

(上接B15版)

(41) 南京证券股份有限公司
注册地址: 江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址: 江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法人代表: 史正超
联系人: 陈浩
联系电话: 025-83678888
传真电话: 025-83673777
客服电话: 95588
公司网站: www.njzq.com.cn

(42) 上海证券有限责任公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
法人代表: 李俊杰
联系人: 陈颖
联系电话: 021-53519888
传真电话: 021-53519888
客服电话: 021-962518
公司网站: www.shzq.com.cn

(43) 大同证券有限责任公司
注册地址: 大同市城区迎宾街15号恒泰中央A座12.13.14层
办公地址: 山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12.13.14层
法人代表: 薛峰
联系人: 薛峰
联系电话: 0351-4130322
传真电话: 0351-4130322
客服电话: 4007121212
公司网站: www.dtsz.com.cn

(44) 国联证券股份有限公司
注册地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联大厦7-9层
办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街7号国联大厦702
法人代表: 姚志勇
联系人: 姚志勇
联系电话: 0510-8283162
传真电话: 0510-8283162
客服电话: 95318, 400896518
公司网站: www.guolian.com

(45) 国融证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区金田路中华国际交易广场8楼
办公地址: 深圳市福田区金田路中华国际交易广场8楼
法人代表: 杨宇翔
联系人: 杨宇翔
联系电话: 95511-8
客服电话: 95511-8
公司网站: www.guorong.com.cn

(46) 华安证券股份有限公司
注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号B1座0327
法人代表: 李工
联系人: 李工
联系电话: 0551-65161666
传真电话: 0551-65161600
客服电话: 95318
公司网站: www.huanq.com.cn

(47) 国海证券股份有限公司
注册地址: 广西南宁市福祿路13号
办公地址: 广西南宁市福祿路13号
法人代表: 张葆华
联系人: 张葆华
联系电话: 0755-8379350
传真电话: 0755-83794850
客服电话: 95563
公司网站: www.guohai.com.cn

(48) 湘财证券股份有限公司
注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
办公地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
法人代表: 蔡一兵
联系人: 蔡一兵
联系电话: 0731-4403139
客服电话: 0731-4403139
公司网站: www.xcjq.com

(49) 中原证券股份有限公司
注册地址: 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
法人代表: 菅爱军
联系人: 菅爱军
联系电话: 0371-60998892
传真电话: 0371-65858989
客服电话: 95377
公司网站: www.ccnew.com

(50) 国都证券股份有限公司
注册地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
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
法人代表: 王少华
联系人: 王少华
联系电话: 010-84183333
客服电话: 010-84183311-3389
公司网站: www.guodu.com.cn

(51) 东吴证券股份有限公司
注册地址: 江苏省苏州工业园区苏虹路23号投资大厦18层23号投资大厦18层
办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东方证券大厦
法人代表: 范力
联系人: 范力
联系电话: 400-818-8118
客服电话: 400-818-8118
公司网站: www.dongwusecurities.com

(52) 华泰证券股份有限公司
注册地址: 江苏省常州延陵西路23号投资大厦18层23号投资大厦18层
办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东方证券大厦
法人代表: 顾群
联系人: 顾群
联系电话: 010-84183333
客服电话: 021-50988225
公司网站: www.htsec.com

(53) 华鑫证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区华强北路101号华鑫大厦39层
办公地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法人代表: 沈琦
联系人: 沈琦
联系电话: 021-20236390
传真电话: 021-50173274
客服电话: 400-620-8888
公司网站: www.huaxin.com

(54) 国新证券股份有限公司
注册地址: 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
法人代表: 魏志刚
联系人: 魏志刚
联系电话: 010-88081888
客服电话: 010-88081888
公司网站: www.guoxin.com.cn

(55) 华融证券股份有限公司
注册地址: 北京市朝阳区朝阳门内大街18号
办公地址: 北京市朝阳区朝阳门内大街18号
法人代表: 王华
联系人: 王华
联系电话: 010-88081888
客服电话: 010-88081888
公司网站: www.hrsec.com.cn

(56) 申银万国证券股份有限公司
注册地址: 上海市虹口区四川北路968号申银万国大厦30层
办公地址: 上海市虹口区四川北路968号申银万国大厦30层
法人代表: 储晓明
联系人: 储晓明
联系电话: 021-50109882
客服电话: 021-50109882
公司网站: www.sywg.com.cn

(57) 第一创业证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法人代表: 刘学民
联系人: 刘学民
联系电话: 0755-23838751
传真电话: 0755-23838701
客服电话: 400-888-6168
公司网站: www.fcsc.com.cn

(58) 金元证券股份有限公司
注册地址: 海口市南滨路36号证券大厦4楼
办公地址: 海口市南滨路36号证券大厦4楼
法人代表: 陆涛
联系人: 陆涛
联系电话: 0755-83025022
传真电话: 0755-83025625
客服电话: 0755-83025625
公司网站: www.jiyuan.com.cn

(59) 中航证券有限公司
注册地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
办公地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
法人代表: 王四四
联系人: 王四四
联系电话: 091-8670681
传真电话: 091-8670617
客服电话: 400-888-6168
公司网站: www.avicsec.com.cn

(60) 德邦证券股份有限公司
注册地址: 上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址: 上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
法人代表: 姚文平
联系人: 姚文平
联系电话: 021-68761616
传真电话: 021-68767880
客服电话: 400-888-128
公司网站: www.tebon.com.cn

(61) 华福证券有限责任公司
注册地址: 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157号新天地大厦7至10层
法人代表: 高健
联系人: 高健
联系电话: 0591-87383600
传真电话: 0591-87383610
客服电话: 96326
公司网站: www.hfsc.com.cn

(62) 华融证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区阜成门内大街6号
办公地址: 北京市西城区阜成门内大街6号
法人代表: 宋磊
联系人: 宋磊
联系电话: 400-888-128
客服电话: 400-888-128
公司网站: www.hrsc.com.cn

(63) 华融证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区阜成门内大街6号
办公地址: 北京市西城区阜成门内大街6号
法人代表: 宋磊
联系人: 宋磊
联系电话: 400-888-128
客服电话: 400-888-128
公司网站: www.hrsc.com.cn

(64) 联储证券有限责任公司
注册地址: 浙江省杭州市文晖路15号嘉华国际商务中心16.17楼
办公地址: 浙江省杭州市文晖路15号嘉华国际商务中心16.17楼
法人代表: 沈琦

客服电话: 0571-87825100
传真电话: 0571-87818329
联系人: 董力
联系电话: 0571-2308827
公司网站: www.csc.com.cn

(65) 上海华信证券有限责任公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法人代表: 杨文强
联系人: 杨文强
联系电话: 021-38784818
传真电话: 021-68777878
客服电话: 021-20219188
公司网站: www.huaxin.com.cn

(66) 华泰证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(单元)
办公地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(单元)
法人代表: 李刚
联系人: 李刚
联系电话: 0755-82083788
传真电话: 0755-82083408
客服电话: 95523
公司网站: http://www.htsec.com.cn

(67) 瑞银证券有限责任公司
注册地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
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
法人代表: 程冠江
联系人: 程冠江
联系电话: 010-58328888
传真电话: 010-58328112
联系人: 牟冲
客服电话: 4008878827
公司网站: www.ubs.com.cn

(68) 中信证券股份有限公司
注册地址: 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦A座46层
办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦A座46层
法人代表: 张佑军
联系人: 张佑军
联系电话: 010-63205344
传真电话: 010-63205344
客服电话: 95532, 400-600-8008
公司网站: www.citics.com

(69) 川融证券股份有限公司
注册地址: 四川省成都市高新区交子大道177号
办公地址: 四川省成都市高新区交子大道177号
法人代表: 高涛
联系人: 高涛
联系电话: 0755-82024422
传真电话: 0755-82024422
客服电话: 95532, 400-600-8008
公司网站: www.chuanyun.com

(70) 华宝证券股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法人代表: 陈华
联系人: 陈华
联系电话: 021-68777222
传真电话: 021-68777222
客服电话: 400-821-0203
公司网站: www.huabao.com

(71) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼
法人代表: 王瑾
联系人: 王瑾
联系电话: 021-53271875
传真电话: 021-50710161
联系人: 姜灵宇
客服电话: 400-821-0203
公司网站: www.lantai.com

(72) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼
法人代表: 王瑾
联系人: 王瑾
联系电话: 021-53271875
传真电话: 021-50710161
联系人: 姜灵宇
客服电话: 400-821-0203
公司网站: www.lantai.com

(73) 天风证券股份有限公司
注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法人代表: 余磊
联系人: 余磊
联系电话: 027-87610552
客服电话: 027-87618683
公司网站: www.tfsc.com

(74) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市福田区华强北路101号华鑫大厦39层
办公地址: 深圳市福田区华强北路101号华鑫大厦39层
法人代表: 孙智勇
联系人: 孙智勇
联系电话: 010-84183333
客服电话: 010-84183311-3389
公司网站: www.xlsec.com.cn

(75) 东方财富证券股份有限公司
注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城1幢5层05号
办公地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法人代表: 陈涛
联系人: 陈涛
联系电话: 400-166-1188
公司网站: http://77ef.com.cn

(76) 上海证券信息服务有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号3号楼5层01、02、03室
办公地址: 上海浦东陆家嘴金融贸易区3号楼5F
法人代表: 胡燕飞
联系人: 胡燕飞
联系电话: 021-50816703
公司网站: www.shzq.com.cn

(77) 深川金融控股股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区深南东路5047号发展银行大厦25楼J1单元
办公地址: 深圳市福田区深南东路5047号发展银行大厦25楼J1单元
法人代表: 薛峰
联系人: 薛峰
联系电话: 0755-33229500
传真电话: 0755-33229078
客服电话: 020-89629666
公司网站: www.fund.com

(78) 上海天基基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号26楼
法人代表: 宋其
联系人: 宋其
联系电话: 021-54509998
传真电话: 021-64385308
联系人: 潘冰
客服电话: 400-1818-1188
公司网站: www.123456.com.cn

(79) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东新区1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法人代表: 杨文斌
联系人: 杨文斌
联系电话: 021-58701111
传真电话: 021-58709116
联系人: 张裕
客服电话: 400-700-1234
公司网站: www.howbuy.com

(80) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前文一路1218号1幢202室
办公地址: 杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法人代表: 陈柏青
联系人: 陈柏青
联系电话: 021-60899200
传真电话: 021-60899200
联系人: 张裕
客服电话: 400-888-6168
公司网站: www.fund.com

(81) 上海长量基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高路55号5号楼1010室
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心2层16-17楼
法人代表: 张亚东
联系人: 张亚东
联系电话: 021-20361888
传真电话: 021-20361888
联系人: 徐慧
客服电话: 400-821-5399
公司网站: www.shzq.com.cn

(82) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址: 杭州市文二西路1号903室
办公地址: 浙江省杭州市西湖区西溪路55号电子商务产业园2号楼2楼
法人代表: 凌顺平
联系人: 凌顺平
联系电话: 0571-88891818
传真电话: 0571-88890423
联系人: 吴强
客服电话: 4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com

(83) 上海利基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区东长治路668号1503室
办公地址: 上海市虹口区东长治路668号1503室
法人代表: 李晓明
联系人: 李晓明
联系电话: 021-50383533
传真电话: 021-50383533
联系人: 曹佳真
客服电话: 400-067-6266
公司网站: www.lifund.com

(84) 北京创金财富投资管理有限公司
注册地址: 北京市西城区德胜门内大街31号5号楼215A
办公地址: 北京市西城区德胜门内大街31号5号楼215A
法人代表: 梁蓉
联系人: 梁蓉
联系电话: 010-6614828
传真电话: 010-6614828
联系人: 张磊
客服电话: 400-626-8188
公司网站: www.sinc.com.cn

(85) 宜信普华投资咨询有限公司
注册地址: 北京市朝阳区望京东路88号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区望京东路88号9号楼15层1809
法人代表: 李博
联系人: 李博
联系电话: 010-5285713
传真电话: 010-5285713
联系人: 孙莹
客服电话: 400-626-8188
公司网站: www.yixinfund.com

(86) 南京苏宁基金销售有限公司
注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
法人代表: 王峰
联系人: 王峰
联系电话: 025-66996922
传真电话: 025-66996922
联系人: 王峰
客服电话: 400-9665-555
公司网站: www.snj.com.cn

(87) 北京北信基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法人代表: 李晨
联系人: 李晨
联系电话: 010-65958345
传真电话: 010-65983333
联系人: 张林
客服电话: 400-066-8886
公司网站: www.bxj.com.cn

(88) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址: 北京市西城区中关村大街11号1108号

办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
法人代表: 王华
联系人: 王华
联系电话: 010-56282140
传真电话: 010-56282827
联系人: 丁向坤
客服电话: 400-491-9059
公司网站: www.hycfund.com

(89) 上海大智慧投资管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区杨高南路428号11号楼
办公地址: 上海市浦东新区杨高南路428号11号楼1108室
法人代表: 申健
联系人: 申健
联系电话: 021-20219188
传真电话: 021-20219123
联系人: 吕娟
客服电话: 021-20292031
公司网站: http://78.gov.com.cn

(90) 北京新石合信基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环北路88号现代国际大厦906室
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路88号现代国际大厦906室
法人代表: 李强
联系人: 李强
联系电话: 010-65174782/65231189
传真电话: 010-65174782/65231189
联系人: 魏强
客服电话: 400-057-8855
公司网站: www.kstresource.com

(91) 济安财富(北京)投资管理有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼406室406单元
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼406室406单元
法人代表: 杨健
联系人: 杨健
联系电话: 010-63906369
传真电话: 010-63906369
联系人: 李海龙
客服电话: 400-673-7010
公司网站: www.jianfund.com

(92) 上海万得投资管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼
法人代表: 王瑾
联系人: 王瑾
联系电话: 021-53271875
传真电话: 021-50710161
联系人: 姜灵宇
客服电话: 400-821-0203
公司网站: www.wand.com.cn

(93) 上海君德信投资管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼
法人代表: 王瑾
联系人: 王瑾
联系电话: 021-53271875
传真电话: 021-50710161
联系人: 姜灵宇
客服电话: 400-821-0203
公司网站: www.jundexin.com

(94) 上海华信证券有限责任公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼
法人代表: 王瑾
联系人: 王瑾
联系电话: 021-53271875
传真电话: 021-50710161
联系人: 姜灵宇
客服电话: 400-821-0203
公司网站: www.lantai.com

(95) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址: 上海市崇明县长海镇路路园公路1800号2号楼6153室 上海和经路发
办公地址: 上海市杨浦区淞阳路518号 A1002室
法人代表: 王琦
联系人: 王琦
联系电话: 021-63370077
传真电话: 021-58809911
联系人: 蓝杰
客服电话: 400-820-3369
公司网站: www.fund.com.cn

(96) 上海嘉银基金销售有限公司
注册地址: 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
法人代表: 李昊
联系人: 李昊
联系电话: 021-33333319
传真电话: 021-63332523
联系人: 李晓明
客服电话: 400-178-0000
公司网站: www.jiayin.com

(97) 上海金浦资产管理股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区东明路1333号14楼09单元
办公地址: 上海市浦东新区东明路1333号14楼09单元
法人代表: 陈宇华
联系人: 陈宇华
联系电话: 021-20666952
传真电话: 021-20666952
联系人: 宁博宇
客服电话: 4008219031
公司网站: www.jinfund.com

(98) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址: 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
法人代表: 肖雯
联系人: 肖雯
联系电话: 020-89629099
传真电话: 020-89629011
联系人: 黄妮妮
客服电话: 020-89629666
公司网站: www.yingmi.com

(99) 中证金融信息服务股份有限公司
注册地址: 北京市丰台区东三环中路1号2号楼2-45室
办公地址: 北京市宣武门大街11号环球金融中心A座5层
法人代表: 彭运年
联系人: 彭运年
联系电话: 010-59336529
传真电话: 010-59336510
联系人: 魏珍珍
客服电话: 400-8909-998
公司网站: www.jnlc.com

(100) 北京肯特瑞资产管理股份有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东三环东路128号4层401-15
办公地址: 北京市朝阳区东三环东路128号4层401-15
法人代表: 王萍
联系人: 王萍
联系电话: 010-89189291
传真电话: 010-89189800
联系人: 徐晋芳
客服电话: 95118
公司网站: www.fund.com

(101) 深圳市中泰证券有限公司
注册地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路16号方大科技大厦18楼18号方大科技大厦18F
办公地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路16号方大科技大厦18楼18号方大科技大厦18F
法人代表: 赖钰璋
联系人: 赖钰璋
联系电话: 0755-66929201
传真电话: 0755-66929201
联系人: 张博
客服电话: 400-9500-888
公司网站: www.zntz.com

(102) 北京嘉实基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区望京东路1号6号楼3单元21层
办公地址: 北京市朝阳区望京东路1号6号楼3单元21层
法人代表: 钟斐斐
联系人: 钟斐斐
联系电话: 010-61848600
传真电话: 010-61848699
联系人: 杨文斌
客服电话: 400861818
公司网站: danjiampp.com

(103) 上海夏财投资管理有限公司
注册地址: 上海市虹口区东长治路687号1幢A座208室
办公地址: 北京市朝阳区金台路8号上海国金中心2层16-17楼
法人代表: 李一梅
联系人: 李一梅
联系电话: 010-88066632
传真电话: 010-88066522
联系人: 钟欣
客服电话: 400-817-5656
公司网站: www.amcfund.com

(三) 其他
基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加或调整本基金代销机构,并及时公告。
名称: 富国基金管理有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心2层16-17楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心2层16-17楼
法人代表: 陈伟东
联系人: 陈伟东
联系电话: 021-42036188
传真电话: 021-42036188
联系人: 徐慧
客服电话: 400-821-5399
公司网站: www.fund.com

润、货币政策等;
[3] 估值(Valueuation Factory): 评估股指期货中短期资金流;
[4] 市值(Market Factors): 评估股指期货绝对、相对估值业绩调整;
[5] 市场(Market Factors): 评估股指期货绝对、相对估值业绩调整。
2. 股票投资策略
本基金将运用“价值为、成长为导向”的合理价格或投资价值来确定具体选股标准。该策略通过建立一套的价值评估指标,综合考虑上市公司的增长潜力和市值估值水平,以寻找具有增长潜力且价格合理或低估的标的。
同时,本基金将综合考虑股票投资的确定性、持续性与成长性,通过精细化风险管理和技术化投资,实现行业与风格资产的均衡配置,从而实现对风险调整后收益的最大化。
(1) 第一类: 价值量化筛选
本基金重点关注由上而下量化筛选过程产生的股票样本:
本基金重点关注指标包括: 净资产收益率(ROE)、市盈率(P/E)、总市值/市净率(P/B)、主营业务收入增长率、净利润增长率等;
(2) 第二类: 成长型股票筛选
成长型股票筛选: 选取PB、PE较低的上市公司股票;
(3) 第三类: 市值量化筛选
成长型股票筛选: 选取总市值/市净率(P/B)较低、主营业务收入增长率、净利润增长率排名靠前的上市公司股票。
(4) 第四类: 行业轮动策略
在量化筛选的基础上,本基金将基于“定性定分析相结合、动态静态指标相结合”的原则,进一步筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。
基金管理人将通过运用(定性的)财务分析模型和资产估值模型,重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相关价值等方面;通过运用(定量的)上市公司质量评价模型,重点关注上市公司的治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、历史业绩和经营策略等方面。
3. “自上而下”的债券投资策略
本基金将采用自上而下”的投资策略,对债券类资产进行合理的配置,并在此框架下选择并持有债券品种。
基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析,国内财政政策与货币市场政策以及结构调整趋势(包括: 资金面结构的调整、投资组合的国内、国际资产配置和创新)对债券市场的演进,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,制定久期策略及债券品种配置方案,力争在控制风险的前提下,实现投资组合收益的稳定增长。
在债券投资组合构建和管理过程中,基金管理人将具体采用久期控制、期限结构管理、市场转换、相对价值投资、信用风险择时等管理手段。
(1) 久期控制: 根据利率预期调整投资组合久期,通过久期控制实现预期收益目标。
(2) 期限结构管理: 在确定组合久期后,基金管理人将对收益率曲线形态进行预期,确定合理的组合期限结构,通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等,在长期、中期与短期债券间进行动态调整,从长中、短期债券的相对价格变化中获利。
(3) 信用风险控制: 基金管理人将对所有信用债进行信用评级,在充分研究风险-收益特征、流动性特性的基础上构建与调整组合(包括债券资产类别),以求提高投资收益。
(4) 相对价值判断: 基金管理人将在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对合理的债券品种进行投资,并选择恰当的时机,增持相对低估、价格将上升的品种,减持相对高估的品种。
(5) 信用风险管理: 基金管理人将对信用债的信用风险进行跟踪,根据主体经营状况及现金流等情况对其信用风险进行动态评估,以此作为品种选择的基本依据。
债券投资策略制定与贯彻的同时,也是基金管理人对于投资组合动态评估与管理的体现。基金管理人将定期对投资组合的风险状况进行评估,及时发现投资组合中存在的风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的风险水平,力求在控制风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(1) 信用风险管理: 基金管理人将对信用债的信用风险进行跟踪,根据主体经营状况及现金流等情况对其信用风险进行动态评估,以此作为品种选择的基本依据。
(2) 流动性风险管理: 基金管理人将定期对投资组合的流动性进行跟踪,及时发现投资组合中存在的流动性风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的流动性水平,力求在控制流动性风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(3) 市场风险管理: 基金管理人将定期对投资组合的市场风险进行跟踪,及时发现投资组合中存在的市场风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的市场风险水平,力求在控制市场风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(4) 操作风险管理: 基金管理人将定期对投资组合的操作风险进行跟踪,及时发现投资组合中存在的操作风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的操作风险水平,力求在控制操作风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(5) 合规风险管理: 基金管理人将定期对投资组合的合规风险进行跟踪,及时发现投资组合中存在的合规风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的合规风险水平,力求在控制合规风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(6) 声誉风险管理: 基金管理人将定期对投资组合的声誉风险进行跟踪,及时发现投资组合中存在的声誉风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的声誉风险水平,力求在控制声誉风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(7) 其他风险管理: 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(8) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(9) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(10) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(11) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(12) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(13) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(14) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(15) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(16) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(17) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(18) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(19) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(20) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(21) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(22) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(23) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(24) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(25) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(26) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(27) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(28) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(29) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(30) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(31) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(32) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(33) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(34) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(35) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(36) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(37) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(38) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(39) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(40) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(41) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(42) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(43) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(44) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(45) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(46) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(47) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(48) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(49) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(50) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(51) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(52) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险的前提下,实现投资组合收益的最大化。
(53) 基金管理人将根据法律法规的要求,及时识别、评估、监测、报告投资组合中的其他风险,并制定相应的风险管理策略,通过调整投资组合的其他风险水平,力求在控制其他风险