

(上接B015版)

(90)中国中证证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
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:高涛
电话:0755-83820351
传真:0755-83207942
联系人:胡月娟
网址:www.china-invs.com
客户服务电话:400-8008-36532
(91)中国证券有限责任公司
住所:深圳市福田区中心三路华强高新发展大楼7层,8层
办公地址:深圳市福田区中心路科技一路华强高新发展大楼7层,8层
法定代表人:黄炎勋
电话:0755-82570586
传真:0755-82960582
联系人:罗艺琳
网址:www.csc.com.cn
客户服务电话:06329
(92)联讯证券股份有限公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐刚
电话:053131195
联系人:彭程
网址:www.lxsec.com
客户服务电话:95664
(93)国泰君安证券股份有限公司
住所:成都市青羊区东城根上街55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:028-86660057
传真:028-86690126
联系人:刘娟、曹鹏
网址:www.gtja.com.cn
客户服务电话:96310
(94)长城国瑞证券有限公司
住所:福建省厦门市莲前西路2号莲前大厦十七层
办公地址:福建省厦门市深田路46号深田国际大厦19-20楼
法定代表人:王明
电话:0592-2079920
联系人:陈霞
网址:www.gwsc.com
客户服务电话:400-0099-896
(95)爱建证券有限责任公司
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:钱华
电话:021-32229888
传真:021-62878783
联系人:王轶
网址:www.ajzq.com
客户服务电话:400-196-2502
(96)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:027-87618882
传真:027-87618863
联系人:董娟
网址:www.tfzq.com
客户服务电话:400-800-8896
(97)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:吴玉明
电话:028-86199278
传真:028-86199362
联系人:程晓光
网址:www.hxzc.com
客户服务电话:400-826-6366
(98)开源证券股份有限公司
住所:陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
电话:029-88447611
联系人:曹欣
网址:www.kysec.com
客户服务电话:05325, 400-860-8996
(99)华鑫国际销售有限公司
住所:上海市嘉定区南翔镇众仁路349号1号通顺财富广场1号楼B座13.14层
办公地址:上海市浦东新区川沙路405号1号上海中心大厦32层
法定代表人:路昊
电话:021-61848705
传真:021-61088515
联系人:胡勇强
网址:www.huaxinsales.com
客户服务电话:400-111-6818
(100)上海华鑫财富管理投资管理有限公司
住所:上海虹口区东大名路487号一幢B座2602室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座18层
法定代表人:李一梅
电话:010-88066632
传真:010-88066214
联系人:孙树明
网址:www.amcfund.com
客户服务电话:400-817-6666
本公司可以根据情况增加或减少基金销售机构,并另行公告。基金销售机构可以根据情况增加或减少基金销售网点,网站。

(二)登记机构
名称:华鑫基金管理有限公司
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座18层
法定代表人:杨明辉
客户服务电话:400-818-6666
联系人:朱敏
(三)律师事务所
名称:北京市天元律师事务所
住所:北京市西城区丰盛胡同22号太平洋保险大厦10层
法定代表人:朱小华
联系电话:010-57763888
联系人:李路
经办律师:吴冠雄、李路
(四)会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区东川路500号1318号展耀银行大厦7楼
办公地址:上海市浦东新区湖洲路202号绿地企业广场二座库华大道中11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:021-22328888
传真:021-22328900
联系人:叶峰、赵雪
经办注册会计师:叶峰、赵雪

四、基金的名称

本基金名称:华夏睿泰兴混合证券投资基金(特殊普通合伙)

五、基金的投资目标

本基金类型:契约型开放式基金

六、基金的投资目标

通过跟踪指数方法进行资产配置,积极管理,力求有效控制风险,实现基金资产长期增值。

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公司股票(包括中小盘、创业板及其他中国证监会核准上市的投资)、债券、货币市场工具、金融衍生品、金融期货、企业债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股指期货、国债期货、期权等)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券以及法律法规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相关规定)。

八、基金的投资策略

本基金根据宏观经济环境以及以下基金投资品种,基金管理人进行适当

调整后,可以采取主动投资策略。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为50%-30%,每交易日

日终在扣除股指期货、股指期货、股指期货合约保证金后,持有现金或

到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

九、基金的投资策略

(一)资产配置策略

本基金以资产配置作为主要资产配置策略,通过平衡各资产类别对整个组

合的贡献,合理确定基金在股票、债券等资产上的投资比例,更好地适应不

同变化的市场环境,本基金还将动态调整各资产类别比例,在基于风险调

配策略应用过程中,本基金还将通过研究预期利率走势和信用风险暴露,以达

到长期稳定、相对稳健的波动水平,获得良好的风险调整后的收益。

(二)股票投资策略

本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资

策略。

1.主动量化股票投资策略

本基金充分发挥基金管理人选股优势,以多因子模型和事件驱动模型基础,并辅以其他量化投资手段构建投资组合,力求寻找具有确定性收益的投资组合。量化因子模型包含公司基本面、技术指标、市场情绪等可量化的因素,如价值因子、动量因子、成长因子、情绪因子等。事件驱动模型以深入研究上市公司增发、定期报告、业绩预告、大股东/高管增持减持、限售股解禁、股票质押等上市公司事件为基础,分析事件的动作、操作逻辑、预期结果和对公司股价的影响,进而构建相应的投资策略。

2.基于风险均衡的股票投资策略

本基金将风险均衡策略自下而上的应用于同一行业内的股票和不同的行业

中,在既定风险下追求更好的风险调整后收益。

(三)债券投资策略

本基金债券投资策略分为主动债券投资策略和基于风险均衡的债券投资策

略。

1.主动债券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质

量、增信措施还本、风险补偿能力和市场流动性等基本因素,估计资产违约风险和

增信措施付风险,并根据资产证券化收益结构安排,模拟资产支持证券的本金还

和利息现金流的过程,辅助采用定价模型,评估其内在价值。

(五)权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价

值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期动

态,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

(六)股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适度参与股指期货投资。通过

对现货市场和期货市场运行特征的研究,结合基金股票资产的实际情况及对股

期货的估值水平、基差水平、流动性等指标的分析,选择适合的期货合约构建相

应的头寸,以调整投资组合的风险暴露,降低系统性风险。基金还将利用股指期货

作为组合流动性管理工具,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,

提高基金的投资效率或实现套利。

(七)国债期货投资策略

本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和

风险特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

(八)期权投资策略

本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性好、交易

活跃的期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,

选择估值合理的期权合约。

本基金投资管理,基金管理人将根据审慎原则,建立期权交易决策部门或小

组,授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

未来,根据市场情况,基金管理人将在履行适当的程序后,可相应调整和更新相

关投资策略,并招募说明书予以更新并公告。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:中证800指数收益率×10%+上证国债指数收益率×

90%。

中证800指数是中证指数有限公司编制的,反应沪深证券市场内大中小市值公

司的整体状况,具有良好的市场代表性和市场影响力,适合作为本基金股票投

资的业绩基准。

上证国债指数由中证指数有限公司编制,以上海证券交易所上市的可固定利

率国债为样本,具有较好的市场代表性和较高的知名度,适合作为本基金债券投

资的业绩基准。

如果中证指数有限公司变更或停止中证800指数或上证国债指数的编制及发

布,或中证800指数或上证国债指数与其他指数替代,或由于编制方法发生重大

变更等原因导致中证800指数或上证国债指数不能继续作为基准指数,或市场有

其他代表性强、更适应投资指数需要的,本基金管理人可以依据维护投资者合

法权益的原则,取得基金托管人同意,变更本基金的基准指数,并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金属于混合基金,风险与收益高于债券基金与货币市场基金,低于股票基

金,属于较高风险、较高收益的品种。

十二、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金2018年第4季度报告:

“6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,264,000.00	86.81
2	固定收益投资	3,200,000.00	86.81
3	银行存款	32,400,000.00	86.81
4	其他资产	32,400,000.00	86.81
5	其他负债	660,000.00	1.79
6	资产支持证券	660,000.00	1.79
7	买入返售金融资产	660,000.00	1.79
8	其他	660,000.00	1.79
9	合计	3,264,000.00	86.81

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.20 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
医药生物	32,400,000.00	86.81
计算机	32,400,000.00	86.81
通信设备	32,400,000.00	86.81
电子元件	32,400,000.00	86.81
其他	32,400,000.00	86.81

6.2.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。