

（上接B029版）

		注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 联系人:李勇 联系电话:0769-22115712 传真:0769-22115712 公司网站:www.dgjs.com.cn
33	东莞证券股份有限公司	
		注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址:天津市滨海新区东兴道8号 法定代表人:杜庆平 联系人:胡天彤 电话:022-28481709 传真:022-28481892 客服电话:400-651-5888 网址:www.bjzq.com
34	渤海证券股份有限公司	
		注册地址:深圳市福田区金田路4号中洲国际交易广场408 办公地址:深圳市福田区金田路4号中洲国际交易广场408 联系人:杨雪梅 联系人:郑海阳 联系电话:0755-22626391 客服电话:0551-1-8 公司网站:www.pingan.com
35	平安证券股份有限公司	
		注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华证券大厦10层 办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华证券大厦10层 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-84183311-3389 传真:400-818-8118 网址:www.panda.com.cn
36	国都证券股份有限公司	
		注册地址: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 法定代表人:周力 联系人:卢晓平 电话:0512-65880121 传真:0512-65880122 客服电话:400801555 网址: http://www.dgqj.com.cn/
37	东吴证券股份有限公司	
		注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔20楼 办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔20楼 联系人:周二波 联系人:林洁瑶 联系电话:020-88836999 客服电话:020-961303 公司网站:www.gdsc.com.cn
38	广州证券股份有限公司	
		注册地址:深圳福田区民田路178号华融大厦54楼 办公地址:深圳福田区民田路178号华融大厦54楼 法定代表人:唐永华 联系人:王叶平 联系电话:0755-82707705 客服电话:400-880-2888 公司网站:www.chinulian.com
39	华林证券股份有限公司	
		注册地址:江苏省南京市大钟寺8号 办公地址:江苏省南京市大钟寺8号 法定代表人:李国平 联系人:李国平 联系电话:025-8334032 公司网站:www.djqj.com.cn
40	南京证券股份有限公司	
		注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号安徽中心B1座 法定代表人:李工 联系人:李工 联系电话:0551-65161821 客服电话:96318,400866518 公司网站:www.haizq.com
41	华安证券股份有限公司	
		注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号虹达大厦9楼 办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号虹达大厦9楼 法定代表人:范卫林 联系人:范卫林 联系电话:0871-63577946 公司网站: http://www.kunlunqz.com/
42	红塔证券股份有限公司	
		注册地址:深圳市南山区竹子林四路海竹七道18号光大银行大厦18楼 办公地址:深圳市福田竹子林四路海竹七道18号光大银行大厦18楼 法定代表人:潘冰 联系人:潘冰 联系电话:0755-83766665 客服电话:4008-505-505 公司网站:www.rjqj.com
43	银泰证券股份有限公司	
		办公地址:杭州杭大路15号聚银世纪广场A6-7楼 法定代表人:梁永刚 联系人:梁永刚 联系电话:0571-22638750 公司网站:www.fund-zq.com.cn
44	浙商证券股份有限公司	
		注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心47楼 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心47楼 法定代表人:陈卫 联系人:陈卫 联系电话:021-68778005 客服电话:400820988 公司网站:www.cnhbstock.com
45	华宝证券股份有限公司	
		注册地址:山西省太原市市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 办公地址:山西省太原市市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人:侯晓岩 联系人:侯晓岩 联系电话:0351-8666699 客服电话:400-666-1618,95573 公司网站:www.bjzq.com.cn
46	山西证券股份有限公司	
		注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 法定代表人:刘月华 联系人:刘月华 联系电话:0755-22638750 公司网站:www.fund-zq.com.cn
47	第一创业证券股份有限公司	
		注册地址: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、8层 法定代表人:洪永贵 联系人:洪永贵 联系电话:0591-87836000 传真:0591-87836010 客服电话:96328(电话卡请先拨0991) 网址: www.fundzq.com.cn
48	华鑫证券有限责任公司	
		注册地址:重庆市江北桥北路2号 办公地址:重庆市江北桥北路2号 法定代表人:李健 联系人:李健 电话:023-67666333 传真:023-67666212 客服电话:4008-096-096 网址: www.hxsc.com.cn
49	中山证券有限责任公司	
		注册地址:陕西省西安市西大街35号陕西证券大厦23层 办公地址:陕西省西安市西大街35号陕西证券大厦23层 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:029-8662138 传真:029-8662138 客服电话:4008888055 网址: www.cpsc.com
50	国海证券股份有限公司	
		注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
51	中原证券股份有限公司	
		注册地址:郑州市郑东新区CBD商务外环路10号 办公地址:郑州市郑东新区CBD商务外环路10号 法定代表人:程广军 联系人:程广军 电话:0371-6585670 客服电话:0371-967218,4008139666 公司网站: www.cncw.com
52	西南证券股份有限公司	
		注册地址:重庆市江北桥北路2号 办公地址:重庆市江北桥北路2号 法定代表人:李健 联系人:李健 电话:023-67666333 传真:023-67666212 客服电话:4008-096-096 网址: www.hxsc.com.cn
53	财达证券股份有限公司	
		注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23层26室 办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23层26室 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0311-66066342 客服电话:4001-28088 公司网站: www.s10000.com
54	德邦证券股份有限公司	
		注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南华明珠大厦22楼 办公地址:上海市普陀区曹杨路510号南华明珠大厦22楼 法定代表人:沈文平 联系人:沈文平 联系电话:021-68761616 传真:021-68761032 客服电话:400888128 网址: www.tdbon.com.cn
55	中银证券有限公司	
		注册地址:南昌市长红路16号中银大厦1619号国际金融中心A座14楼 办公地址:南昌市长红路16号中银大厦1619号国际金融中心A座14楼 法定代表人:王立国 联系人:王立国 电话:0791-86708881 传真:0791-86708881 客服电话:400-886-567 网址: http://www.zcyw.com/
56	国元证券股份有限公司	
		注册地址:安徽省合肥市寿春路179号 办公地址:安徽省合肥市寿春路179号 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0551-2634400 客服电话:400888128 网址: www.guoyuan.com.cn
57	国盛证券有限责任公司	
		注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融中心A座11楼 办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融中心A座11楼 法定代表人:曾小春 联系人:曾小春 联系电话:0791-8381305 公司网站: www.guosen.com
58	中国国际金融有限公司	
		注册地址:天津市城区道前街15号中法大21层 办公地址:天津市城区道前街15号中法大21层 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:022-58311111 传真:022-58311111 客服电话:4007121212 网址: http://www.dhbc.com.cn
59	大同证券经纪有限责任公司	
		注册地址:大同市城区道前街15号中法大21层 办公地址:大同市城区道前街15号中法大21层 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0351-4130322 传真:0351-4130322 客服电话:4007121212 网址: http://www.dhbc.com.cn
60	财富证券股份有限公司	
		注册地址:杭州钱江新城国际金融中心1402室 办公地址:杭州钱江新城国际金融中心1402室 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0571-87836000 客服电话:400820988 公司网站: www.csc.com.cn

41	东海证券股份有限公司	注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场10楼 办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0551-400-888-8888 公司网站: www.donghai.com.cn
62	西部证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层 办公地址:陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层 法定代表人:刘建武 联系人:刘建武 电话:029-87461688 传真:029-87461710 客服电话:4006-773-772 网址: http://www.westsecu.com/
63	新时代证券股份有限公司	注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 联系人:刘建武 联系电话:010-83561149 客服电话:400-0898988 公司网站: www.xdsj.com
64	瑞信证券有限责任公司	注册地址:北京市西城区金融大街7号北京国际金融中心12层15层 办公地址:北京市西城区金融大街7号北京国际金融中心12层15层 法定代表人:程广军 联系人:程广军 电话:010-84183311-3389 传真:400-818-8118 网址: www.panda.com.cn
65	万联证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层 办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层 法定代表人:张建军 联系人:张建军 电话:020-3860651 客服电话:400-888-1333 公司网站: www.wlj.com
66	国金证券股份有限公司	注册地址:成都市东城根上街95号 办公地址:成都市东城根上街95号 法定代表人:冉云 联系人:冉云 电话:028-86660706 传真:028-86660126 客服电话:400-6010109 网址: www.gqzq.com.cn
68	恒泰证券股份有限公司	注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华大街111号 办公地址:呼和浩特市新城区新华大街111号 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0931-4890208 联系人:李海荣 电话:0931-4890208 客服电话:4006-89-8888,0931-9668 公司网站: www.hhtz.com
69	华龙证券有限责任公司	注册地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦A座 办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦A座 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0931-4890208 联系人:李海荣 电话:0931-4890208 客服电话:4006-89-8888,0931-9668 公司网站: www.haizq.com
70	华鑫证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区金田路4088号安联大厦28层A01、B01(1)单元 办公地址:深圳市福田区金田路4088号安联大厦28层A01、B01(1)单元 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0755-82887888 传真:0755-82883408 客服电话:021-32109999,029-68918888,4001099918 网址: www.cfsc.com.cn
71	日信证券有限责任公司	注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区南大街18号 办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区南大街18号 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0471-3991807 联系人:李海荣 电话:0471-3991807 客服电话:4008-169-169 网址: www.daxin.com.cn
72	中天证券股份有限公司	注册地址:沈阳市和平区南京路121号方源国际金融中心中天证券经纪营业部 办公地址:沈阳市和平区南京路121号方源国际金融中心中天证券经纪营业部 法定代表人:马海龙 联系人:马海龙 电话:024-23280842 客服电话:4006180135 公司网站: www.ztc.com.cn
73	大通证券股份有限公司	注册地址:辽宁省大连市开发区金湾12号大连国际金融中心A座-A-26号大厦30层 办公地址:辽宁省大连市开发区金湾12号大连国际金融中心A座-A-26号大厦30层 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0411-3991807 联系人:李海荣 电话:0411-3991807 客服电话:4008-169-169 网址: www.daxin.com.cn
74	天相投资顾问有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街19号富国大厦B座701 办公地址:北京市西城区金融大街19号富国大厦B座701 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
75	联讯证券股份有限公司	注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 法定代表人:刘月华 联系人:刘月华 电话:0755-22638750 公司网站: www.fund-zq.com.cn
76	东兴证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦12层15层 办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦12层15层 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
77	开泰证券有限责任公司	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:李海荣 联系人:李海荣 电话:029-6862138 传真:029-6862138 客服电话:4008888055 网址: www.cpsc.com
78	中邮证券有限责任公司	注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
79	中国民族证券有限责任公司	注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
80	太平洋证券股份有限公司	注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2141号 办公地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2141号 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:021-68761616 传真:021-68761032 客服电话:400888128 网址: www.tdbon.com.cn
81	诺亚正行(上海)基金销售有限公司	注册地址: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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:021-38670777 客服电话:400-821-5399 网址: www.noah-fund.com
82	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单元 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0755-83217650 客服电话:4006-665-9999 网址: www.zlcf.com
83	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2141号 办公地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2141号 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:021-68761616 传真:021-68761032 客服电话:400888128 网址: www.tdbon.com.cn
84	杭州数米基金销售有限公司	注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1410室 办公地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1410室 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0571-28829790,021-60897869 传真:0571-26083133 客服电话:400-766-1233 网址: http://www.fund123.com
85	上海长晟基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路524号220室 办公地址:上海市浦东新区高翔路524号220室 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:021-38670777 客服电话:400-821-5399 网址: www.noah-fund.com
86	上海天天基金销售有限公司	注册地址: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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:021-38670777 客服电话:400-821-5399 网址: www.noah-fund.com

87	北京展恒基金销售有限公司	注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-62020888 传真:010-62020888 客服电话:4008886661 网址: www.myfund.com
88	浙江网际基金销售有限公司	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:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0571-88911818-8653 传真:0571-88911818-8653 客服电话:4008-773-772 网址: www.zjw.com
89	中融资产管理有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号11层1103号 办公地址:北京市朝阳区光华路14号11层1103号 联系人:李海荣 联系电话:010-65807864 客服电话:010-65807864 公司网站: http://www.zrwm.com
90	万盟财富(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9号楼15层1809 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-58320955 客服电话:400-888-1333 公司网站: www.wm.com.cn
91	和讯信息科技有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街7号北京国际金融中心12层15层 办公地址:北京市西城区金融大街7号北京国际金融中心12层15层 法定代表人:程广军 联系人:程广军 电话:010-84183311-3389 传真:400-818-8118 网址: www.panda.com.cn
92	宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	注册地址:北京市东城区建国路88号SOHO现代城C座1809 办公地址:北京市东城区建国路88号SOHO现代城C座1809 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-58320955 客服电话:400-888-1333 公司网站: www.yixinfund.com
93	浙江金诚财富管理有限公司	注册地址:杭州市拱墅区登云路43号金诚财富大厦10楼 办公地址:杭州市拱墅区登云路43号金诚财富大厦10楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0571-88337734 传真:0571-88337734 客服电话:400-068-0058 网址: www.jincheng-fund.com
94	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建设路9号高地中心1101室 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:028-82009966-805 客服电话:400-8388888 网址: www.fund123.com
95	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9楼B46楼1009-1010单元 办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号9楼B46楼1009-1010单元 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:021-32109999,029-68918888,4001099918 网址: www.cfsc.com.cn
96	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1006F 办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006F 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0755-82887888 传真:0755-82883408 客服电话:021-32109999,029-68918888,4001099918 网址: www.cfsc.com.cn
97	北京国际深泽基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市东城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
98	北京钱景财富投资管理有限公司	注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
99	深圳宜信基金销售有限公司	注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园二期206号武汉大学深圳产学研大楼B15层(人教深圳前海商务秘书有限公司) 办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园二期206号武汉大学深圳产学研大楼B15层(人教深圳前海商务秘书有限公司) 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:0755-82887888 传真:0755-82883408 客服电话:021-32109999,029-68918888,4001099918 网址: www.cfsc.com.cn
100	深圳前海汇联基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
101	中国国际贸易有限公司	注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
102	北京创金恒信投资管理有限公司	注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
103	海银基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 办公地址:北京市西城区月坛南街1号院2号楼 法定代表人:李海荣 联系人:李海荣 电话:010-66551366 传真:010-66551366 客服电话:400888993 网址: www.dhqz.net
104	其他基金代销机构详见基金管理人发布的相关公告	

(二) 注册登记机关
南方基金销售有限公司
住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层楼
法定代表人:吴万善
电话:(0755) 82763849
传真:(0755) 82763854
联系人:吉和鹏
(三) 担保人
中国投融资担保有限公司
注册地址:深圳市福田区三环路100号金田大厦10楼9层
办公地址:深圳市福田区三环路100号金田大厦10楼9层
法定代表人:刘新来
电话:010-88222720
联系人:李明斌
(四) 律师事务所和经办律师
广东华商律师事务所
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼C10室
负责人:李兆良
电话:(0755) 82687860
传真:(0755) 82687861
经办律师:杨志、戴晓梅
(五) 会计师事务所和经办注册会计师
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
执行事务合伙人:杨绍信
联系人:陈燕
电话:021-23238888
传真:021-23238888
经办会计师:薛敏、陈燕
六、基金的投资目标
本基金在严格控制风险的前提下,为投资者提供本金增值的保证,并在此基础上力争基金资产的稳定增值。
七、基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的各类债券、股票以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,按照投资组合保险机制对债券和股票的投资比例进行动态调整。其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的95%。
本基金可投资于股指期货等金融衍生工具,有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
八、基金的投资策略
本基金采用恒定比例投资组合保险方法(Constant-Proportion Portfolio Insurance,CPPI)来实现保本和增值的目标。恒定比例投资组合保险不仅能从投资组合资产配置的水平上消除投资新时基金净值低于本金的可能性,而且能在一定程度上使保本基金分享股市整体性上涨的好处。
CPPI是国际通行的一种投资组合保险策略,它主要是通过数量分析,根据市场的波动来调整,修正风险资产的可放大倍数(风险乘数),以确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,从而达到对投资组合保值增值的目的。无风险资产一般是固定收益类资产,风险资产一般是股票等权益类资产。在基金资产可放大倍数的管理上,基金管理人根据投资组合在定量分析的基础上,根据CPPI数理机制,历史模拟和目前市场状况制定出具体的资产配置建议报告,给出放大倍数的合理上限的建议,供基金管理人投资决策委员会和基金经理作为基金资产配置参考。
如在基金存续期内市场出现如股指期货等新金融衍生产品且在开放式基金许可的投资范围之内,本基金管理人保留调整保本投资策略的权利。
本基金的投资策略分资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股指期货投资策略等。
1. 资产配置策略
本基金资产配置策略分为两个层次:一层为对风险资产和无风险资产的配置,该层次以恒定比例组合保险策略为依据,即风险资产部分所能承受的损失不能超过无风险资产部分所产生的收益;另一层为对风险资产部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。
2. 股票投资策略
本基金注重对股市趋势的研究,在股票投资限额之下,发挥时机选择能力,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、风险第一的原则,以低风险性、在保本期限内具备中期上涨潜力为主要原则,构建股票组合,同时兼顾股票的流动性。首先按照风险性由高至低、中期上涨潜力由高至低和流动性由高至低对股票池内的股票进行排名,叠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。
3. 债券投资策略
本基金选择债券投资策略主要依据以下原则:
(1) 持有与相当数量剩余期限与避险周期相近的国债、金融债,其中一部分严格遵循持有到期原则,首要考虑收益性,另一部分兼顾收益性和流动性。这部分投资可以保证债券组合收益的稳定性,尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。
(2) 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国债、金融债、信用等级为AAA以上的企业债,以及中长期回购等。积极投资策略主要依据期限利率预测调整组合久期,选择低估值优质股票,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、控制风险等,以争取获得适当的超额收益,提高整体组合收益率。
(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。
4. 权证投资策略
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,并积极利用权证与股票之间的不同组合来套取无风险收益。
5. 股指期货投资策略
如在本基金存续期内市场出现如股指期货等新金融衍生产品且在开放式基金许可的投资范围之内,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的品种合约。
6. 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:3年期银行定期存款税后收益率。
七、基金的风险收益特征
本基金为保本基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
八、基金的投资组合报告(未经审计)
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。
基金过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作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2014年9月30日(未经审计)。
(一) 报告期末按基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	294,079,398.11	14.02
其中:股票		294,079,398.11	14.02
2	固定收益投资	1,492,048,650.20	75.71
其中:债券		1,492,048,650.20	75.71
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	132,800,000.00	6.74
6	其他投资	9,699,436.11	0.49
7	其他资产	42,204,115.72	2.04
8	合计	1,970,831,609.14	100.00

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	2,547,500.00	0.13
C	制造业	123,455,640.14	6.33
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	10,178,441.46	0.56
E	建筑业	14,910,073.73	0.74
F	批发和零售业	15,109,930.96	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	26,764,810.64	1.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,418,372.66	0.86
J	金融业	67,119,100.40	3.31
K	房地产业	2,355,600.00	0.12
L	租赁和商务服务业	2,410,000.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,390,338.40	0.49
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	4,139,590.72	0.22
S	综合	294,079,398.11	15.39

(三) 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组合明细

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	601006	大秦铁路			