交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金(更新)招募说明书摘要

(2015年第1号)

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

二〇一五年十二月

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】

交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")为根据《交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。

交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金经2012年4月26日中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]565号文核准募集,自2012年5月14日至2012年6月15日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。经中国证监会书面确认,《交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年6月20日生效。

交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金第一个保本周期于2015年6月23日到期。按照《交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,该基金保本周期到期后转型为非保本的混合型基金,名称相应变更为"交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金"。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书根据本基金的基金合同编写,本基金的基金合同经中国证监会备案。但中国证监会对交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金募集的核准以及其转型为本基金的备案,并不表明其对本基金的价值和收益作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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资人在投资本基金前,需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,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险;基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险;由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险;交易对手违约风险;本基金投资策略所特有的风险等等。本基金是一只混合型基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

投资有风险,投资人在投资本基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2015年12月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
邮政编码:200120
法定代表人:于亚利
成立时间:2005年8月4日
注册资本:2亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:何万金
电话:(021)61055050
传真:(021)61055034

交银施罗德基金管理有限公司(以下简称"公司")经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下使用全称或其简称"交通银行")	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

(二)主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

于亚利女士,董事长,硕士学位。现任交通银行执行董事、副行长。历任交通银行郑州分行财务会计处处长、郑州分行副行长,交通银行财务会计部副总经理、总经理,交通银行预算财务部总经理,交通银行首席财务官。

雷贤达先生,副董事长,学士学位,加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理(香港)有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

阮红女士,董事,总经理,博士学位,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任交通银行办公室副处长、处长,交通银行海外机构管理部副总经理、总经理,交通银行上海分行副行长,交通银行资产托管部总经理,交通银行投资管理部总经理。

陶文先生,董事,硕士学位。现任交通银行个人金融业务部总经理。历任交通银行徐州分行副行长、行长,交通银行南京分行副行长,交通银行海南分行行长。

孙培基先生,董事,学士学位。现任交通银行风险管理部副总经理。历任交通银行财会部副处长,交通银行董事会办公室副处长、处长,交通银行预算财务部高级经理,交通银行海南分行副行长,交通银行审计部副总经理。

孟方德先生,董事,硕士学位。现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。历任施罗德投资管理有限公司分析师、投资经理,施罗德投资管理(新加坡)有限公司副董事长,施罗德投资管理国际有限公司执行董事,施罗德投资管理(卢森堡)有限公司总经理,施罗德投资管理(日本)有限公司总经理,施罗德投资管理有限公司英国区总经理及销售总监、全球渠道销售业务总监。

谢丹阳先生,独立董事,博士学位。现任武汉大学经济与管理学院院长、香港科技大学经济系教授。历任蒙特利尔大学经济系助理教授,国际货币基金经济学家和高级经济学家,香港科技大学助理教授、副教授、教授、系主任、瑞安经管中心主任。

袁志刚先生,独立董事,博士学位。现任复旦大学经济学院教授。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任、经济学院院长。

周林先生,独立董事,博士学位。现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。历任复旦大学管理科学系助教,美国耶鲁大学经济系助理教授、副教授,美国杜克大学经济系副教授,香港城市大学经济与金融系教授,美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院经济系冠名教授,上海交通大学上海高级金融学院常务副院长、教授。

2、基金管理人监事会成员

王亿军先生,监事长,硕士学位。现任交通银行战略投资部总经理。历任交通银行办公室副处长,交通银行公司业务部副处长、高级经理、总经理助理、副总经理,交通银行投资部副总经理,交通银行江苏分行副行长。

裴关淑仪女士,监事,双硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司助理总经理、交银施罗德资产管理(香港)有限公司总经理。曾任职荷兰银行、渣打银行(香港)有限公司、MIDAS-KAPITI INTERNATIONAL LIMITED,施罗德投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、中国事务联席董事,交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。

张丽女士,监事,学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司投资运营部总经理,历任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)高级审计员,交银施罗德基金管理有限公司基金运营部高级基金会计、部门总经理助理、副总经理、总经理。

张玲菡女士,监事,学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司营销管理部总经理。历任中国银行福州分行客户经理,新华人寿保险公司上海分公司区域经理,银河基金管理有限公司市场部渠道经理,交银施罗德基金管理有限公司渠道部副总经理、广州分公司副总经理。

3、基金管理人高级管理人员

阮红女士,总经理。简历同上。

许珊燕女士,副总经理,硕士学历,高级经济师,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师,湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理,湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

夏华龙先生,副总经理,博士学历。历任中国地质大学经济管理系教师、经济学院教研室副主任、主任、经济学院副院长;交通银行资产托管部副处长、处长、高级经理、副总经理;云南省曲靖市市委常委、副市长(挂职)。

谢卫先生,副总经理,经济学博士,高级经济师。历任中央财经大学金融系教员;中国社会科学院财经所助理研究员;中国电力信托投资公司基金部副经理;中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理,北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理,富国基金管理有限公司副总经理。

苏奋先生,督察长,纽约城市大学工商管理硕士。历任交通银行广州分行市场营销部总经理助理、副总经理,交通银行纽约分行信贷管理部经理、公司金融部经理、信用风险管理办公室负责人,交通银行投资管理部投资并购高级经理,交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

乔宏军先生,副总经理,博士学历,高级经济师,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事、总经理。历任交通银行资金部副处长、副高级经理、高级经理;交通银行金融市场部高级经理、总经理助理、副总经理;交通银行金融市场业务中心副总裁。

4、本基金基金经理

王少成先生,复旦大学物理化学硕士,11年证券行业经验。历任上海融昌资产管理公司研究员,中原证券投资经理,信诚基金管理有限公司研究总监助理,东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,曾任权益部副总经理,现任权益投资总监。2013年3月21日至2015年8月14日担任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(原交银施罗德先进制造股票证券投资基金)基金经理,2013年5月29日至2015年8月14日担任交银施罗德先锋混合型证券投资基金(原交银施罗德先锋股票证券投资基金)基金经理。2013年7月2日起担任交银施罗德成长30混合型证券投资基金(原交银施罗德成长30股票型证券投资基金)基金经理至今,2015年3月24日起担任交银施罗德成长混合型证券投资基金(交银施罗德成长股票证券投资基金)基金经理至今,2015年11月7日起担任交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理和交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金经理至今。

历任基金经理

项廷锋先生,2012年6月20日至2015年10月6日任本基金基金经理。

注:李娜女士于2015年10月7日至2015年11月6日期间代为履行本基金基金经理职责。

5、投资决策委员会成员

委员:阮红(总经理)
乔宏军(副总经理)
王少成(权益投资总监、基金经理)
张鸿羽(研究部总经理)
齐皓(跨境投资总监、投资经理)

上述人员之间不存在近亲属关系。上述各项人员信息更新截止日为2015年12月20日,期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中信银行股份有限公司(中信银行)
住所:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦北楼
法定代表人:常振明
成立日期:1987年4月7日
批准设立机关和批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号
注册资本:467.873亿元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-89936330
传真:010-85230024
联系人:中信银行资产托管部
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

中信银行(601998.SH,0998.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名"中信银行"。2006年12月,以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年,成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中信国金)70.32%股权。经过二十多年的发展,中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一,是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告,表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

2、主要人员情况

李庆萍,行长,高级经济师。1984年8月至2007年1月,任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007年1月至2008年12月,任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月,任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月,任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月,任中国中信股份有限公司副总经理。2014年7月,任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。

杨毓先生,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,中介处处长,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,河南省分行副行长,党委副书记。

刘泽云先生,现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理,经济学博士。1996年8月进入本行工作,历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理(主持工作)。

3、基金托管业务经营情况

2004年8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2015年6月30日,中信银行已托管63只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模突破4万亿元人民币。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标。强化内部管理,确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行;建立完善的规章制度和操作规程,保证基金托管业务持续、稳健发展;加强稽核监察,建立高效的风险监控体系,及时有效地发现、分析、控制和避免风险,确保基金财产安全,维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会,负责全行的风险控制和风险防范工作;托管部内设内控合规岗,专门负责托管部内部风险控制,对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度,涵盖证券投资基金托管业务的各个环节,保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等,从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展;建立了安全保管基金财产的物质条件,对业务运行场所实行封闭管理,在要害部门和岗位设立了安全保密区,安装了录像、录音监控系统,保证基金信息的安全;建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度,确保所托管的基金财产独立运行;营造良好的内部控制环境,开展多种形式的持续培训,加强职业道德教育。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》,基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定,对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》,基金合同和有关法律法规及规章的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上直销交易平台。
机构名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
法定代表人:于亚利
成立时间:2005年8月4日
电话:(021)61055724
传真:(021)61055054
联系人:傅鲸
客户服务电话:400-700-5000(免长途话费),(021)61055000
网址:www.fund001.com,www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、赎回、定期定额投资、转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站。网上直销交易平台网址:www.fund001.com,www.bocomschroder.com。

2、代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市复兴门内大街55号
办公地址:北京市复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(2)中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人:刘士余
传真:(010)85109219
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

(3)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
电话:(010)66275654
传真:(010)66275654
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(4)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195109
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

(6)上海银行股份有限公司
住所:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:范一飞
电话:(021)68475888
传真:(021)68476111
联系人:张萍
客户服务电话:(021)962888
网址:www.bankofshanghai.com

(7)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦北楼
法定代表人:常振明
电话:(010)65557083
传真:(010)65550827
联系人:丰靖
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(8)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
电话:(010)57092615
传真:(010)57092611
联系人:董云巍
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(9)杭州银行股份有限公司
住所:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人:吴太普
电话:(0571)85108309
传真:(0571)85151339
联系人:严峻
客户服务电话:(0571)96523,400-8888-508
网址:www.hzbank.com.cn

(10)东莞农村商业银行股份有限公司
住所:东莞市东城区鸿福东路2号
办公地址:东莞市东城区鸿福东路2号
法定代表人:何沛良
电话:(0769)22866254
传真:(0769)22866282
联系人:林培珊
客户服务电话:(0769)961122
网址:www.drcbank.com

(11)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
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:10108998
网址:www.ebscn.com

(12)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:万建华
电话:(021)38676161
传真:(021)38670161
联系人:芮敏祺
客户服务电话:95521,400-8888-666
网址:www.gtja.com

(13)中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
电话:(010)85130588
传真:(010)65182261
联系人:魏明
客户服务电话:4008-888-108
网址:www.csc108.com

(14)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
电话:(021)23219000
传真:(021)23219100
联系人:李笑鸣
客户服务电话:95553或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.htsec.com

(15)广发证券股份有限公司
住所:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人:王志伟
传真:(020)87555305
联系人:肖中梅
客户服务电话:95575或致电各地营业网点
网址:www.gf.com.cn

(16)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:顾伟国
传真:(010)66568430
联系人:田薇
客户服务电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn

(17)招商证券股份有限公司
住所: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:黄健
客户服务电话:400-8888-111,95565
网址:www.newone.com.cn

(18)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
电话:(021)38565785
传真:(021)38565955
联系人:谢高得
客户服务电话:400-8888-123
网址:www.xyzq.com.cn

(19)中信证券股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
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
电话:(010)60838888
传真:(010)60833739
联系人:陈忠
客户服务电话:95558
网址:www.cs.ecitic.com

(20)申万宏源证券有限公司
住所:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人:李梅
电话:(021)33389888
联系人:李清怡
客户服务电话:95523或4008895523
网址:www.sywg.com

(21)国都证券股份有限公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

(22)华泰证券股份有限公司
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)83290979
传真:(025)51863323
联系人:万鸣
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

(23)中银国际证券有限责任公司
住所:上海市银城中路200号39层
办公地址:中国上海浦东银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人:许刚
联系人:李丹
客户服务电话:400-620-8888
网址:www.bocichina.com

(24)中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
电话:(0532)85022326
传真:(0532)85022605
联系人:吴忠超
客户服务电话:(0532)96577
网址:www.zxwt.com.cn

(25)恒泰证券股份有限公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
电话:(0471)4979037
传真:(0471)4961259
联系人:王旭华
客户服务电话:(0471)4960762,(021)68405273
网址:www.cnht.com.cn

(26)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16-26楼
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼
法定代表人:何如
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133952
联系人:周杨
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

(27)东北证券股份有限公司
住所:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
电话:(0431)85096709
联系人:潘锴
客户服务电话:4006000686,(0431)85096733
网址:www.nesc.cn

(28)中航证券有限公司
住所:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦41楼
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41楼
法定代表人:杜航
电话:(0791)86768681
传真:(0791)86770178
联系人:戴蕾
客户服务电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com

(29)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35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35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:(0755)82558305
传真:(0755)82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:400-800-1001
网址:www.essence.com.cn

(30)申万宏源西部证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号宏源证券
法定代表人:冯戎
电话:(010)88085858
传真:(010)88085195
联系人:李巍
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

(31)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:胡运钊
电话:(027)65799999
传真:(027)85481900
联系人:李良
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com

(32)德邦证券有限责任公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:姚文平
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客户服务电话:4008-888-128
网址:www.tebon.com.cn

(33)中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
电话:(0531)68889155
传真:(0531)68889752
联系人:吴阳
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

(34)江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:(0451)85863719
传真:(0451)82287211
联系人:刘爽
客户服务电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

(35)平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼(518048)
法定代表人:杨宇翔
电话:(0755)22627802
传真:(0755)82400862
联系人:郑舒丽
客户服务电话:95511-8
网址:www.pingan.com

(36)长城国瑞证券有限公司
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人:王勇
电话:(0592)5161642
传真:(0592)5161640
联系人:赵钦
客户服务电话:(0592)5163588
网址:www.xmzq.cn

(37)华宝证券有限责任公司
住所:中国上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27楼
办公地址:中国上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
电话:(021)68777222
传真:(021)68777822
联系人:赵洁
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com

(38)中国国际金融股份有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:丁学东
电话:(010)65051166
传真:(010)85679203
联系人:杨涵宇
网址:www.cicc.com.cn

(39)瑞银证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程宜荪
电话:(010)58328112
传真:(010)58328740
联系人:牟冲
客户服务电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com

(40)爱建证券有限责任公司
住所:上海市南京西路758号24楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:张建华
电话:(021)32229888
传真:(021)68728703
联系人:陈敏
客户服务电话:(021)63340678
网址:www.ajzq.com

(41)长城证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:(0755)83516289
传真:(0755)83516199
联系人:匡婷
客户服务电话:(0755)33680000,400-6666-888
网址:www.cc168.com.cn

(42)国金证券股份有限公司
住所:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:(028)86690126
传真:(028)86690126
联系人:金喆
客户服务电话:400-6600-109
网址:www.gjzq.com.cn

(43)方正证券股份有限公司
住所:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
电话:(010)68546765
传真:(010)68546792
联系人:徐锦福
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com

(44)渤海证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:王春峰
电话:(022)28451991
传真:(022)28451892
联系人:蔡霆
客户服务电话: 400-651-5988
网址:www.bhzq.com

(45)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:高冠江
电话:(010)63081000
传真:(010)63080978
联系人:唐静
客户服务电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

(46)华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
客户服务电话:(0591)96326
网址:www.hfzq.com.cn

(47)中国中投证券有限责任公司
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层-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:龙增来
电话:(0755)82023442
传真:(0755)82026539
联系人:刘毅
客户服务电话:400-600-8008
网址:www.china-invs.cn

(48)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:宋德清
电话:(010)58568235
传真:(010)58568062
联系人:黄恒
客户服务电话:(010)58568118
网址:www.hrsec.com.cn

(49)中原证券股份有限公司
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦17层
法定代表人:菅明军
电话:(0371)69099882
传真:(0371)65585899
联系人:程月艳、范春艳
客户服务电话:(0371)967218,400-813-9666
网址:www.ccnew.com

(50)联讯证券股份有限公司
住所:惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人:徐刚
电话:(021)33606736
传真:(021)33606760
联系人:陈思
客户服务电话:95564
网址:www.lxzq.com.cn

(51)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
电话:(010)66045529
传真:(010)66045518
联系人:尹伶
客户服务电话:(010)66045678
网址:http://www.txsec.com,www.jjm.com.cn

(52)华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯洋
电话:(028)86135991
传真:(028)86150400
联系人:周志茹
客户服务电话:95584
网址:www.hx168.com.cn

(53)中信期货有限公司
住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
电话:(0755)23953913
传真:(0755)83217421
联系人:洪诚
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com

(54)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:(0571)28829790,(021)60897869
传真:(0571)26698533
联系人:周嬿旻
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

(55)深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
电话:(0755)33227953
传真:(0755)33227951
联系人:汤素娅
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn,www.jjmmw.com

(56)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
电话:(021)20691832
传真:(021)20691861
联系人:单丙烨
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com

(57)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
传真:(021)68596916
联系人:薛年
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

(58)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人:汪静波
电话:(021)38600735
传真:(021)38509777
联系人:方成
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

(59)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
电话:(021)20835789
传真:(021)20835879
联系人:周轶
客户服务电话:4009200022
网址:http://licaike.hexun.com/

(60)上海天天基金销售有限公司
住所: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3C座10楼
法定代表人:其实
电话:(021)54509998
传真:(021)64385308
联系人:潘世友
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn

(61)北京钱景财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
电话:(010)57418829
传真:(010)57569671
联系人:魏争
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.niuji.net

(62)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层
法定代表人:陈操
电话:(010)58325395
传真:(010)58325282
联系人:刘宝文
客户服务电话:400-850-7771
网址:http://8.jrj.com.cn/

(63)北京展恒基金销售股份有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振杰
电话:(010)59601366-7024
传真:(010)62020355
联系人: 马林
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com

(64)一路财富(北京)信息科技有限公司
住所:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208
法定代表人: 吴雪秀
电话:(010)88312877
传真:(010)88312099
联系人: 苏昊
客户服务电话:400-001-1566
网址:http://www.yilucaifu.com/

(65)上海大智慧财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人:申健
电话:(021)20219931
传真:(021)20219923
联系人:付江
客户服务电话:021-20219931
网址:https://8.gw.com.cn

(66)上海联泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人:燕斌
电话:(021)52822063
传真:(021)52975270
联系人:凌秋艳
客户服务电话:4000-466-788
网址:www.66zichan.com

(67)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:沈伟桦
电话:(010)52855713
传真:(010)85894285
联系人:程刚
客户服务电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com

(68)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2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

(69)北京增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)670009888
传真:(010)670009888-6000
联系人:李皓
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zengcaiwang.com

(70)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龙园3号
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
电话:(0411)88891212
传真:(0411)84396536
联系人:薛长平
客户服务电话:4006411999
网址:www.taichengcaifu.com

(71)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:俞申莉
客户服务电话:(021)65370077
网址:www.jiyufund.com.cn

(72)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B1201-1203
法定代表人:肖雯
电话:(020)89629099
传真:(020)89629011
联系人:黄敏嫦
客户服务电话:(020)89629066
网址:www.yingmi.cn

(73)深圳富济财富管理有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
电话:(0755)83999907-802
传真:(0755)83999926
联系人: 马力佳
客户服务电话:(0755)83999907
网址:www.jinqianwo.com

(74)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

(75)上海汇付金融服务有限公司
住所:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市虹梅路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://tty.chinapnr.com

(76)北京乐融多源投资咨询有限公司
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.jimufund.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)59378839
传真:(010)59378907
联系人:朱立元

(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:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
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:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称:交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

根据对宏观经济周期和市场环境的分析研究,自上而下配置资产,并通过对类属资产灵活运用多种投资策略,力争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,包括国内依法公开发行交易的债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证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,但需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。

在正常情况下,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%,其中基金应保留不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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,适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具间的配置比例。

八、基金的投资策略

(1)资产配置策略

本基金将通过"自上而下"的定性分析和定量分析相结合以实现大类资产的灵活配置。具体而言,本基金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表现的预测和判断,确定基金资产在各类别资产间的分配比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各类资产的比例,以规避或分散市场风险,提高基金收益率。

具体操作中,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,并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。

根据经济周期理论,一个宏观经济运行的周期可以分为减速、衰退、复苏和扩张四个阶段,在经济周期的不同阶段,通货膨胀、利率水平和货币政策等对金融市场有着重要影响的因素往往表现出不同的规律,从而影响到不同大类金融资产的定价和市场表现。实证研究也表明,经济周期与金融市场的表现往往呈现出很强的相关性,当宏观经济运行处于不同的阶段时,股票、债券和现金等各大类资产也体现出不同的市场表现。经济周期理论下的资产配置模型依据经济周期和金融市场表现所呈现的相关关系,通过预测宏观经济运行所处的阶段,对各类资产在该阶段下可能的市场表现进行判断,为资产配置的调整提供依据。

(2)股票选择策略

本基金综合运用交银施罗德的股票研究分析方法和其它投资分析工具,通过综合运用多种投资策略精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。具体而言,本基金的股票投资策略包括:

1)事件驱动策略

通过对影响市场、行业及公司的当前或未来价值的重大事件的预测、分析和判断,把握各类型事件所产生的投资机会,深入挖掘预期将受益于事件发生及其后续影响的上市公司股票,并跟踪事件发展的持续影响,对股票投资组合进行动态调整。

本基金将重点关注的事件性因素包括:
①资产重组、资产注入及并购;
②股权转移及变动;
③重大合同公告或重大新产品推出;
④再融资;
⑤管理层变动;
⑥非流通股份解禁;
⑦上下游公司及其它相关行业的重大事件。

此外,本基金也会对包括公司股权激励、管理层收购、股东与管理层关系等其它因素予以跟踪分析。

2)主题跟踪策略

本基金还将针对经济周期和产业结构发展趋势及成长动因进行前瞻性的研究分析,深入挖掘经济结构变化和发展趋势产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题,力争动态把握经济发展和企业盈利的关键性因素所带来的投资机会。

主题跟踪策略的关键步骤包括:

①主题挖掘:从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发,分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素,从而前瞻性地发掘经济发展过程中的投资主题。

②主题配置:通过对投资主题的全面分析和评估,明确投资主题所对应的主题行业或主题板块,从而确定受惠于相关主题的企业。

③主题投资:在主题配置的基础上,依据企业对投资主题的敏感程度、反应速度以及获益水平等指标,精选个股。那些敏感程度高、反应速度快、获益水平高的企业将是本基金的投资重点。

④主题转换:通过紧密跟踪经济发展及其内在驱动因素的变化,不断地挖掘和研究新的投资主题,并对主题投资方向做出适时调整,从而准确把握新旧投资主题的转换时机,充分分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

3)逆向投资策略

本基金通过定量和定性的手段,通过全方位的分析,筛选相对价值被深度低估并具有较高安全边际的股票,获取其价值回归所带来的收益。

①定量分析:本基金将重点考察股票的市盈率、市净率、市现率及收益指标,选取具有低市盈率、低市净率、低市现率和高收益指标的个股,发掘其增值潜力。

②定性分析:在定量分析的基础上,本基金将详尽考察选取个股的基本面情况,确定基本面素质良好、价值回归期望较高的个股。

(3)债券投资策略

在债券投资方面,本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金的债券投资采取主动的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

在全球经济的框架下,本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断,运用数量化工具,对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测,并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素,构造债券组合。在具体操作中,基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。

(4)权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

(5)资产支持证券的投资策略

(下转B47版)