

(上B67页)

(96) 乾道嘉源基金销售有限公司(北京)有限公司
住所:北京海淀区东直门南大街7号1712室
办公地址:北京西城区德胜门内大街1号院1号楼1302室
法定代表人:王兴吉
电话:(010)62802880
传真:(010)62803741
联系人:高洪雷
客户服务电话:400-888-0880
网址:www.qdgs.com

(97) 上海好得得投资管理有限公司
住所:北京市海淀区高亮桥东路2号401-415
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街101号京东集团总部
法定代表人:陈超
电话:(010)98811111,4000888816
传真:(010)98188800
联系人:赵海鹏
客户服务电话:4000888111,4000888816
网址:www.hdd.com

(98) 北京新浪金石私募基金销售有限公司
住所:北京市西城区东直门桥南中关村软件园二期(即)“N-1、2”地块新总部研发楼518室
办公地址:北京朝阳区东北旺西路中关村软件园二期(即)“N-1、N-2”地块新浪总部研发楼518室
法定代表人:李海琛
电话:(010)166619607
传真:8610-42676582
联系人:付文江
客户服务电话:(010)62673669
网址:www.xindao.com

(99) 杭州轩地投资管理有限公司
住所:杭州下城区时代商务中心1604室
办公地址:杭州下城区上塘路15号武林时代T2楼
法定代表人:高翔
电话:(0571)85270600
传真:(0571)85262000
联系人:胡晓敏
客户服务电话:(0571)86659120
网址:www.xdli.com

(100) 北京康惠基金销售有限公司
住所:北京朝阳区东三环北路16号院6号楼2单元2225F
办公地址:北京市朝阳区望京SOHO塔3C座1502室2507
法定代表人:钟爱琴
电话:(010)61860868
传真:(010)61860499
联系人:王静
客户服务电话:400-0618-518
网址:https://daman.com

(101) 上海爱建信托有限公司
住所:宁夏回族自治区银川市金凤区凤凰湾中央商务区万寿路142号1416号1402750000
办公地址:北京朝阳区亮马桥18号院爱建高科技产业园8号楼(100000)
法定代表人:程勇
电话:(010)58160168
传真:(010)58160173
联系人:董旭
客户服务电话:400-810-5919
网址:www.aed.com

(102) 深圳市金子基金销售有限公司
住所:深圳市福田区前海深港现代物流园6号方东金融大厦8楼
办公地址:深圳市福田区香梅路1001号科兴科学园B3单元3楼
法定代表人:高翔
电话:(0755)16699201
传真:(0755)16699290
联系人:李博
客户服务电话:400-9500-888
网址:www.jzfund.com

(103) 上海朝阳永丰基金销售有限公司
住所:上海浦东新区世纪大道999号909室1202室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道660号4号2楼
法定代表人:廖冰
电话:(021)80234888
传真:(021)80234899
联系人:李博
客户服务电话:400-609-1888
网址:www.yongfengfund.com

(104) 上海信投理财有限公司
住所:北京朝阳区东三环北路19号院151009室
办公地址:北京朝阳区东三环北路19号院151009室
法定代表人:李景琴
电话:(010)45983333
联系人:张林
客户服务电话:400-366-8866
网址:www.xinfund.com

(105) 民生证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区民生路1199弄民生大道101号1601-1602室
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄民生大道101号1601-1602室
法定代表人:冯鹤年
电话:(021)33383302
传真:(021)33383376
联系人:李博
客户服务电话:400-676-5716
网址:www.mszq.com

(106) 苏州康融基金销售有限公司
住所:江苏省苏州市高新区华元路99号4幢1002室
办公地址:江苏省苏州市高新区华元路199号7号楼1011室
法定代表人:高志华
电话:(0512)68607367
传真:(0512)68607367
联系人:李博
客户服务电话:(0512)68603767
网址:www.konrong.com

(107) 上海爱建信托有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号1108B
办公地址:上海市浦东新区福山路33号1108B
法定代表人:程勇
电话:(021)50712782
联系人:徐丹丹
客户服务电话:400-821-0203
网址:www.aed.com

(108) 天津爱建信托有限公司
住所:天津市滨海新区天津大道1988号滨海新区大厦公区2-2412室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦
法定代表人:程鹤群
电话:(010)58303828
联系人:李博
客户服务电话:(021)50712782
联系人:王芳芳
客户服务电话:(010)5013842
网址:www.aed.com

(109) 上海好得得投资管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道89号上海国金中心二期25层512F-1512F-1512F-1512F
办公地址:北京市朝阳区福润园9号地中A座A901室
法定代表人:程勇
电话:(021)58303828
联系人:李博
客户服务电话:(021)50712782
联系人:王芳芳
客户服务电话:(010)5013842
网址:www.aed.com

(110) 上海好得得投资管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号1108B
办公地址:上海市浦东新区福山路33号1108B
法定代表人:程勇
电话:(021)58303828
联系人:李博
客户服务电话:(021)50712782
联系人:王芳芳
客户服务电话:(010)5013842
网址:www.aed.com

基金管理人有权根据法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代销销售本基金,并及时公告。

(二) 注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平门大街2号
办公地址:北京市西城区太平门大街2号
法定代表人:周明
电话:(010)59368817
联系人:周明
电话:(010)59368817
联系人:周明

(三) 律师事务所

名称:上海锦天城律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号19楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号19楼
法定代表人:廖卫
电话:(021)31338666
联系人:朱圣宇
经办律师:廖卫、薛莹、朱圣宇

基金名称:交银施罗德稳健回报证券投资基金

五、基金的投资

基金投资组合策略

本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的30%,固定收益资产包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券及分离可转债、资产支持证券、次级债、债券回购等金融工具;对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;其中权证投资期限在一年以内的权证的投资比例不高于基金资产净值的3%,权证不包括备兑权证;可转债投资比例不高于基金资产净值的3%,可转债不包括可转债分离可转债。

八、基金的投资策略

本基金充分发掘基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究与积极主动的投资风格相结合,在分析判断宏观经济形势和证券市场运行趋势的基础上,合理配置大类金融资产,并根据市场运行状况,自上而下进行投资组合调整,在“自上而下”的行业分析基础上,综合考量信用债的信用风险、以及各类型信用债的流动性、供求关系等因素水平,自上而下地确定行业,同时,本基金高度重视个股、行业、市场及宏观经济基本面因素,挖掘潜在投资机会,在严格控制基金资产运作风险的基础上,把握投资机会,力争为基金份额持有人创造长期稳定的超额投资回报。

1. 大类资产配置

本基金分析和判断国内外宏观经济形势的基础上,通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合,对宏观经济形势和证券市场运行趋势,在基金资产配置的范围内确定固定收益资产、权益类资产和现金的配置比例,并随着市场环境变化及各类型资产配置比例的变化,动态调整大类资产的投资比例,有效控制基金资产运作风险,提高基金资产风险调整后收益。

2. 债券投资策略

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

3. 股票投资策略

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

4. 权证投资策略

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

5. 衍生品投资策略

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

6. 资产支持证券投资策略

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

7. 可转换债券投资策略

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

8. 风险管理

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

9. 基金业绩比较基准

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

10. 基金的风险收益特征

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

11. 基金的投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

12. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

13. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

14. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

15. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

16. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

17. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

18. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

19. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

20. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

21. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

22. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

23. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

24. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

25. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

26. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

27. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

28. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

29. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

30. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

31. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

32. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

33. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

34. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

35. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

36. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

37. 基金投资组合报告

本基金采取自上而下的投资策略,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险,久期策略原则上是一种自上而下的,通过合理的久期控制来规避利率波动带来的投资风险。

2. 报告期内未按行业分类的流通股投资比例投资组合

本基金本报告期末未持有流通股投资比例投资组合

3. 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300695	欣旺达	49,980	2,301,046.00	1.06
2	000681	视界中国	60,000	1,722,000.00	0.81
3	600315	上海石化	40,000	1,585,200.00	0.75
4	300055	通裕重工	60,000	1,224,000.00	0.58
5	300177	联讯股份	75,000	1,218,000.00	0.57
6	300407	浩信生物	50,000	1,091,000.00	0.49

4. 报告期内按品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家开发	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债	11,543,700.00	5.43
4	企业债	11,543,700.00	5.43
5	企业短期融资券	130,957,407.40	61.41
6	企业中期融资券	--	--
7	中期票据(可交换)	40,237,000.00	18.93
8	中期票据	--	--
9	其他	--	--
10	其他	102,758,977.90	48.96

5. 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122514	12国债新	20,000	20,124,000.00	9.47
2	101562046	15沪17F003	20,000	20,114,000.00	9.46
3	116647	16国债02	20,000	19,766,000.00	9.30
4	136493	16国债01	20,000	19,174,000.00	9.02
5	130022	13国债新	30,000	18,564,000.00	8.73

6. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券

7. 报告期内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

本基金本报告期末未持有贵金属

8. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

9. 报告期内本基金投资的前十名股票中,投资于沪港通股票的投资明细

本基金本报告期末未持有沪港通股票

10. 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货

11. 股指期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货

12. 基金资产构成

序号	项目	金额(元)
1	转出投资款	169,561.34
2	应收证券清算款	--
3	应收利息	--
4	应收股利	3,647,731.17
5	其他应收款	12,884.20
6	其他流动资产	--
7	其他资产	--
8	其他	--
9	合计	3,834,176.71

13. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票中,投资于沪港通股票的投资明细

本基金本报告期末未持有沪港通股票

14. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

15. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

16. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

17. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

18. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

19. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

20. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

21. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

22. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

23. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

24. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

25. 报告期内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

本基金本报告期末未持有权证

26. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序