

上接B061版

号楼 2 楼
法定代表人:凌顺平
电话: (0571) 88911818
传真: (0571) 86800423
联系人:吴强
客户服务电话:400-877-3772
网址:www.5ifund.com
(59)北京景财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人:罗细安
电话: (010) 67000988
传真: (010) 67000988-6000
联系人:李皓
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zengcaiwang.com
(60)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区星海中路3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中路3号
法定代表人:林卓
电话: (0411) 88981212
传真: (0411) 84396536
联系人:薛长平
客户服务电话:400-611999
网址:www.taichengcaifu.com
(61)上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室
(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
电话: (021) 65370077
传真: (021) 55085991
联系人:俞申购
客户服务电话: (021) 65370077
网址:www.jiyufund.com.cn
(62)珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B101-1203
法定代表人:肖冉
电话: (020) 89629099
传真: (020) 89629091
联系人:黄敬敬
客户服务电话: (020) 89629096
网址:www.yingmi.cn
(63)深圳众禄财富管理有限公司
住所:深圳市南山区高新区南七道12号恒惠集二期418
办公地址:深圳市南山区高新区南七道12号恒惠集二期418
法定代表人:齐贺
电话: (0755) 83999070-802
传真: (0755) 83999026
联系人:马力佳
客户服务电话: (0755) 83999070
网址:www.jinqianwo.com
(64)上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
电话: (021) 20665952
传真: (021) 22066653
联系人:宁博宇
客户服务电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(65)上海汇付金融服务有限公司
住所:上海市中山南路100号金融滩国际广场19楼
办公地址:上海市虹口路1801号凯科国际大厦7楼
法定代表人:冯修敏
电话: (021) 33323999
传真: (021) 33323837
联系人:陈云卉
客户服务电话:4008213999
网址:https://tbychinapm.com
(66)北京京东融多投资咨询有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人:董浩
电话: (010) 56580666
传真: (010) 56580660
联系人:张婷婷
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.jmfund.com
(67)上海利财金融基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继伟
电话: (021) 51150298
传真: (021) 51150398
联系人:廖海
客户服务电话:400-2266-021-22267995
网址:www.tdfunds.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)登记服务机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市朝阳区太平桥大街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) 59378839

传真: (010) 59378907

联系人:朱立元

(三)诉讼法律意见书的律师事务所

名称:上海泰律师事务所

住所:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人:廖海

电话: (021) 51150298

传真: (021) 51150398

联系人:梁丽君、刘佳

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市徐汇区零陵路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市徐汇区零陵路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

联系电话: (021) 23238888

传真: (021) 23238800

联系人:沈兆杰

经办注册会计师:薛亮、沈兆杰

(五)基金的名称

本基金名称:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

根据宏观经济周期和市场环境的变化,自上而下灵活配置资产,积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力求实现基金资产的长期稳定增值。

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,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的30%~80%;债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%~70%,其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金净资产的5%。在基金实际管理过程中,基金管理人将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,在上述投资组合比例范围内,适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具之间的配置比例。

八、基金的投资策略

本基金将采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统,结合定性分析和定量分析实现大类资产的灵活配置。具体而言,首先利用经济周期理论,对宏观经济的经济周期进行预测,在此基础上形成对不同资产市场的特征的相对变化,动态调整组合中各资产的比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各资产的比例,以规避或分散市场风险,提高基金收益率。同时,本基金将充分借鉴施罗德集团公司在配置型基金方面

成功的投资经验。具体操作中,本基金管理人采用经济周期理论下的资产配置模型,通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析,对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测,然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

2、优势行业选择

国民经济快速增长的背后蕴涵了不同行业对GDP增长贡献率的差异,而不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。

本基金管理人通过在全球经济的框架下建立交银施罗德优势

行业评估体系,采用因素的定性与定量相结合的分析和预测方法,研究宏观经济和行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值与投资时机,据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业,把握行业景气轮换带来的投资机会。

具体操作中,我们对行业的挑选重点分为两个部分,即行业平均增长率预测和行业综合评价。首先考察各行业历史收入和利润增长表现,对未来行业收入增长率和行业平均利润增长率进行预测;对根据预测结果计算的增长率低于GDP增长率的行业进行剔除;然后根据交银施罗德优势行业评价体系对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序,挑选出未来一段时间内最具增长前景的行业,具体评估将从宏观经济环境、行业景气度分析和预测、上下游行业对本行业景气度影响、密切关注各行业景气度指标、行业财务状况(行业盈利能力、行业经营效率和行业竞争力)表现四个方面入手,采用定性分析结合定量分析的方法对行业的未来的增长前景进行综合评价。

最后,在完成行业预测和行业综合评价基础上,通过市场及各个行业的绝对和相对估值水平PE、PB等数据的横向、纵向分析,进行估值比较,并跟踪各行业的资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力,动态把握板块轮动蕴涵的投资机会。

3、股票选择

本基金综合运用施罗德集团的研究分析方法和其它投资

分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票

投资组合,前述优势行业中股票优先入选。具体分以下两个层次进

行股票挑选:

(1)品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的

上市公司,构建选股池。主要筛选指标包括:盈利能力指标如P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等、经营效率指标(如ROE、ROA、Return on operating assets等)和财务状况指标

(如D/A、流动比率等)

(2)多元化价值评估

本基金综合运用施罗德集团的研究分析方法和其它投资

分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票

投资组合,前述优势行业中股票优先入选。具体分以下两个层次进

行股票挑选:

(1)品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的

上市公司,构建选股池。主要筛选指标包括:盈利能力指标如P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等、经营效率指标(如ROE、ROA、Return on operating assets等)和财务状况指标

(如D/A、流动比率等)

(3)其他资产构成

本基金报告期末未持有权证。

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名贵金属投资明细

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资明细

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资明细

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资明细

8、投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备

选股票池之外的股票。

本基金报告期末未持有权证。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名股指期货交易情况说明

10、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证交易情况说明

11、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名贵金属交易情况说明

12、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

13、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

14、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

15、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

16、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

17、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

18、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

19、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

20、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

21、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

22、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

23、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

24、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

25、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

26、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

27、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

28、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

29、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

30、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

31、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

32、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

33、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

34、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

35、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

36、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名基金投资情况说明

37、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五

名权证投资情况说明

38、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五</div