

农银汇理策略精选混合型证券投资基金招募说明书 (2016年第2号更新) 摘要

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2011年7月15日证监许可【2011】1116号文核准。本基金的基金合同生效日期为2011年9月6日。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，但中国证监会对本基金募集申请的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，投资者根据所持份额享受基金的收益，但同时也也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资组合内连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理人特有、某基金特定风险、本基金开放式基金申购赎回引发的流动性风险、基金投资中的较高风险、较高收益的投资品种。投资有风险，投资人认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本招募说明书（更新）所载内容截止日为2016年9月3日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日（财务数据未经审计）。

理和内部控制的有效性全面认可。

（二）主要人员情况
孙晓刚先生，中信银行行长。1958年出生，东北财经大学经济学硕士。1981年4月至1984年5月，就职于中国人民银行。1984年5月至2006年1月，任中国工商银行海淀办公室、海淀区支行、北京分行、总行数据中心（北京）等单位。1996年12月至2006年11月，任中国工商银行北京分行行政助理、副行长。1999年11月至2004年4月，兼任中国工商银行总行数据中心（北京）总经理。2006年12月至2009年12月，任交通银行北京分行行长。2010年1月至2011年10月，任交通银行北京管理部总经理。兼任北京北信安公司董事。2011年10月至2014年5月，任中信银行副行长。2014年5月至2016年6月，任中信银行常务副行长。

杨敏先生，中信银行副行长，分管托管业务。1962年12月生，2011年4月起担任中国建设银行江苏省分行行长，党委书记；2006年7月至2011年3月担任中国建设银行河北省分行行长，党委书记；1982年8月至2006年7月在中国建设银行河南省分行工作，历任计划财务处科员，副处长，信阳地区中心支行副行长，党组成员，计划处处长，中办处处长，郑州市铁路专业支行行长，党组书记，郑州分行行长，党委书记，金水支行行长，党委书记，党委副书记，河南部分行副行长，党委书记。1986年调入本行工作，历任行政处科长，副科长，河南分行副行长助理，总行资产保全部主管，总行国际业务部总经理助理，副经理，副经理（主持工作）。

（三）基金托管业务经营情况
2004年10月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2016年半年末，中信银行已托管81只开放式证券投资基金，以及证券投资基金资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、ODI等其他托管资产，托管总规模达到3,365亿元人民币。

三、 相关服务机构
（一）基金份额发售机构
1、直销机构：
名称：农银汇理基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
办公地址：上海浦东新区银城路9号农银大厦50楼
法定代表人：于进
成立日期：2008年3月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监许可【2008】307号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币10亿元
存续期限：永久存续
联系人：黎雯雯
联系电话：021-61095688
股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中银资产控股有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

（二）主要人员情况
1、董事会成员：
于进先生：董事长
孙晓刚先生：高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息管理部处长、处长，人事部部长，副总经理，电子银行部总经理，科技与产品管理局局长。2015年6月9日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。
Bernard Carayon先生：副董事长
经济学者。1978年起历任法国农业信贷银行集团董事、中央风险控制部主管，东方汇理银行和东方汇理资产管理风险控制部1主管，东方汇理资产管理公司董事、农银汇理基金现任东方汇理资产管理公司副董事长、财务总监。

许金超先生：董事
高级经济师。经济学者。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行总行河南分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。
曹群志先生：董事
工商管理硕士，高级会计师。1996年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部副总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司副总经理，并先后兼任中国海外控股有限公司董事、“中铝”国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。
高若鸣女士：董事
高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行资产负债部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行山西分行行长兼党委书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。
曹群志先生：董事
工商管理硕士，高级会计师。1996年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部副总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司副总经理，并先后兼任中国海外控股有限公司董事、“中铝”国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。
高若鸣女士：董事
高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行资产负债部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行山西分行行长兼党委书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。
曹群志先生：董事
工商管理硕士，高级会计师。1996年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部副总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司副总经理，并先后兼任中国海外控股有限公司董事、“中铝”国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。
高若鸣女士：董事
高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行资产负债部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行山西分行行长兼党委书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。

（三）基金托管人：中国银行股份有限公司
名称：中国银行股份有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
办公地址：上海浦东新区银城路9号农银大厦50楼
法定代表人：于进
成立日期：2008年3月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监许可【2008】307号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币10亿元
存续期限：永久存续
联系人：黎雯雯
联系电话：021-61095688
股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中银资产控股有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

（二）主要人员情况
1、董事会成员：
于进先生：董事长
孙晓刚先生：高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息管理部处长、处长，人事部部长，副总经理，电子银行部总经理，科技与产品管理局局长。2015年6月9日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。
Bernard Carayon先生：副董事长
经济学者。1978年起历任法国农业信贷银行集团董事、中央风险控制部主管，东方汇理银行和东方汇理资产管理风险控制部1主管，东方汇理资产管理公司董事、农银汇理基金现任东方汇理资产管理公司副董事长、财务总监。

许金超先生：董事
高级经济师。经济学者。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行总行河南分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。
曹群志先生：董事
工商管理硕士，高级会计师。1996年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部副总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司副总经理，并先后兼任中国海外控股有限公司董事、“中铝”国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。
高若鸣女士：董事
高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行资产负债部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行山西分行行长兼党委书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。

（三）基金托管人：中国银行股份有限公司
名称：中国银行股份有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
办公地址：上海浦东新区银城路9号农银大厦50楼
法定代表人：于进
成立日期：2008年3月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监许可【2008】307号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币10亿元
存续期限：永久存续
联系人：黎雯雯
联系电话：021-61095688
股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中银资产控股有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

（二）主要人员情况
1、董事会成员：
于进先生：董事长
孙晓刚先生：高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息管理部处长、处长，人事部部长，副总经理，电子银行部总经理，科技与产品管理局局长。2015年6月9日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。
Bernard Carayon先生：副董事长
经济学者。1978年起历任法国农业信贷银行集团董事、中央风险控制部主管，东方汇理银行和东方汇理资产管理风险控制部1主管，东方汇理资产管理公司董事、农银汇理基金现任东方汇理资产管理公司副董事长、财务总监。

许金超先生：董事
高级经济师。经济学者。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行总行河南分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。
曹群志先生：董事
工商管理硕士，高级会计师。1996年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部副总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司副总经理，并先后兼任中国海外控股有限公司董事、“中铝”国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。
高若鸣女士：董事
高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行资产负债部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行山西分行行长兼党委书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。

（三）基金托管人：中国银行股份有限公司
名称：中国银行股份有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
办公地址：上海浦东新区银城路9号农银大厦50楼
法定代表人：于进
成立日期：2008年3月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监许可【2008】307号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币10亿元
存续期限：永久存续
联系人：黎雯雯
联系电话：021-61095688
股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中银资产控股有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

（二）主要人员情况
1、董事会成员：
于进先生：董事长
孙晓刚先生：高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息管理部处长、处长，人事部部长，副总经理，电子银行部总经理，科技与产品管理局局长。2015年6月9日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。
Bernard Carayon先生：副董事长
经济学者。1978年起历任法国农业信贷银行集团董事、中央风险控制部主管，东方汇理银行和东方汇理资产管理风险控制部1主管，东方汇理资产管理公司董事、农银汇理基金现任东方汇理资产管理公司副董事长、财务总监。

许金超先生：董事
高级经济师。经济学者。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行总行河南分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。
曹群志先生：董事
工商管理硕士，高级会计师。1996年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部副总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司副总经理，并先后兼任中国海外控股有限公司董事、“中铝”国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。
高若鸣女士：董事
高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行资产负债部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行山西分行行长兼党委书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行资产管理部总经理，中国农业银行托普业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年6月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。
Thierry Mequillet先生：董事
工商管理硕士。1979年开始在Credit Agricole Indosuez从事银行工作并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，先后在香港地区总经理，亚太区行总裁。2012年6月起任东方汇理资产管理亚洲合伙企业高级行政合伙人。

（三）基金托管人：中国银行股份有限公司
名称：中国银行股份有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
办公地址：上海浦东新区银城路9号农银大厦50楼
法定代表人：于进
成立日期：2008年3月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监许可【2008】307号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币10亿元
存续期限：永久存续
联系人：黎雯雯
联系电话：021-61095688
股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中银资产控股有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

（二）主要人员情况
1、董事会成员：
于进先生：董事长
孙晓刚先生：高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息管理部处长、处长，人事部部长，副总经理，电子银行部总经理，科技与产品管理局局长。2015年6月9日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。
Bernard Carayon先生：副董事长
经济学者。1978年起历任法国农业信贷银行集团董事、中央风险控制部主管，东方汇理银行和东方汇理资产管理风险控制部1主管，东方汇理资产管理公司董事、农银汇理基金现任东方汇理资产管理公司副董事长、财务总监。

传真：021-22169134
客服电话：4008887878、95625
网址：www.abchina.com

（20）兴业证券资产管理有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
联系人：谢海彬
电话：021-38565785
传真：021-38565955
客服电话：95522
网址：www.xyzq.com.cn

（21）上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
法定代表人：杨文斌
联系人：杜敏
电话：021-20131999
传真：021-68569611
客服电话：400-700-9655
网址：www.ehowbuy.com

（22）上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙山路190号2号楼
办公地址：上海市徐汇区龙山路190号2号楼3C座
法定代表人：其实
联系人：李超
电话：021-54509888
传真：021-64388308
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

（23）杭州数米基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江杭州市西湖区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：韩妮妮
电话：021-68897840
传真：0571-26897013
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.com

（24）深圳众安金融控股有限公司
住所：深圳市福田区福强路1001号众安大厦8楼
办公地址：深圳市福田区福强路1001号众安大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：陈彩屏
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客服电话：4006-788-787
网址：www.zafund.com

（25）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区益田路1006号平安大厦A座17层
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座17层
法定代表人：杨晓
联系人：文雯
电话：010-83363099
传真：010-83363072
客服电话：400-166-1188
网址：http://rlx.fund.com.cn

（26）和讯信息科技有限公司
住所：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：王莉
联系人：张静
电话：010-85650628
传真：010-65844788
联系人：刘洋
客服电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com

（27）上海融金资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人：郭坚
电话：021-20665952
联系人：何雪
客服电话：400-821-9031
网址：www.rjcm.com

（28）上海联泰资产管理有限公司
住所：上海市市长宁区金虹桥路658弄2号楼B座6层
法定代表人：燕妮
电话：021-52822063
传真：021-52975670
联系人：兰薇
客服电话：400-466-788
网址：http://www.91fund.com/index.html

（29）上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市虹口区东长治路668号1800号2号楼6153室（上海泰和经济发
展区）
办公地址：上海市杨浦区国明路518号A1002室
法定代表人：王翔
电话：021-65370077
传真：021-56085891
客户服务电话：021-65370077
网址：www.juyinfund.com

（30）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
法定代表人：钱坚
联系人：孟庆阳
电话：010-59364698
网址：http://www.jnlc.com/

（31）国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130633
传真：0755-82133962
客服电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

（10）广发证券股份有限公司
住所：广州天河区河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316）层
办公地址：广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦
法定代表人：王树
联系人：张敬
电话：020-97555417
客服电话：95575或致电各地营业网点
网址：www.gf.com.cn

（11）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-60833722
传真：010-60833729
客服电话：95558
网址：www.citics.com

（12）中国银河证券股份有限公司
住所：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：陈安
联系人：田薇
电话：010-66569430
传真：010-66569900
客服电话：400-888-888
网址：www.chinastock.com.cn

（13）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李昊
电话：021-23211000
传真：021-63410556
客服电话：400-888-001、95553
网址：www.htsec.com

（14）申万宏源证券有限公司
住所：上海市徐汇区龙山路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区龙山路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：李梅
联系人：王宇飞
电话：021-33398988
传真：021-33398224
客服电话：95523、400895623
网址：www.swhysc.com

（15）长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：杨华辉
联系人：李晨
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客服电话：95579、4008-888-999
网址：www.95579.com

（16）安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82825551
传真：0755-82858355
客服电话：4008-001-001
网址：www.axsec.com.cn

（17）中信证券（山东）有限责任公司
住所：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
办公地址：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：杨洁生
联系人：吴昊
电话：0532-85022236
传真：0532-85022265
客服电话：95548
网址：www.citicsd.com

（18）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路181号2号楼22层、29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
电话：021-63328888
传真：021-63326173
客服电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn

（19）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：李芳芳
电话：021-22169081

库，从而保证入库的策略必须普遍具有以下的基本特征：

①投资逻辑具有说服力。
②具有较为持续的历史超额收益
③具有较高的信息比率。
④超额收益分布较为合理。
通过上述的指标标准的构建，基金管理人将力求寻找收益率稳健、信息比率较高、超额收益分布合理、多数策略性较低的数量化投资策略，组成本基金的备选数量化投资策略池。

（2）股票投资策略的合理配置
数量化投资策略是指基金经理和相关研究人员在资产配置策略确定的基础上，根据主动管理的基本定律，对本基金数量化策略池内的数量化策略及部分基于定性分析的投资策略进行相关性分析，筛选出一定数量的相关度较低的数量化策略，再以该策略的风险调整后收益最大化为原则，对各数量化策略进行最优化处理，确定各数量化策略的配置权重。
在策略的筛选、本基金将对各策略之间的收益率进行回归分析，从而计算出各个策略超额收益之间的相关性，并剔除那些表现高度相关的策略，从而降低组合超额收益的波动性，提高组合的信息比率。
（3）策略的权重配置。基金管理人将利用自身的数量化策略配置工具对备选策略组合的进一步优化，从而计算出各数量化策略在股票组合中所占的权重。
（4）策略的主动管理。在本基金的数量化策略池内，基金管理人将对进入组合的各数量化策略进行密切跟踪，随着市场条件的改变而对策略配置加以改进，否则完全固化的策略组合将有可能被原有的业绩表现，在极端市场环境下还有可能导致较大的风险。模型的创新和退出时机的原因主要取决于：
①发现经济或市场环境变化导致原有策略模型的有效性假设条件消失，或者发生改变，从而导致超额收益的持续性无法保证；
②组合内使用的比较成熟的策略模型逐渐被市场大量复制应用，从而导致原有策略产生超额收益的效率下降；
③随着市场环境的变化，部分策略的超额收益相关性变强导致超额收益的叠加效果不再明显；
④由于市场结构的演变，导致原有策略得出的投资组合在分散程度、流动性等指标上不再符合组合预设的主动风险控制的要求。

在以上策略筛选和配置的基础上，基金管理人将对数量化策略池内策略进行定性分析，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效或不再符合标准的策略，并继续寻找新的因素和策略模型。
（3）股票投资策略的构建
基金管理人实施基金投资组合构建的过程，必然面临多个因素带来的选股数量较多且较为零散的问题。为解决这一问题，基金管理人将对股票组合所面临的各类约束进行量化，并以该标准对所构建的理论组合进行可行性检验。
在符合上述约束条件的前提下，基金管理人将采用定量分析的方法，对纳入组合的策略进行及时的淘汰和更新，以保证原有投资目标和策略的延续性和一致性。此外，基金管理人还将定期对备选数量化策略池中的策略进行跟踪和分析，剔除失效