

(上接B029版)  
法定代表人:陈林  
电话:021-68777222  
传真:021-68777222  
联系人:刘闻川  
客服电话:400-820-9898  
公司网站:www.cnhbstock.com  
(58) 财富证券有限责任公司  
住所:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层  
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层  
法定代表人:孙智勇  
电话:0731-84403319  
传真:0731-94403439  
联系人:郭磊  
客服电话:0731-84403350  
公司网站:www.ctzq.com  
(59) 华西证券有限责任公司  
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  
法定代表人:杨柳洋  
电话:028-86135091  
传真:028-86157275  
联系人:张曼  
客服电话:95684  
公司网站:www.hx168.com.cn  
(60) 方正证券股份有限公司  
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座11层  
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座11层  
法定代表人:雷杰  
电话:010-57398062  
传真:010-57398058  
联系人:徐锦福  
客服电话:95671  
公司网站:www.founders.com  
(61) 信达证券股份有限公司  
住所:北京市西城区市口大街9号院1号楼  
办公地址:北京市西城区市口大街9号院1号楼  
法定代表人:张志刚  
电话:010-63091000  
传真:010-63090978  
联系人:唐静  
客服电话:400-800-8899  
公司网站:www.cindasc.com  
(62) 宏源证券股份有限公司  
住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号  
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号  
法定代表人:冯戎  
电话:010-88085858  
传真:010-88085195  
联系人:李巍  
客服电话:4008-000-562  
公司网站:www.hysec.com  
(63) 国联证券股份有限公司  
住所:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦7-9层  
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702  
法定代表人:姚忠勇  
电话:0510-82831662  
传真:0510-8230162  
联系人:沈刚  
客服电话:95670  
公司网站:www.gslc.com.cn  
(64) 中国国际金融有限公司  
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层  
法定代表人:金立群  
电话:010-60501166  
传真:010-60508065  
联系人:罗春霞,肖婷,陈曦  
公司网站:www.cicc.com.cn  
(65) 华福证券有限责任公司  
住所:福州市五四路157号新天地大厦7,8层  
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层  
法定代表人:黄金琳  
电话:0591-87383600  
传真:0591-87383610  
联系人:徐松梅  
客服电话:96326(福建省外加拨0591)  
公司网站:www.hfzq.com.cn  
(66) 中航证券有限公司  
住所:南昌市红谷滩中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层  
办公地址:南昌市红谷滩中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层  
法定代表人:王宜四  
电话:0791-86768681  
传真:0791-86770178  
联系人:戴蕾  
客服电话:400-8866-567  
公司网站:www.avicscc.com  
(67) 华龙证券有限责任公司  
住所:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号  
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号  
法定代表人:李晓安  
电话:0931-4890208  
传真:0931-48901628  
联系人:李昕田  
客服电话:400-689-8888,0931-96668  
公司网站:www.hzqgs.com  
(68) 华融证券股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街8号  
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3层、5层  
法定代表人:祝献忠  
电话:010-58568235  
传真:010-58568284  
联系人:黄恒  
客服电话:010-58568118  
公司网站:www.hrsec.com.cn  
(69) 世纪证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层  
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层  
法定代表人:姜砾军  
电话:0755-83199511  
传真:0755-83199645  
联系人:雷新东  
客服电话:0755-83199511  
公司网站:www.csco.com.cn  
(70) 中原证券股份有限公司  
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号  
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号  
法定代表人:菅明军  
电话:0371-65858670  
传真:0371-65858665  
联系人:程月艳  
客服电话:967218,400-813-9666  
公司网站:www.cnew.com  
(71) 厦门证券有限公司  
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
法定代表人:傅毅辉  
电话:0592-51611642  
传真:0592-5161140  
联系人:赵钦  
客服电话:0592-5163588  
公司网站:www.xmzq.cn  
(72) 爱建证券有限责任公司  
住所:上海市浦东东大路1600 号陆家嘴商务广场32楼  
办公地址:上海市浦东东大路1600 号陆家嘴商务广场32楼  
法定代表人:官龙云  
电话:021-32229888  
传真:021-62878783  
联系人:戴莉丽  
客服电话:021-63340678  
公司网站:www.aijq.com  
(73) 财达证券有限责任公司  
住所:河北省石家庄桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层  
办公地址:河北省石家庄桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层  
法定代表人:翟建强  
电话:0311-66006342  
传真:0311-66006201  
联系人:马晖  
客服电话:4006128888  
公司网站:www.S10000.com  
(74) 东北证券股份有限公司  
住所:长春市自由大路1138号  
办公地址:长春市自由大路1138号  
法定代表人:杨树财  
电话:0431-85096511  
传真:0431-85096795  
联系人:安岩岩  
客服电话:400-600-0686  
公司网站:www.nesc.com  
(75) 日信证券有限责任公司  
住所:呼和浩特市新城区锡林南路18号  
办公地址:北京市东城区闹市口大街1号长安兴融大厦11层  
法定代表人:孔佐杰  
电话:010-83991716  
传真:010-88086637  
联系人:陈文彬  
客服电话:400-660-9839  
公司网站:www.rxzq.com.cn  
(76) 民生证券有限责任公司  
住所:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层  
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层  
法定代表人:余政  
电话:010-85127999  
传真:010-85127917  
联系人:赵明  
客户服务电话:400-619-8888  
网址:www.wmszq.com  
(77) 东吴证券股份有限公司  
住所:苏州工业园区星阳街5号  
办公地址:苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦  
法定代表人:范力  
电话:0512-65588113  
传真:0512-65588021  
联系人:方晓丹

客户服务电话:4008-601-555  
网址:www.dwdz.com.cn  
(78) 国海证券股份有限公司  
住所:广西桂林市辅星路13号  
办公地址:深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦11楼  
法定代表人:张雅锋  
电话:0755-82047857  
传真:0755-82235785  
联系人:陈炽华  
客户服务电话:95663  
网址:www.hgzc.com.cn  
(79) 联讯证券有限责任公司  
住所:广东省惠州市惠城区江北三江路惠州广播电视台新闻中心三、四楼  
办公地址:广东省惠州市惠城区江北三江路惠州广播电视台新闻中心三、四楼  
法定代表人:徐刚  
电话:0752-21193971  
传真:0752-2119396  
联系人:郭鹏  
客户服务电话:95664  
(80) 华鑫证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01 (b) 单元  
办公地址:上海市肇嘉浜路750号  
法定代表人:俞洋  
电话:021-64339000  
传真:021-6433905  
联系人:陈敏  
客户服务电话:021-32109999;029-68918888  
公司网站:www.cfsc.com.cn  
(81) 浙商证券股份有限公司  
住所:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座  
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座  
法定代表人:吴承根  
电话:021-64310572  
传真:021-64173798  
联系人:陆云  
客户服务电话:0571-967777  
公司网站:www.stocke.com.cn  
(82) 天相投资顾问有限公司  
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701  
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505  
法定代表人:林义相  
联系电话:010-66045152  
传真:010-6604518  
联系人:尹伶  
客户服务电话:010-66045678  
天相投顾网址: http://www.txsec.com  
天相基金网网址: www.jjm.com.cn  
(83) 深圳众禄基金销售有限公司  
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦I,J单元  
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦I,J单元  
法定代表人:薛峰  
电话:0755-53227950  
传真:0755-62080798  
联系人:童彩平  
客户服务电话:4006-788-887  
网址:www.zlfund.cn&www.jjmwm.com  
(84) 上海好买基金销售有限公司  
住所: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  
电话:021-20613996  
传真:021-68596916  
联系人:张茹  
客户服务电话:400-700-9665  
网址:www.ehowbuy.com  
(85) 上海长量基金销售投资顾问有限公司  
住所:上海市浦东新区高科路526号2幢220室  
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层  
法定代表人:张跃伟  
电话:021-20691832  
传真:021-20691867  
联系人:单炳烨  
客户服务电话:400-089-1289  
网址:www.erichfund.com  
(86) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
住所:上海市金山区廊下镇漕港公路7650号205室  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴金融城中路68号时代金融中心8楼01  
法定代表人:汪静波  
电话:021-38602377  
传真:021-38509777  
联系人:方成  
客户服务电话:400-821-5399  
网址:www.noah-fund.com  
(87) 杭州数米基金销售有限公司  
住所:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室  
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈柏青  
电话:021-60887840  
传真:0571-26697013  
联系人:张裕  
客户服务电话:4000-766-123  
公司网站:marketfund123.cn  
(88) 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号楼二层  
办公地址:上海市龙田路195号3C座7楼  
法定代表人:王宜四  
电话:0931-87383600  
传真:0931-87383610  
联系人:徐松梅  
客服电话:96326(福建省外加拨0591)  
公司网站:www.hfzq.com.cn  
(66) 中航证券有限公司  
住所:南昌市红谷滩中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层  
办公地址:南昌市红谷滩中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层  
法定代表人:王宜四  
电话:0791-86768681  
传真:0791-86770178  
联系人:戴蕾  
客服电话:400-8866-567  
公司网站:www.avicscc.com  
(67) 华龙证券有限责任公司  
住所:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号  
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号  
法定代表人:李晓安  
电话:0591-87383600  
传真:0591-87383610  
联系人:李昕田  
客服电话:400-689-8888,0931-96668  
公司网站:www.hzqgs.com  
(68) 华融证券股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街8号  
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3层、5层  
法定代表人:祝献忠  
电话:010-58568235  
传真:010-58568284  
联系人:黄恒  
客服电话:010-58568118  
公司网站:www.hrsec.com.cn  
(69) 世纪证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层  
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层  
法定代表人:姜砾军  
电话:0755-83199511  
传真:0755-83199645  
联系人:雷新东  
客服电话:0755-83199511  
公司网站:www.csco.com.cn  
(70) 中原证券股份有限公司  
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号  
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号  
法定代表人:菅明军  
电话:0371-65858670  
传真:0371-65858665  
联系人:程月艳  
客服电话:967218,400-813-9666  
公司网站:www.cnew.com  
(71) 厦门证券有限公司  
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
法定代表人:傅毅辉  
电话:0592-51611642  
传真:0592-5161140  
联系人:赵钦  
客服电话:0592-5163588  
公司网站:www.xmzq.cn  
(72) 爱建证券有限责任公司  
住所:上海市浦东东大路1600 号陆家嘴商务广场32楼  
办公地址:上海市浦东东大路1600 号陆家嘴商务广场32楼  
法定代表人:官龙云  
电话:021-32229888  
传真:021-62878783  
联系人:戴莉丽  
客服电话:021-63340678  
公司网站:www.aijq.com  
(73) 财达证券有限责任公司  
住所:河北省石家庄桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层  
办公地址:河北省石家庄桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层  
法定代表人:翟建强  
电话:0311-66006342  
传真:0311-66006201  
联系人:马晖  
客服电话:4006128888  
公司网站:www.S10000.com  
(74) 东北证券股份有限公司  
住所:长春市自由大路1138号  
办公地址:长春市自由大路1138号  
法定代表人:杨树财  
电话:0431-85096511  
传真:0431-85096795  
联系人:安岩岩  
客服电话:400-600-0686  
公司网站:www.nesc.com  
(75) 日信证券有限责任公司  
住所:呼和浩特市新城区锡林南路18号  
办公地址:北京市东城区闹市口大街1号长安兴融大厦11层  
法定代表人:孔佐杰  
电话:010-83991716  
传真:010-88086637  
联系人:陈文彬  
客服电话:400-660-9839  
公司网站:www.rxzq.com.cn  
(76) 民生证券有限责任公司  
住所:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层  
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层  
法定代表人:余政  
电话:010-85127999  
传真:010-85127917  
联系人:赵明  
客户服务电话:400-619-8888  
网址:www.wmszq.com  
(77) 东吴证券股份有限公司  
住所:苏州工业园区星阳街5号  
办公地址:苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦  
法定代表人:范力  
电话:0512-65588113  
传真:0512-65588021  
联系人:方晓丹

换债券)为主要投资对象,以稳健收益型股票为辅助投资对象。债券投资不少于基金资产净值的40%,持仓比例相对范围是40—95%,股票投资的最大比例不超过40%,持仓比例相对范围是0—40%,除了预期有利的趋势市场外,原则是股票投资比例控制在20%以内。

#### 八、基金的投资策略

(一)本基金投资策略包括以下四个方面:

1.采取自上而下的投资分析方法,根据国内外经济形势,在经济景气观测的基础上,综合分析真实经济因素、物价水平变化趋势、货币政策趋势、货币市场与财政政策的关系,研判市场投资环境的变化趋势,给资产配置决策提供指导。作为债券型基金,本基金重点关注利率走势对收益率的影响,根据未来利率变化趋势和证券市场环境变化趋势,主动调整债券资产配置及其投资比例。

2.根据收益率、流动性与风险匹配原则以及证券的低估值原则建构投资组合,合理配置不同市场和不同投资标的资产比例,并根据投资环境的变化相匹配调整。具体包括:

(1)根据交易所国债、交易所企业债和银行间国债收益率的到期收益率变化、流动性变化和市场规模情况,在控制市场风险和流动性风险的基础上,相机调整不同市场的投资比例。

(2)根据未来利率变化预期,以久期、凸性和利差监测为重心,合理配置短期、中期与长期投资品种结构,控制利率风险,把握不同券种的套利机会,对未来利率走势进行预期,做了长期与凸性管理外,本基金还将合理配置固定利率债券与浮动利率债券的比例。

3.择机适当利用债券回购工具、无风险套利和参与一级市场承销或申购等手段,规避利率风险,增加盈利机会。

4.权证投资策略:

(1)考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值。

(2)根据权证合理价值与其市场价格的价差幅度“估价差价( Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。

(3)根据本基金的风险收益特征,确定本基金投资权证的具体比例。

5.将在衍生工具市场得到发展的情况下,本基金将使用衍生产品市场,控制风险,并把握获利机会。

#### (二)投资决策

##### 1.决策依据

(1)国家有关法律、法规和基本合同的有关规定;

(2)国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究;

(3)投资对象收益和风险的匹配关系,本基金将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

#### 2.投资决策与操作程序

根据投资管理原则,本基金采取投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策与操作流程包括投资研究流程、投资对象筛选、确定、资产配置与重大投资项目提案的形成、投资决策的形成与执行程序、投资组合跟踪与反馈及核对与监督评估。

(1)投资决策委员会通过定期和不定期的会议,对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势进行综合分析,制定本基金管理基金投资组合的资产配置比例等重大决策。

(2)研究部根据自身研究成果,出具宏观经济分析报告、投资策略、债券分析、行业分析和上市公司研究等各类报告和投资建议,为投资决策委员会提供决策依据。

(3)基金经理在遵守投资决策委员会制定的制度和投资原则的前提下,根据研究部提供的投资建议,其它应变措施和自己的分析判断,做出具体的投资决策,构建投资组合。

(4)合规与风险管理委员会定期召开会议,对基金经理组合进行绩效和风险评估,并提出风险管理意见。

(5)基金经理有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

#### 3.权证投资的风险控制措施

(1)本基金管理人对各基金的权证投资实行严格的授权管理制度。各基金对权证的投资,必须在相应的授权范围内操作。超出基金授权权限范围的决策,必须分别经投资总监、分管投资的副总经理或投资决策委员会批准后,才能执行。

(2)在本基金管理人和基金托管人管理过程中,设置有关权证投资交易阀值,确保基金的权证投资符合各项比例限制和授权制度。

(3)原则上,各相关基金不得投资于300万股以上的公司发行的权证和注册资本以外的公司发行的权证,必须报本基金管理人和投资基金委员会审核批准。

(4)交割部负责具体的交易执行,履行一线监控的职责,监控内容包括但不限于权证投资比例要求、投资权限等。