(上接B081版)

客服电话:4008-773-772
网址:www.5ifund.com
(61)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
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:沈继伟
联系人:徐鹏
电话:86-021-50583533
传真:86-021-50583533
客服电话:400-067-6266
网址:http://admin.leadfund.com.
(62)乾道金融信息服务(北京)有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人:王兴吉
联系人:高雪超
网址:www.qiandaojr.com
电话:400888080
(63)北京格上富信投资顾问有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:曹庆展
联系电话:010-85932450
网址:www.igesafe.com
客服电话:400-066-8586
(64)北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人:罗细安
联系人:李皓
联系电话:13521165454
客服电话:400-001-8811
传真:010-67000988-6000
网址:www.zcvc.com.cn
(65)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:北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法定代表人:李悦
联系人:张晔
电话:010-58845312
网址:www.chtfund.com
客服电话:400-8980-618
(66)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11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
客服电话:400-619-9059
网址:http://www.fundzone.cn
(67)深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
网站:www.fundying.com
客服电话:4007-903-688
(68)北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21&28层
法定代表人:蒋煜
联系人:殷斐
电话:010-58170844
传真:010-58170710
网址:www.shengshiview.com.cn
客服电话:400-818-8866
(69)北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人:赵荣春
联系人:盛海娟
电话:010-57418813
传真:010-57569671
网址:www.qianjing.com
客服电话:400-893-6885
(70)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层
法定代表人:张冠宇
联系人:刘美薇
联系电话:010-85870662
传真:010-59200800
网址:www.datangwealth.com
客服电话:400-819-9858
(71)天津国美基金销售有限公司
注册地址:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层
法定代表人:丁东华
联系人:郭宝亮
电话:010-59287984
传真:010-59287825
客服电话:400-111-0889
(72)上海挖财金融信息服务有限公司
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:冷风
网址:www.wacaijijin.com
客服电话:021-50810687
(73)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:赵耶
客服电话:95177
网址:www.snjijin.com
(74)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:刘栋栋
电话:010-88312877
传真:010-88312099
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
(75)中经北证(北京)资产管理有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号
法定代表人:徐福星
联系人:徐娜
电话:010-68292940
传真:010-68292941
客服电话:400-600-0030
网址:www.bzfunds.com
(76)凤凰金信(银川)投资管理有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号1402
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院18号楼
法定代表人:程刚
联系人:张旭
电话:010-58160168
客服电话:400-810-5919
网址:www.fengfd.com
(77)扬州国信嘉利投资理财有限公司
注册地址:广陵产业园创业路7号
办公地址:江苏省扬州市文昌西路56号公元国际320
法定代表人:王浩
网址:www.gxjlcn.com
客服电话:400-021-6088
(78)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
网址:www.taichengcaifu.com
客服电话:400-6411-999
(79)北京微动利投资管理有限公司
注册地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室
法定代表人:梁洪军
联系人:季长军
电话:010-52609656
传真:010-51957430
网址:http://www.buyforyou.com.cn/
客服电话:400-819-6665
(80)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:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网址:www.jiyufund.com.cn
(81)上海中正达广投资管理有限公司
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:戴珉微
电话:021-33768132
客服电话:400-6767-523
网址:www.zzwealth.cn
(82)武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:孔繁
电话:027-87006009
网址:http://www.buyfunds.cn
客服电话:400-027-9899
(83)大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺市江东中路359号
办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人:袁顾明
联系人:何庭宇
电话:13917225742
传真:021-22268089
客服电话:021-22267995/400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
(84)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
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
法定代表人:肖雯
联系人:吴煜浩
电话:020-89629021
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
(85)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:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人:董浩
联系人:牛亚楠
联系电话:18610807009
客服电话:400-068-1176
网址:www.jimubox.com
(86)深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:刘昊
电话:0755-83999907
传真:0755-83999926
客服电话:0755-83999907
网址:www.jinqianwo.cn
(87)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南路康宁街互联网金融大厦6层
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6层
法定代表人:李淑慧
联系人:方良治
电话:0371-55213196
客服电话:400-055-5671
网址:http://www.hgccpb.com
(88)京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:陈超
联系人:娄云
电话:4000888816
客服电话:95118网址:http://fund.jd.com
(89)深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址:深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02
办公地址:深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼
法定代表人:陈姚坚
联系人:陈姿儒
网址:www.jfzinv.com
电话:4009500888
(90)深圳市华融金融服务有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道滨河路5022号联合广场A座裙楼A302
办公地址:深圳福田区联合广场A座裙楼A302
法定代表人:喻天柱
联系人:万力
电话:0755-83190388
传真:0755-82945664
网址:www.hrjijin.com
客服电话:400-600-0583
(91)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法人代表:高锋
联系人:廖苑兰
联系电话:0755-83655588
网址:www.keynesasset.com
客服电话:400-804-8688
(92)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:戚晓强
客服电话:400-061-8518
网址:https://danjuanapp.com
(93)深圳信诚基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋210室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元
法定代表人:周文
联系人:杨涛
客服电话:0755-23946579
网址:www.ecpefund.com
(94)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区金融街33号通泰大厦B座8层
办公地址:北京市西城区金融街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:李一梅
网址:www.amcfortune.com
客服电话:400-817-5666
网址:www.hazq.com
(95)深圳前海京西票号基金销售有限公司
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:深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场B座211室
法定代表人:吴永宏
联系人:盖润英
电话:0755-66607751
网址:http://a24111747atobo.com.cn
(96)奕丰金融服务(深圳)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:深圳市南山区海德三路海岸城大厦1115、1116及1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:项晶晶
电话:0755-8946 0500
传真:0755-2167 4453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(97)上海云湾投资管理有限公司
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:021-20530224
传真:021-20538999
客服电话:400-820-1515
网址:www.zhengtongfunds.com
(98)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号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊旻
联系人:徐英
电话:010-59336539
传真:010-59336500
客服电话:4008909998
网址:www.jnlc.com
(99)弘业期货股份有限公司
注册地址:南京市中华路50号弘业大厦
办公地址:南京市中华路50号弘业大厦
法定代表人:周剑秋
联系人:郭晓蓉
客服电话:400-828-1288
网址:http://www.ftol.com.cn/etrading/
(100)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:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
网址:www.520fund.com.cn
客服电话:400-821-0203
(101)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19层
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号17层05单元
法定代表人:弭洪军
联系人:黄鹏
电话:021-33355333
传真:021-63353736
客服电话:400-876-5716
网址:www.cmiwm.com
(102)万和证券股份有限公司
注册地址:海口市南沙路49号通信广场2楼
办公地址:深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西
法定代表人:朱冶理
联系人:郭东彤
电话:0755-82830333-115
传真:0755-25170807
网址:ww.wanhesec.com
(103)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文一西路969号3幢5层599室
办公地址:浙江省杭州市西湖区学院路28号德力西大厦1号楼12楼
法定代表人:祖国明
联系人:徐丽玲
客服电话:4000-766-123
网址:http://www.fund123.cn/
(104)江苏汇林保大基金销售有限公司
注册地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
办公地址:江苏省南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室
法定代表人:吴言林
电话:025-66046166转837
传真:025-56663409
联系人:孙平
客户服务热线:025-66046166
网址:www.huilinbd.com
(105)上海联泰基金销售有限公司
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:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
电话:021-52822063-8301
传真:021-62990063
客服电话:4000-466-788
网址:www.66zichan.com
(106)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
法定代表人:陈继武
联系人:高浩辉
联系电话:021-63333389
客服电话:400 643 3389
网址:https://www.vstonewealth.com/
(107)上海陆享基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路888号1幢1区14032室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇广场二座16层
法定代表人:陈志英
联系人:唐京莎
电话:021-53398816
网址:http://www.luxxfund.com/
(二)登记机构
名称:平安基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春风
电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
联系人:张平
(三)出具法律意见书的律师事务所
律师事务所:上海市通力律师事务所
地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、陈颖华
联系人:陈颖华
(四)审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
联系电话:021-23238888
传真电话:021-23238000
经办注册会计师:曹翠丽、陈怡
联系人:陈怡

§ 4基金的历史沿革与基金的存续

(一)基金的历史沿革
本基金由平安安心保本混合型证券投资基金转型而来。
平安安心保本混合型证券投资基金为契约型开放式证券投资基金,经2015年12月21日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]2997号文准予募集注册,基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。
平安安心保本混合型证券投资基金于2015年12月28日至2016年1月13日进行募集,并于2016年1月15日正式成立。平安安心保本混合型证券投资基金每个保本期为三年,第一个保本期自2016年1月15日起至2019年1月14日止。平安安心保本混合型证券投资基金第一个保本期于2019年1月14日到期,由于不符合避险策略基金存续条件,将按照《平安安心保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非避险策略的混合型基金,名称相应变更为"平安安心灵活配置混合型证券投资基金"。
平安安心保本混合型证券投资基金的保本期到期操作期间为保本期到期日及之后3个工作日(含第3个工作日),即自2019年1月14日(含)起至2019年1月17日(含)止。自2019年1月18日起,平安安心保本混合型证券投资基金正式转型为平安安心灵活配置混合型证券投资基金,转型后的《平安安心灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效,《平安安心保本混合型证券投资基金基金合同》同日失效。

(二)基金的存续
《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。
法律法规另有规定时,从其规定。

§ 5基金的名称

平安安心灵活配置混合型证券投资基金

§ 6基金的类型

混合型证券投资基金

§7基金的运作方式

契约型开放式

§8基金的投资

(一)投资目标
通过对宏观经济和股票市场、债券市场发展趋势的分析,力求把握在不同行情中可行的投资机会,追求基金资产的长期稳健增值。
(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,包括国内依法发行交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、央行票据、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单以及法律法规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。
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。
基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%,权证投资比例不高于基金资产净值的3%,在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
(三)投资策略
1、资产配置策略
本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析,结合经济周期理论,形成对不同市场周期的预测和判断,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。
本基金通过平安大类资产配置评价体系 (TAES)(PINGAN TACTICAL ASSET EVALUATION SYSTEM)系统化管理各大类资产的配置比例。平安大类资产配置评价体系(TAES)分析因素具体包括:宏观经济因素、政府政策因素、盈利因素、估值因素、流动性因素和行为因素六个方面,并将各子因素的细分指标划分为先行指标、同步指标和预警指标三类。
本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征,评估股票市场相对投资价值。在实际投资运作中,不同时期或预期的大类资产配置策略如下:
(1)预期股票市场将趋势上涨,或整体股票市场处于低估值的安全区域,本基金将通过高仓位配置股票资产,低配或者少配债券资产,以增加获取股票市场潜在收益的可能性。
(2)股票市场处于震荡阶段、方向不明确时,本基金将动态调整股票资产、债券资产比例,以波段操作策略为主。重点选择被市场低估的或因市场情绪变化而大幅下跌的行业中的优质个股进行波段操作,追求投资组合的正阿尔法收益。
(3)预期股票市场将趋势下跌,或整体股票市场处于高估值的风险区域,本基金将及时降低股票资产配置比例,最低可至股票资产最低比例。同时适度增加债券资产配置比例,严格控制投资组合风险,避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。
2、股票投资策略
采用成长与价值动态均衡投资(GVDBI)策略:在看多后市的前提下,主要从成长股票中构建基金组合,追求获得更多超额收益;反之,看空后市则主要从价值股票中构建基金组合,追求投资正回报;调整行情中,根据市场多空双方力量强弱和持续时间,采用灵活权重调整策略,平衡基金组合的风险与预期收益。
3、债券投资策略
本基金可投资的债券品种包括国债、中期票据、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券(包括分离交易的可转换债券)、债券回购、定期存款等银行存款等。综合考虑宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势,采取自上而下和自下而上结合的投资策略积极选择和配置债券资产。
本基金在具体债券组合构建时,以利率预期策略、类属资产配置和久期策略为主,以品种选择策略、收益率利差策略和债券置换策略为辅,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,构建能获取长期、稳定收益的固定收益类投资组合。
(1)利率预期策略
首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、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)类属资产配置
在类属资产配置层次,根据市场和类属资产的风险收益特征,在判断各类属的利率期限结构与交易活跃的国家信用等级短期券利率期限结构应具有的合理利差水平基础上,将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点,在此基础上运用修正的均值-方差等模型,对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。
(3)久期策略
根据对利率期限结构变化的预判,对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低可能的利率变化给组合带来的损失。具体久期目标的确定将视利率期限结构变化方向而定,例如在预计利率期限结构可能变的更加陡峭时,不久的将来长期债券的价格可能会由于长期利率的上升而下跌,短期债券的价格可能会由于短期利率的下降而上涨,因此可制定适量降低组合久期的目标,增加对短期债券的投资,同时减少对长期债券的投资。
在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资,获取超额的投资收益。
4、权证投资策略
本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值,发现市场对股票权证的非理性定价;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、资产支持证券投资策略
本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下,秉持稳健投资原则,综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得基金资产的长期稳健回报。
6、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因素、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票投资的总体规模,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。
基金管理人在进行股指期货投资前将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,以符合上述法律法规和监管要求的变化。
7、国债期货投资策略
本基金参与国债期货的投资应符合基金合同规定的投资目标。本基金以套期保值为目的,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资于国债期货合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极改善组合的风险收益特征。
本基金通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组合的久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。
本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上,将审慎地获取相应的超额收益,通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加,以及国债期货与债券的多空比例调整,获取组合的稳定收益。
基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关岗位职责。此外,基金管理人建立国债期货交易决策部门或小组,并授权特定的管理人员负责国债期货的投资审批事项。
(四)投资限制
1、组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
(1)本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
(2)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%;
(3)本基金持有一家公司发行的证券,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公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(5)基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;
(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)本基金进入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%;
(8)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(9)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%;
(10)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%;
(11)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(12)本基金管理人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,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(13)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(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;
(14)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额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;
(15)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%;
(16)本基金进入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%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;
(17)本基金投资股指期货,遵循以下中国证监会规定的投资限制:
1)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%;
2)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、资产支持证券等;
3)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货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;
4)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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定,即占基金资产的比例为0~95%;
5)本基金在任何交易日内交易(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%;
(18)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;
(19)本基金投资流通受限证券,基金管理人应根据中国证监会相关规定,与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;
(20)基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;
(21)本基金投资国债期货,遵循以下中国证监会规定的投资限制:
1)该基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;
2)该基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;
3)该基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)不低于基金资产的80%;
4)该基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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30%;
(22)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(23)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(24)法律法规、基金合同规定的其他投资比例限制。
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开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。
除上述第(1)、(13)、(22)、(23)项外,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之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,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。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。
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有关约定。期间,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转型之日起开始。
如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。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,但须提前公告,不需要经基金份额持有人大会审议。
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,但是国务院另有规定的除外;
(5)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(6)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;
法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。
(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×50% + 中证全债指数收益率×50%。
(六)风险收益特征
本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金,低于股票型基金。
(七)、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。
基金托管人中国银行股份有限公司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。
本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日,本财务数据未经审计。
1.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	71,303,316.52	32.23
	其中:股票	71,303,316.52	32.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	147,000,910.10	66.44
	其中:债券	147,000,910.10	66.44
	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	1,646,483.80	0.74
8	其他资产	1,289,184.46	0.58
9	合计	221,239,894.88	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	71,303,316.52	32.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	71,303,316.52	32.28

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。
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	002142	宁波银行	462,970	11,222,392.80	5.08
2	600000	浦发银行	900,000	10,512,000.00	4.76
3	600036	招商银行	288,000	10,362,240.00	4.69
4	601939	建设银行	1,300,000	9,672,000.00	4.38
5	601328	交通银行	1,499,981	9,179,883.72	4.16
6	601166	兴业银行	500,000	9,145,000.00	4.14
7	601288	农业银行	2,500,000	9,000,000.00	4.07
8	601818	光大银行	580,000	2,209,800.00	1.00

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	9,996,000.00	4.53
	其中:政策性金融债	9,996,000.00	4.53
4	企业债券	6,567,325.60	2.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,123,600.00	0.96
7	可转债(可交换债)	2,278,984.50	1.03
8	同业存单	126,035,000.00	57.05
9	其他	-	-
10	合计	147,000,910.10	66.55

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 |