂电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
客服电话:4008-773-772

公司网站:www.5ifund.com
(35) 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:王之光
客服电话:400-821-9201

网站:www.lufunds.com
(36) 北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:王峰
客服电话:400-618-0707

网站:www.hongdianfund.com
(37) 珠海嘉米财富管理咨询有限公司
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B
法定代表人:王峰
客服电话:400-862-0600

网站:www.yingmi.cn
(38) 北京新浪乐金基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺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:北京市海淀区东北旺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:李振刚
客服电话:010-62675369

网站:www.xincai.com
(39) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:江卉
客服电话:4000988811/4000888816

网站:http://fund.jl.com/ (40) 中金金牛(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2-4层
办公地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-4层
法定代表人:吴昊
客服电话:4008-909-998

网站:www.julic.com
(41) 美丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区海德三路航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TRE WEE HOWE
客服电话:400-694-0600

网站:www.lifastps.com
(42) 北京中泰证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼A座1015
办公地址:北京市永定门西滨河路8号院7号楼A座1015
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:江卉
客服电话:4000988811/4000888816

网站:http://fund.jl.com/ (40) 中金金牛(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2-4层
办公地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-4层
法定代表人:吴昊
客服电话:4008-909-998

网站:www.julic.com
(41) 美丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区海德三路航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TRE WEE HOWE
客服电话:400-694-0600

网站:www.lifastps.com
(42) 北京中泰证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼A座1015
办公地址:北京市永定门西滨河路8号院7号楼A座1015
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

网站:www.xincai.com
(43) 北京肯瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
办公地址:北京市昌平区海润东二街二号楼4层401-15
法定代表人:李玮
客服电话:010-62753699

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债券品种。具体策略有:

(1) 利率预期策略:本基金首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资收益率变化趋势及未来利率走势,通过基本面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成合理预期。

(2) 价值策略:建立不同品种的收益曲线预期模型,并利用这些模型进行估值,确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的信用级别构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值品种,并定期对投资组合的资产进行估值,对投资组合进行动态调整。

(3) 资产配置策略:本基金将根据宏观经济、政策、市场、信用、流动性等因素,对投资组合进行动态调整,合理选择不同市场中有投资价值品种,并定期对投资组合的资产进行估值,对投资组合进行动态调整。

(4) 可转换债券投资策略:可转换债券(含分离交易可转债)兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合基本面和估值法进行,在基本面和估值法的基础上,通过深入分析可转债的发行条款、转股价格、转股期限、赎回条款、回售条款等因素,对可转债的投资价值进行评估,并据此做出投资决策。

(5) 中小企业私募债券投资策略:本基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,从源头上控制信用风险和流动性风险。在符合法律法规的前提下,通过对发行主体资质、债券信用状况、流动性、风险匹配原则以及债券的信用级别构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值品种,并定期对投资组合的资产进行估值,对投资组合进行动态调整。

(6) 股指期货投资策略:本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要进行流动性管理、资产配置调整、风险对冲等投资。同时,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要进行流动性管理、资产配置调整、风险对冲等投资。同时,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要进行流动性管理、资产配置调整、风险对冲等投资。

(7) 资产支持证券投资策略:本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要进行流动性管理、资产配置调整、风险对冲等投资。同时,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要进行流动性管理、资产配置调整、风险对冲等投资。

(8) 股票期权投资策略:本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要进行流动性管理、资产配置调整、风险对冲等投资。同时,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,