

# 信息披露

# disclosure

## （上接B063版）

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广场1号楼20层（266061）  
 办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广场1号楼20层（266061）  
 法定代表人：龚德雄  
 联系人：张祺  
 客户服务电话：（021）962518、4008918918（全国热线）  
 公司网站：www.962518.com  
 96）申万宏源证券有限公司  
 申万宏源证券有限公司  
 注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层  
 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）  
 法定代表人：李梅  
 电话：021-33389888  
 传真：021-33388224  
 客服电话：95523或4008895523  
 国际互联网网址：www.swhys.com  
 联系人：董莹  
 96）世纪证券有限责任公司  
 注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层  
 办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层  
 法定代表人：卢长才  
 联系人：袁媛  
 电话：0755-83199511  
 传真：0755-83199545  
 网站：www.csco.com.cn  
 客服热线：0755-83199511  
 97）首创证券有限责任公司  
 前首信证券有限责任公司  
 地址：北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座  
 邮编：100088  
 电话：010-59366000  
 传真：010-59366281  
 客户服务/投诉热线：400 620 0620  
 客户服务/投诉邮箱：tousu@sczq.com.cn  
 网站：www.sczq.com.cn  
 98）太平洋证券股份有限公司  
 注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层  
 公司地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层  
 法定代表人：林小明  
 客服电话：400-695-0999  
 公司电话：0871-68885858-8191 传真：0871-68889100  
 太平洋证券网站：www.tpyz.com  
 99）天风证券股份有限公司  
 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼  
 办公地址：湖北省武汉市江汉区唐家墩路32号国贸大厦B座4楼  
 邮编：430016  
 联系电话：（027）87618889 及 传真：（027）87618863  
 100）天津证券经纪有限公司  
 注册地址：西宁市城中区西大街112号  
 办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼  
 法定代表人：林小明  
 电 话：0756-33331188  
 传 真：0756-33329615  
 101）万联证券有限责任公司  
 注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋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栋18、19层  
 法定代表人：张建军  
 咨询电话：400-8888-133  
 接收传真：020-2237318-1013  
 联系人：王鑫  
 邮箱：wangxin@wlzq.com.cn  
 102）方正证券有限公司  
 注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层  
 办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室40层  
 法定代表人：张永衡  
 电 话：0756-82545555  
 公司网站：http://www.wkzq.com.cn/wkzq/web/index.aspx  
 103）西藏同信证券股份有限公司  
 注册地址：拉萨市北京中路101号  
 联系人：王瑞楠  
 网站：www.txscsec.com  
 客户服务电话：400-881-1177  
 104）西南证券股份有限公司  
 注册地址：重庆市江北区桥北苑8号  
 办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦  
 法定代表人：余维佳  
 客户服务电话：4008-096-096  
 网站：www.swsc.com.cn  
 106）湘财证券有限责任公司  
 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋  
 办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋  
 元  
 元  
 法定代表人：林俊波  
 电话：021-68634518  
 传真：021-68965680  
 联系人：赵小勇021-68634510-8620  
 客服电话：400-888-1551  
 公司网站：www.xscsc.com  
 106）新时代证券有限责任公司  
 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  
 法定代表人：刘汝军  
 开放式基金咨询电话：400-698-9898  
 开放式基金业务传真：010-83651094  
 联系人：孙艳  
 联系电话：010-83651149  
 网站：www.xsrdzq.com  
 107）信达证券股份有限公司  
 注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
 办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
 法定代表人：张志刚  
 联系人：唐静  
 联系电话：010-63081000  
 传真：010-63080978  
 客服电话：400-800-8899  
 公司网站：www.cindac.com  
 108）兴业证券股份有限公司  
 注册地址：福州市湖东路99号  
 办公地址：浦东新区民生路1199弄二五道口广场1号楼20层  
 法定代表人：兰荣  
 客服电话：95562  
 业务联系电话：0591-38162212  
 公司网站：http://www.xysec.com.cn/xyzq/index.html  
 110）中国国际证券投资有限公司  
 注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
 法定代表人：陈有安  
 开放式基金咨询电话：4008-888-888  
 开放式基金业务传真：010-66568990  
 联系人：田薇  
 联系电话：010-66568430  
 网站：www.chinastock.com.cn  
 113）招商证券股份有限公司  
 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层  
 办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层  
 法定代表人：宫少林  
 电话：0755-82943666  
 传真：0755-82943636  
 联系人：林生迎  
 客户服务电话：95565、4008888111  
 公司网站：www.newone.com.cn  
 114）中国银河证券股份有限公司  
 注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层  
 办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层  
 电话：0571-87901908、0571-87901053  
 传真：0571-87901913  
 联系人：刘斌、谢明辉  
 客户服务电话：0571-967777  
 公司网站：www.stock.com.cn  
 112）中信证券股份有限公司  
 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座  
 办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座  
 41楼  
 41楼  
 法定代表人：王宜四  
 电话：0791-86768681  
 联系人：戴静  
 客户服务电话：400-8866-567  
 网站：www.citics.com  
 113）中国国际金融有限公司  
 注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
 办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
 法定代表人：金立群  
 电话：010-65051166  
 传 真：010-86679535  
 公司网站：http://www.cicco.com.cn  
 114）中天证券有限责任公司  
 注册地址：沈阳市和平区光荣街22甲  
 办公地址：沈阳市和平区南五马路121号万丽城晶座4楼中天证券经纪事业部  
 法定代表人：马功勋  
 联系人：袁韵秋  
 联系电话：024-23280842  
 客服电话：4006180315  
 公司网站：www.stockten.com  
 联系人：袁韵秋  
 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心C栋  
 18层21-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23、24层  
 办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层  
 法定代表人：卢勇  
 联系电话：0755-82023442  
 传真：0755-82023539  
 网站：www.china-invscn.com  
 客服电话：400-600-8008、95532  
 116）中信建投证券股份有限公司  
 注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
 办公地址：北京市朝内大街188号  
 法定代表人姓名：王常青  
 基金业务对外联系人：权敬  
 联系电话：400-8888-108  
 联系传真：010-65182261  
 公司网站：www.citics.com.cn  
 客服电话：400-8898-108  
 117）中信证券（浙江）有限责任公司  
 注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道688号恒鑫大厦主楼19、20层  
 办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道688号恒鑫大厦主楼19、20层  
 法定代表人：沈强  
 联系人：王瑞楠  
 电话：0571-86888888  
 公司网站：www.bigsun.com.cn  
 118）中信证券（山东）有限责任公司

住所：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1208-1209室  
 法定代表人：罗爱斌  
 电话：010-67000988  
 传真：010-67000988-6000  
 联系人：刘普峰  
 网站：www.zcvc.com.cn 客户服务电话：400-001-8811  
 143）深圳腾元基金销售有限公司  
 注册地址：深圳市福田区金田路2028号 皇岗商务中心406-407  
 办公地址：深圳市福田区金田路2028号 皇岗商务中心406-407  
 电话：40061-88312929  
 联系人：李丹  
 联系方式：0756-3337 6922  
 传真号码：0756-3306 5516  
 客服电话：010-68033739  
 联系人：潘俊  
 公司网站：www.cssecit.com  
 120）中银国际证券有限责任公司  
 注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层  
 法定代表人：许刚  
 联系人：李丹  
 电话：021-68604966  
 电话：021-50372474  
 客户服务电话：021-68604866  
 公司网站：www.bocichina.com  
 121）中原证券股份有限公司  
 名称：中原证券股份有限公司  
 地址：郑州市郑东新区商务外环路10号  
 法定代表人：菅明远  
 客服电话：0371-967218、4008139666  
 联系人：程月艳 范希程  
 联系电话：0371-66099882  
 联系传真：0371-66585899  
 网站：www.ccnew.com  
 122）天相投资顾问有限公司  
 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编：100032  
 办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座505 邮编：100088  
 法定代表人：林义相  
 联系人：尹玲  
 联系电话：010-66045152  
 客服电话：010-66045678  
 传真：010-66045618  
 天相投顾网站：http://www.txsec.com  
 天相基金网站：http://www.jim.com.cn  
 123）江苏金百临投资咨询有限公司  
 注册地址：无锡市滨湖区长安路1号  
 办公地址：无锡市滨湖区锦溪路99号  
 法定代表人：费晓斌  
 电 话：0510-82768877  
 传 真：0510-88555858  
 124）深圳市新华信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1006  
 公司地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006  
 法定代表人：马金全  
 客服热线：4000-945-999  
 客服电话：0755-88390099  
 传真号码：0755-88394677  
 新兰德网站：http://www.new-rand.cn/  
 125）和讯信息科技有限公司  
 注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
 办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
 法定代表人：王利  
 联系电话：4008-773-772  
 联系人：周欣  
 电话：021-20836789  
 传真：021-20836885  
 网站：www.5ifund.com  
 126）厦门市鑫鼎盛证券投资咨询有限公司  
 注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼  
 办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼  
 法定代表人：林松  
 联系人：高莺  
 电话：0592-3122719  
 传真：0592-8060771  
 客户服务电话：400-6890-777  
 网站：www.dtkhs.com  
 127）诺亚正行（上海）基金销售有限公司  
 注册地址：上海市金山区卫城镇锦康路6750号205室  
 办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801  
 法定代表人：汪静波  
 电话：021-38800771  
 传真：021-38509777  
 128）深圳众成基金销售有限公司  
 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  
 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  
 元  
 法定代表人：薛峰  
 联系电话：0756-33227950  
 客服电话：4000-898-1551  
 传真：0756-82060787  
 联系人：董彩平  
 网站：www.zcfund.cn 及 www.jimn.com  
 129）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30C100室  
 注册资本：人民币伍仟万元  
 法定代表人：其实  
 电 话：021-54509898  
 传 真：021-64385308  
 130）上海好易宝销售有限公司  
 注册地址：上海市虹口区场中南路685弄37号4号楼449室  
 办公地址：上海市浦东新区川沙路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室  
 法定代表人：杨文斌  
 电话：021-58870011  
 传真：021-68596919  
 公司网站：http://www.howebuy.com/  
 131）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海曙路2号  
 办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3688号恒生大厦12楼  
 法定代表人：陈柏青  
 联系人：张裕  
 电话：021-60897840  
 传真：0571-26696533  
 客服电话：4000-766-123  
 网站：http://www.fund123.com/  
 132）上海长量基金销售有限公司  
 注册地址：上海市浦东新区高路路566号2楼220室  
 办公地址：上海市浦东新区高路路566号裕景国际B座16层  
 法定代表人：张跃伟  
 联系人：单丙辉  
 电话：021-20691832  
 传真：021-20691861  
 客服电话：400-0818-1289  
 公司网站：www.erichfund.com  
 133）浙江同恒基金销售有限公司  
 注册地址：浙江省杭州市文二西路9号元茂大厦903室  
 办公地址：浙江省杭州市翠柏路1号杭州电子商务产业园2楼  
 邮 编：310012  
 联系人：胡蝶  
 联系电话：0571-88911818  
 传 真：0571-86800423  
 客服电话：4008-773-772  
 公司网站：www.5ifund.com  
 134）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：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号院3号楼B座6层  
 法定代表人：闫振杰  
 电话：010-62020088  
 135）上海利得基金销售有限公司  
 注册地址：上海市宝山区川流路5475号1033室  
 办公地址：上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼  
 法定代表人：盛大  
 电话：021-60583533-3006  
 传真：021-60583633  
 客服电话：400-005-6356  
 网站：www.leadfund.com.cn  
 136）中期时代基金销售有限公司  
 注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层  
 办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层  
 法定代表人：路瑶  
 电话：010-58079655  
 传真：010-58079688  
 客服电话：95162 4008888160  
 网站：www.citicofund.com  
 137）浙江金观诚财富管理有限公司  
 注册地址：西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼D区J801室  
 办公地址：浙江杭州西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心D区801室  
 法定代表人：陆彬彬  
 联系人：邓勇男  
 电话：0571-56028620  
 传真：0571-56899710  
 客户服务电话：400-068-0058  
 公司网站：http://www.jncfunds.com/  
 138）北京创金信证投资管理有限公司  
 注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A  
 办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A  
 法定代表人：梁鑫  
 电话：010-68154828  
 传真：010-88067525  
 客服电话：010-88067525  
 网站：www.5irich.com  
 139）泛华普益基金销售有限公司  
 注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室  
 办公地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室  
 法定代表人：于海峰  
 电话：028-82000968  
 传真：028-82000968-805  
 网站：http://www.pyfund.cn/  
 140）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司  
 注册地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809  
 办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809  
 法定代表人：沈伟彬  
 公司网站：www.yixinfund.com  
 服务电话：400-609-2000  
 客服电话：400-609-2000  
 客服电话：400-609-2000  
 网站：www.why-fund.com  
 142）北京增财基金销售有限公司

2、普通债券投资策略  
 （1）利率策略  
 本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况 and 金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与凸度综合分析，制定出具体投资策略。  
 具体而言，本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立经济前景的景观模型，进而预测财政、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，对影响资金面的因素进行综合分析并预判，建立资金面的景观模型。  
 在此基础上，本基金将结合历史与经验数据，区分当前利率债收益率曲线的期限结构、收益率与期限利差所面临的历史分位，判断收益率曲线变动趋势的程度与概率，即对收益率曲线平移的方向、陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析，以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现正向平移的概率较大时，即市场利率将上升，本基金将降低组合久期以规避利率风险；如出现负向平移的概率较大时，则提高组合久期；如收益率曲线过于陡峭时，则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上，利用蝶形策略获取超额收益。  
 （2）信用策略  
 本基金依靠内部信用评级系统跟踪研究发债主体的经营情况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，我们设计了定性定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”、“公司风险”（公司背景+公司行业地位+企业盈利模式+公司治理结构+信息披露+企业财务状况）+“外部支持”（外部流动性支持能力+债券担保增信）+“得到评分”的评级过程。其中，定性分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，它是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。本基金内部的信用评级体系定位为即时评级，侧重于评级的准确性，从而为信用产品的实时交易提供便利。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，并快速做出反应，以便及时有效地捕捉信用利差变化带来的市场交易机会。  
 （3）券种选择策略  
 本基金建立了自上而下和自下而上两方面的研究思路，自上而下的研究包含宏观基本面分析、资金基本面分析，自下而上的研究包含信用利差分析、债券信用风险评估、信用估值模型和交易策略分析，由此形成宏观和微观层面相配套的研究决策体系，最后形成具体的投资策略。  
 3、可转债投资策略  
 基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等因素，本基金在一级、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。  
 （1）行业配置策略  
 本基金将参考宏观经济走势、经济周期、以及阶段性市场投资主题的变化，综合考虑宏观调控目标、产业结构调整等因素，精选成长前景明确或受益政策扶持的行业内公司发行的可转换债券进行投资布局。另外，由于宏观周期所处的时期和市场发展的阶段不同，不同行业的可转换债券也将表现出不同的风险收益特征。在经济复苏的初期，持有资源类行业的可转换债券将获得良好的投资收益；而在经济衰退时期，持有防御类非周期行业的可转换债券，将获得更加稳定的收益。  
 （2）个券选择策略  
 本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略，在严格控制风险的前提下，精选具有投资价值的可转换债券券种，力争实现较高的投资收益。  
 （3）债券估值策略  
 本基金将深入分析公司基本面，包括经营状况和财务状况，预测其未来发展战略和融资需求，结合流动性、到期收益率、纯债溢价率等因素，充分发掘这些条款给可转换债券带来的投资机会。  
 在转股期内，当本基金所持有可转换债券市场交易价格显著低于转股平价时，即转股溢价率明显为负时，本基金将通过转股并在其上市交易后10个工作日内卖出股票以实现收益。  
 4、中小企业私募债券投资策略  
 本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程，投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管理、分散化投资、合理期限评估、预测和控制相关风险，实现投资收益目标。  
 本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪发债主体主体的经营、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级指标为企业基本面分析为基本特征，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。  
 本基金对中小企业私募债券的投资策略以持有到期为主，所投资的中小企业私募债券的剩余期限不超过基金的剩余封闭运作期。在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下，重点选择资质较好、收益率较高、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。  
 本基金对中小企业私募债券的投资，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，并经常性地跟踪，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。  
 （二）投资流程依据和资产配置  
 1、投资决策依据  
 （1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；  
 （2）国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响；  
 （3）国家货币政策及债券市场状况；  
 （4）商业银行的信贷扩张；  
 （5）债券市场的基本状况；  
 2、投资决策程序  
 本基金投资决策流程为：  
 （1）宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向，提交策略报告；  
 （2）债券策略分析师提交关于债券市场基本、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告；  
 （3）信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整；  
 （4）数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析；  
 （5）在分析研究报告的基础上，基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议；  
 （6）投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划；  
 （7）如投资计划通过，基金经理在考虑资产配置的情况下，挑选合适的债券品种，灵活采取各种策略，构建投资组合。  
 （三）投资限制  
 基金的投资组合应遵循以下限制：  
 （1）本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的80%；  
 （2）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；  
 （3）本基金管理人管理的基金持有一家公司的证券，不超过该证券的10%；  
 （4）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%；  
 （5）本基金管理人管理的基金持有一权证，不得超过该权证市值的10%；  
 （6）本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的20%；  
 （7）本基金持有的中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；  
 （8）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%；  
 （9）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%；  
 （10）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%；  
 （11）本基金管理人管理的基金持有一同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%；  
 （12）本基金投资于信用评级为A以上（含A）的资产支持证券，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；  
 （13）本基金在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90%；  
 （14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。  
 本基金管理人应依据有关法律法规的规定，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并签订公告。  
 （二）注册登记机构  
 名称：中国证券登记结算有限责任公司  
 住所：北京市西城区太平桥大街17号  
 办公地址：北京市西城区太平桥大街17号  
 法定代表人：金颖  
 联系人：严磊、朱立元  
 电话：0755-22609000、010-59378839  
 传真：010-59378907  
 （三）律师事务所和经审计的会计师事务所  
 名称：上海市通力律师事务所  
 住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
 负责人：韩朝  
 电话：（021）31358666  
 经办律师：吕红、黎明  
 联系人：吕红  
 （四）会计师事务所和经审计的会计师事务所  
 名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  
 首席合伙人：吴尚平  
 住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东2楼东2层1616层  
 办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东2楼东2层1616层  
 邮政编码：100738  
 公司电话：（010）58153000  
 公司传真：（010）58198298  
 签字会计师：徐皓、陶海川  
 业务联系人：徐皓  
 四、基金名称  
 本基金名称：汇添富互利分级债券型证券投资基金  
 五、基金的类型  
 本基金为债券型证券投资基金  
 六、基金的投资目标  
 在严格控制投资风险的基础上，本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理，力争实现资产的长期稳健增值。  
 本基金的投资范围为固定收益类品种，国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款）、以及法律法规和中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金不直接投资于二级市场买入的股票和权证，也不参与市场新股申购。因持有可转换债券转股所产生股票，因所持股票派发的权证以及因投资可转债而产生的权证，应当在其可上市交易后的10个交易日卖出。  
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。  
 本基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的95%，持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
 如法律法规或中国证监会调整投资品种的投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以调整上述投资品种和投资比例。  
 七、基金的风险收益特征  
 本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于普通债券型基金，其预期收益和风险低于股票型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金。  
 八、基金的投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。  
 1、同类属的券种，由于受到不同因素的影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同属类债券的投资比例。  
 （一）投资策略  
 本基金将密切跟踪债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定基金资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，利率策略、信用策略