

(上接B077版)

法定代表人:孔佑杰
电话:010-8809830-730,010-8809830-737
传真:010-66412657
联系人:孙晓扬
网址:www.jzcp.com.cn
客户服务电话:010-8809830
(99)江海证券有限公司
住所:江苏省南京市鼓楼区金陵水6号
办公地址:江苏省南京市鼓楼区金陵水6号
法定代表人:孙晓扬
电话:025-58133719
传真:025-58133711
联系人:刘勇
网址:www.jzcp.com.cn
客户服务电话:400-666-2288
(100)国金证券股份有限公司
住所:四川省成都市青羊区东城根上街95号
办公地址:成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86690070
传真:028-86690126
联系人:刘一农
网址:www.gjzq.com
客户服务电话:400-1051111(四川地区),400-660-0109(全国)
(101)中国民族证券有限公司
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人:赵晓东
电话:010-58365941
传真:010-69953791
联系人:李微
网址:www.mzzq.com.cn
客户服务电话:400-889-6618
(102)华泰证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区环山路165号27楼
办公地址:上海市浦东新区环山路165号27楼
法定代表人:陈俊
电话:021-63022287
传真:021-63022298
联系人:徐万华
网址:www.hczq.com
客户服务电话:400-920-0988
(103)长城证券有限公司
住所:福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
办公地址:福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
法定代表人:王勇
电话:0592-5161642,15880287470
传真:0592-5161640
联系人:卢金文
网址:www.xmzq.net
客户服务电话:0592-5163588
(104)爱迪生证券投资有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人:姚伟
电话:021-32288763
传真:021-62878783
联系人:戴莉娟
网址:www.edis.com
客户服务电话:021-63404078
(105)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区月坛北街26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:祝承华
电话:010-58662255
传真:010-58660062
联系人:黄真
网址:www.hfzq.com.cn
客户服务电话:010-58681118
(106)天风证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
电话:027-87611882
传真:027-87618863
联系人:瞿琨
网址:www.tfcg.com
客户服务电话:029-96711410-027-87618882
(107)宏信证券有限责任公司
住所:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人:吴立明
电话:028-68020278
传真:028-80190382
联系人:侯俊杰
网址:www.hxzq.com
客户服务电话:040-836-6366
3.场内代销机构
投资者可以通过具有“上海证券基金”业务资格的证券公司办理申购业务。
具体办理规则及程序请遵循有关法律法规,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时向相关机构咨询。

四、基金的名称

本基金名称:华夏平稳增长混合型证券投资基金。

本基金类型:契约型开放式。

六、基金的投资目标

本基金的投资目标:在运用TPP组合保险策略进行风险预判管理的基础上,通过实施主动资产配置,精选优质投资,金融行业工具投资等多种积极投资策略,追求基金资产的持续、稳健增长。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围:限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、权证、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融产品。

其中,本基金投资股票比例范围为90%~95%,权证投资比例范围为0%~3%;债券投资比例范围为0%~95%,货币市场工具投资比例范围为0%~20%;现金以及到期日在一年以内的定期存款、国债、中央银行票据、短期融资券等货币市场工具的比例不高于基金资产净值的5%。

此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将该类资产纳入本基金的投资范围。

基金管理人可以调整或者变更基金投资范围和投资比例限制,但需根据有关规定履行相关手续。

八、基金的投资策略

1.本基金将主要对宏观经济、政策、证券市场估值/估价的综合分析,主动判断市场时机,进而进行资产的配置。

2.本基金将运用TPP策略(时间不变性投资组合保险策略),对股票资产配置的风险进行监控。

TPP策略的基本公式如下:

$$\text{资产配置比例} = \frac{\text{预期收益率}}{\text{预期波动率}} \times \text{权重}$$

其中,表示投资于股票资产的上限,M表示风险乘数;A表示投资组合的资产净值,F表示安全边际系数,A-F即表示承受风险的净值。

TPP策略是指数,期间根据投资者对风险和回报的要求设定风险控制水平(A),此后的安全部位(F)不时间隔,而是随着投资组合因子(A)的变动而调整,在投资组合合价上涨时,F将锁定部位收益,在投资组合因子下跌时,不保证锁定安全。

本基金在实际操作中将通过A和C的设定,将股票投资比例上限的参考值,在不同阶段进行调整和积极资产配置决策,追求在严格控制下行风险的基础上,在不同市场环境下获得收益。

九、基金的投资限制

本基金以价值投资为基本理念,追求具有成长性、可持续增长潜力的股票,同时结合价值水平和市场价格分析,通过合理安排资产价格和佳买时机,从而在控制风险的前提下实现超额收益的回报。

本基金在实际操作中将通过A和C的设定,将股票投资比例上限的参考值,在不同阶段进行调整和积极资产配置决策,追求在严格控制下行风险的基础上,在不同市场环境下获得收益。

十、基金的投资禁止行为

本基金将禁止从事以下投资行为:

1.违反法律、法规和中国证监会禁止基金投资的其他金融产品。

2.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,但是基金管理人管理的其他基金除外。

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.依照有关法律法规,中国证监会和基金合同禁止从事的其他活动。

7.法律法规或中国证监会禁止基金投资的其他行为。

十一、基金的估值方法

本基金的估值方法与股票相同。

基金持有的权证、股指期货等其他金融工具的估值方法由基金管理人根据实际情况确定。

基金持有的资产支持证券的估值方法由基金管理人根据实际情况确定。

基金持有的企业债的估值方法由基金管理人根据实际情况确定。

基金持有的可转换债券的估值方法由基金管理人根据实际情况确定。

基金持有的资产支持证券的估值方法由基金管理人根据实际情况确定。

基金持有的资产支持证券的估值方法由基金管理人