

东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证监会2015年4月29日证监许可[2015]1783号文准予注册。本基金的基金合同于2015年6月3日正式生效。

【重要提示】本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资者投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的投资、时机、数量等投资行为作出独立决策,自行承担投资风险。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金净值出现波动带来的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、封闭期无法赎回和开放期大量赎回或赎回导致的流动性风险。基金管理人在投资经营过程中存在的不规范操作、内部控制不完善等的风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“卖者尽责,买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本基金投资于中小企业私募债券,由于中小企业私募债券发行和公开发行的方式发行,即使在本市场流动性比较好的情况下,个别债券的流动性可能较差,从而使得投资者在进行个券操作时,可能难以按市价买入或卖出相应的数量,或买入卖出行为对价格产生比较大的影响,增加个别债券的建仓成本或变现成本。并且,中小企业私募债券信用风险一般较债券市场,存在若发行人不能按时足额还本付息的风险,此外,当发行人信用评级降低时,基金所投资的债券可能面临价格下跌风险。

本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

本基金为发起式基金,在基金募集时,基金管理人的股东运用其固有资金认购本基金份额的金额不低于1000万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。但基金管理人的股东对本基金发起认购,并不代表其对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证,发起资金并不用于对投资人投资亏损的补偿,投资人及发起资金认购人亦自行承担投资风险。基金管理人的股东认购的本基金份额持有期限满三年后,基金管理人的股东将根据自身情况决定是否继续持有,届时基金管理人的股东有可能赎回认购的本基金份额。另外,在基金合同生效满3年后对应日,如果本基金的资产规模低于2亿元,基金合同将按照基金合同约定的程序进行终止并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。因此,投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

业绩比较基准并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,主要内容是约定基金当事人之间权利义务的法律文件。招募说明书主要内容向投资者披露与本基金相关的事项,信息是投资者用以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。本基金自依法基金募集开始,即成为基金管理人的股东持有本基金和基金合同,其持有基金份额的行为本身即表明其持有基金合同和基金合同,并按《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应仔细阅读本基金的基金合同。

本招募说明书所载内容截至2015年12月2日,基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2015年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基本信息如下:

名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路318号31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼31、37、39、40层
法定代表人:王宇斌
设立日期:2010年7月28日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2010]618号
开展公开募集证券投资基金业务批准文号:证监许可[2013]1131号
组织形式:有限责任公司
注册资本:3.4亿元人民币
存续期限:持续经营
联系电话:(021)63235888
联系人:康迪

股权结构:东方证券股份有限公司持有公司100%的股权。
公司前身是东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部,2010年7月28日经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]618号)批准,由东方证券股份有限公司出资3亿元人民币,在原东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部的基础上正式成立,是国内首家获批设立的券商系资产管理公司。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员
王國斌先生,董事长,1968年生,中共党员,硕士研究生。曾任上海万国证券公司投资银行部融资经理;申银万国证券公司国际业务部融资经理;中国经济开发信托投资公司证券交易部总经理助理;东方证券有限责任公司交易总部总经理、总裁助理兼交易部总经理、总裁助理兼融资融券业务部总经理、总裁助理兼资产管理部总经理;东方证券股份有限公司副总裁、东方证券股份有限公司资产管理部总经理、东方证券股份有限公司董事;现任上海东方证券资产管理有限公司董事长、上海东方证券资产管理有限公司董事。

潘善成先生,董事,1961年出生,中共党员,研究生学历,高级经济师。曾任中国人民银行上海分行行长办公室处惠恩路管理处处长、副行长;工商银行上海分行行长办公室惠恩路管理处党支部书记;工商银行上海分行行政办公室联络员;工商银行上海分行组织部副主任科员;工商银行上海分行行政工作会主任、副行长(主持工作)、行长、党委书记兼国际银行支行党支部书记;东方证券股份有限公司党委副书记、总裁、董事长兼总裁;汇添富基金管理有限公司董事长;上海东方证券投资有限公司董事、现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长、上海东方证券资产管理有限公司董事、上海东方证券资产管理有限公司董事长、东方花旗证券有限公司董事长、上海东方证券资产管理有限公司董事。

杨玉成先生,董事,1965年出生,中共党员,硕士研究生,高级经济师。曾任上海财经大学财政系教师;君安证券股份有限公司证券投资部总经理助理;上海大科科技实业(集团)股份有限公司董事、副总裁助理;上海申能资产管理有限公司董事、副总经理;东方证券股份有限公司财务总监、副总裁;申能集团财务有限公司董事、总经理;东方证券股份有限公司副总裁、上海诚毅投资管理有限公司董事、上海诚毅新能源投资有限公司董事。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书,东方金融控股(香港)有限公司董事长、上海东方证券资产管理有限公司董事、长城基金管理有限公司董事。

陈光明先生,董事,1974年生,中共党员,硕士研究生。曾任东方证券受托资产管理业务总部业务董事,东方基金有限责任公司证券投资部兼基金部,东方证券资产管理业务总部副总经理、总经理、东方证券股份有限公司总裁助理,现任上海东方证券资产管理有限公司党委书记、董事、总经理。

2.基金管理人监事
顾林福先生,监事,1956年生,中共党员,研究生,经济师。曾任上海市教育局人事处、科员、副处长,上海市教育委员会副处长、上海市教育发展基金会总经理,上海交大昂立股份有限公司监事长;现任上海东方证券资产管理有限公司监事。

3.经营管理层人员
陈光明先生,总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。
任莉女士,联席总经理,1968年生,北京大学社会学学士、美国芝加哥哥立诺州立大学社会学硕士、芝加哥大学工商管理硕士、清华大学工商管理硕士、工商管理学教授。曾任中央音乐学院教师;深圳上市公司集团业务主管;深圳南药制药有限公司总经理助理;安徽医药有限责任公司副总经理;任生臣公司高级分析师;北医药公司副总经理;东方基金有限责任公司财务总监;亚洲环球有限责任公司副总经理;东方证券股份有限公司资产管理业务总部副总经理;现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理、董事会秘书。

周庆华先生,副总经理,1980年生,中共党员,硕士研究生,曾任深圳证券交易所基金管理部经理、金融创新实验室高级经理、监管支持与衍生品工作小组执行经理,兼任深圳证券交易所仲裁员,曾获交易所期货监管系统金融服务能手称号,深圳证券交易所“十佳员工”称号等,在资产证券化等结构创新领域具有丰富的经验。

4.首席风险官、合规总监
杨先生,首席风险官兼合规总监,1972年生,中共党员,硕士,曾任中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处科员、上海证监局稽查处、案件处理处、机构一处副主任科员,主任科员、机构一处副处长、期货处处长、法制处处长;现任东方证券股份有限公司首席风险官兼合规总监、上海东方证券资产管理有限公司首席风险官兼合规总监。

5.公募基金基金管理业务合规负责人(督察长)
唐毓女士,公募基金基金管理业务合规负责人兼合规与风险管理部总监、华东政法大学法律系教授,曾任上海复华会计师事务所审计项目副经理,上海交大会计师事务所审计部税务部主管,中国证监会上海证监局科员、副主任科员,主任科员,上海农商银行股份有限公司金融管理部经理,德恒基金管理有限公司(筹)筹备组副组长、督察长,富国基金管理有限公司监察稽核部总监、富国资产管理(上海)有限公司副总经理。

6.本基金基金经理
本基金基金经理:
林鹏先生,生于1976年,上海财经大学工商管理硕士研究生,自1998年起开始从事证券行业工作。历任东方证券股份有限公司研究所研究员、资产管理业务总部投资经理、东方证券资产管理有限公司证券投资部投资经理、专户投资部投资经理、基金投资部基金经理。现任上海东方证券资产管理有限公司公募基金权益投资部基金经理,执行董事。2014年9月起任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年1月起任东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金和东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年4月起任东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金和东方红睿稳精选混合型证券投资基金基金经理。2015年6月起任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

纪文静女士,生于1982年,江苏大学国际贸易学硕士研究生,自2007年起开始证券行业工作。历任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员,德邦证券股份有限公司债券交易部总经理助理,上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监。现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总监、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿稳精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红红利优享混合型证券投资基金基金经理。

7.基金业务投资决策委员会成员
基金投资决策委员会成员构成如下:公司总经理陈光明先生,董事、总经理、公募基金权益投资部总监、权益研究部总监杨达治先生,公募基金权益管理部执行董事林鹏先生。

列席人员:公募基金基金管理业务合规负责人兼合规与风险管理部总监唐毓女士。

8、上述人员之间不存在近亲属关系。

(一)基金托管人概况

1.基本情况
名称:招商银行银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
设立日期:1987年4月8日

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:25,202亿元
法定代表人:李建强

行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755-83190094
传真:0755-83196201

资产托管部信息披露负责人:张燕

2.发展概况
招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持

股的股份制商业银行,总行设在深圳,自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了222亿人民币,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日发行H股招股配售,共发行724.21亿股,截止2015年9月30日,本集团总资产6,223.72亿元人民币,高级法下资本充足率12.70%,权重法下资本充足率12.24%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部,2005年8月,经中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理部、产品管理部、业务运营室、稽核监察室、基金外包业务室等六个职能处室,现有员工60人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式成为证券投资基金托管人,招商银行作为业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先声夺人”的托管理念和“财富托付、信托服务”的托管核心理念,独创“6S托管银行”品牌体系,以“保护您的资金、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品;在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统 and “6C”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行总行,成功托管国内第一只券商集合理财产品、一只R-FOF、一只信托投资基金、第一只股权投资基金、第一只实现跨境市场基金跨境资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT托管,实现从单一托管服务向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

经过十三年发展,招商银行资产托管规模快速壮大。2015年招商银行加大高收益托管产品营销力度,截止11月末新托管公开开放式基金52只,新增首发公募开放式基金托管规模940.37亿元。我国国内证券市场快速发展的不利形势,托管费收入、托管资产均创出历史新高,实现托管费收入31.36亿元,同比增长65.49%,托管资产余额29.92亿元,同比增长86.96%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人,成功签约“壹基金”公益慈善托管,为我国公益慈善基金监管、信息披露进行有益探索,该项目荣获2012中国金融创新奖“金象奖”“十大公益项目”奖;四度蝉联《财资》“中国最佳托管专业银行”。

(二)主要人员情况

李建强先生,本行董事长,非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华鲁公路股份有限公司董事长和招商局资本投资管理有限公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总助理、总经理、副经理,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行副行长,执行董事,2013年6月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年6月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生,本行副行长。大学本科学历,副研究员。1996年12月加入本行,历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理,杭州分行行政助理、副行长,南昌支行行长,南昌分行行长,总行人力资源部总经理,总行行政助理,2008年4月起任本行副行长。兼任招商局国际金融有限公司董事。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行上海分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部高级经理,高级经理,助理经理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(三)基金销售机构情况

截至2015年11月30日,招商银行股份有限公司累计托管142只开放式基金及其它托管资产,托管资产为362,901.90亿元人民币。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1.直销机构

(1)直销中心
名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路318号31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼37层
法定代表人:王宇斌
联系电话:(021)633315896
联系人:潘迪
客服电话:(021)63236881

联系人:康迪
客服电话:4009200808
公司网址:www.dfam.com

(2)网上交易系统

网上交易系统包括管理人公司网站(www.dfam.com)和管理人指定电子交易平台。个人投资者可登陆本公司网站(www.dfam.com)和管理人指定电子交易平台,在与本公司达成网上交易的相关协议,接受本公司有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后,通过本公司网上交易系统办理开户、认购、申购、赎回等业务。

2.代销机构

(1)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建强

电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195060
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555

网址:www.cmbchina.com
(2)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层—29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层—29层
法定代表人:潘鑫军

联系电话:(021)63325888
联系人:胡月茹
客服电话:(021)95503
公司网站:www.dfzq.com.cn

基金管理人只根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(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:周明

电话:010-58598883
传真:010-58190857
联系人:任瑞新

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋

电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市黄浦区南京东路61号4楼
办公地址:上海市黄浦区南京东路61号4—11楼
法人代表:朱建弟

经办注册会计师:朱颖、尤文文
电话:(021)63392518
传真:(021)63391166
联系人:尤文文

四、基金的名称

东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向

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

行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、可转债、分离交易可转债、可交换、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会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。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的60%,但在每个期间开放期的前10个工作日和后10个工作日、到期开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间,基金投资不受前述比例限制;本基金投资于股票的比例不高于基金资产的50%。在开放期,每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期,本基金不受前述5%的限制。

八、基金的投资策略

本基金以36个月为一个运作周期,以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择,运用封闭式投资策略,在股票配置上,充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排,在股票配置上,以时间换空间,采用低风险投资策略,为基金获得更稳定的低风险收益;在债券配置上,合理配置久期匹配债券的结构,做好流动性管理,以期获得更高的投资收益。

1.资产配置
本基金以36个月为一个运作周期,以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择,运用封闭式投资策略,在股票配置上,充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排,在股票配置上,以时间换空间,采用低风险投资策略,为基金获得更稳定的低风险收益;在债券配置上,合理配置久期匹配债券的结构,做好流动性管理,以期获得更高的投资收益。

2.股票配置
本基金通过动态跟踪国内外主要宏观经济指标、GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势,并通过全面评估上述各种关键指标的变化趋势,对股票、债券等大类资产的风险收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产配置权重,实现资产配置合理。

3.债券配置
本基金通过动态跟踪国内外主要宏观经济指标、GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势,并通过全面评估上述各种关键指标的变化趋势,对股票、债券等大类资产的风险收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产配置权重,实现资产配置合理。

4.股指期货配置
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

5.国债期货配置
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

6.资产支持证券配置
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

7.权证配置
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

8.其他金融工具配置
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

9.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

10.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

11.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

12.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

13.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

14.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

15.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

16.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

17.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

18.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

19.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

20.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

21.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

22.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

23.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

24.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

25.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

26.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

27.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

28.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

29.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

30.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

31.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

32.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

33.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

34.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

35.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

36.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

37.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

38.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

39.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

40.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

41.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

42.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

43.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

44.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

45.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

46.基金的投资组合
本基金在追求基金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益,力求超越业绩比较基准的投资回报。

投资决策依据以及具体的决策程序:

(1)投资决策依据
投资决策依据包括:国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定;宏观经济政策、微观企业运行趋势;证券市场走势。

(2)投资决策原则
合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易、及风险控制。

(3)投资决策机制
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例等重大投资决策。

基金经理在公司权益研究部、固定收益研究部、公募基金权益部、公募固定收益部、量化投资部的协助下,在投资决策委员会确定的投资范围和资产配置范围内制定并实施具体的投资决策,构建和调整投资组合,并向交易室下达投资指令。

交易室负责交易执行和一线监控,通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

(4)投资管理流程
投资决策委员会是本基金的最高投资决策机构,定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、研究员、交易员在投资管理过程中密切配合,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下:

1)投资决策委员会定期召开投资决策会议,对资产配置比例提出指导性意见,并讨论股票、债券的投资重点等;

2)基金经理根据投资决策委员会决议,依据宏观分析、策略研究员的宏观经济分析和策略建议、行业研究员的行业分析和个股研究、债券研究员的债券市场研究和券种选择、量化研究员的量化投资策略研究,结合本基金产品定位及风险控制的要求,在投资范围内制定具体的投资组合方案;

3)基金经理根据投资组合方案,向交易室下达交易指令;

4)交易室通过风控系统的自动合规核查后,由交易室执行,交易室对交易情况及时反馈;

5)基金经理对每日交易执行情况进行回顾,并审视基金投资组合的变动情况;

6)合规与风险管理部定期完成有关投资风险监控报告,并在量化投资组合辅助下完成基金绩效归因分析。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序作出调整。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

十、基金的风险收益特征
本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

十一、基金的投资组合报告
以下投资组合基金数据截至2015年9月30日。

3	固定收益投资	1,134,466,700.00	79.13
	其中:债券	1,134,466,700.00	79.13
	资产支持证券	-	-
	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	80,641,011.50	5.62
8	其他资产	13,861,944.80	0.97
9	合计	1,453,723,516.30	100.00