



# 前海开源睿远稳健增利混合型 证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

截止日：2015年7月14日

## 重要提示

本基金经 2014 年 11 月 26 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2014]1268 号文注册募集，基金合同已于 2015 年 1 月 14 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、投资股指期货的风险、本基金特有的风险及其他风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 7 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日 2015 年 6 月 30 日（未经审计）。

本基金托管人广发证券股份有限公司已于 2015 年 8 月 7 日复核了本次更新的招募说明书。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
- 3、设立日期：2013年1月23日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169
- 9、联系人：曾季平
- 10、注册资本：人民币2亿元
- 11、存续期限：持续经营
- 12、股权结构：开源证券股份有限公司出资1/4，北京市中盛金期投资管理有限公司出资1/4，北京长和世纪资产管理有限公司出资1/4，深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）出资1/4。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任开源证券总经理、前海开源基金管理有限公司董事长。

王宏远先生，联席董事长，西安交通大学硕士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，国籍：中国。曾任深圳特区证券有限公司行业研究员，南方基金管理有限公司投资总监、副总经理，中信证券股份有限公司首席投资官、自营负责人，现任前海开源基金管理有限公司联席董事长。

蔡颖女士，董事、公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

孔大路先生，董事，国籍：中国。曾任职华夏银行，中国民生银行总行国际部、信贷部、公司业务部副处长、处长、总经理助理，交通银行天津分行行长助理、副行长等，现任北京市中盛金期投资管理有限公司副董事长。

刘新华先生，董事，高级经济师，博士后，国籍：中国。历任广东证券研究中心负责人、泰阳证券研究中心负责人、广东省广业资产经营公司规划部副部长、华夏基金管理有限公司机构产品部副总监（主持工作）、广东金海资产管理有限公司总经理。

范镭先生，董事，本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。

向松祚先生，独立董事，教授，高级经济师，国籍：中国。著名经济学家、国际金融战略专家，中国人民大学博士，美国哥伦比亚大学国际关系学院国际事务硕士，英国剑桥大学经济系和嘉丁管理学院访问学者。现任中国农业银行首席经济学家、中国人民大学财政金融学院教授、国际货币研究所理事兼副所长、美国约翰霍普金斯大学应用经济研究所高级顾问、国际货币基金机构官方论坛（OMFIF）顾问委员会副主席、世界经济论坛（World Economic Forum）国际货币体系改革分论坛咨询顾问。

申嫦娥女士，独立董事，博士，教授，博士生导师，中国注册会计师（非执业会员），国家税务总局特邀监察员（2003-2010），国籍：中国。历任西安交通大学助教、讲师、副教授，北京师范大学副教授、教授。

姚树洁先生，独立董事，教授，国籍：英国。英国诺丁汉大学当代中国学院院长、教授，西安交通大学特聘讲座教授、重庆大学、华南师范大学、华南农业大学、华中农业大学、渭南师范学院等大学的特聘教授、海南大学经济管理学院荣誉院长；英国皇家经济学会会员、英国中国经济协会会员、美国比较经济学协会会员、美国经济协会会员；全英专业团体联合会副主席；《经济研究》、《西安交通大学学报社科版》、《当代中国》（英文）等科学杂志的编委。曾任华南热带农业大学助理教授，英国牛津大学研究员，英国朴茨茅斯大学教授、主任，英国伦敦米德尔塞克斯大学教授、系主任。

## 2、基金管理人监事会成员

孔令国先生，监事会主席，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中信证券股份有限公司交易与衍生品部研究员、投资经理助理、前海开源基金管理有限公司专户投资部投资经理，现任前海开源基金管理有限公司专户投资部副总监。

李东骞先生，监事，美国注册金融分析师（CFA），工学硕士、工商管理硕士，国籍：中国。历任美国前沿（FORE）基金管理有限公司高级经理，中信证券股份有限公司交易与衍生产品业务部副总裁、投资经理助理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金经理、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理。

任福利先生，监事，大学本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行辽宁省分行、

泰达宏利基金管理有限公司基金运营部、方正富邦基金管理有限公司基金运营部，现任前海开源基金管理有限公司基金事务部总监。

张学玲女士，监事，会计师，国籍：中国。历任武汉大学财务部副部长。

刘纯斌先生，监事，经济学硕士，中国注册会计师、经济师、律师，国籍：中国。历任交通银行深圳分行大信大厦支行行长，深圳市明星康桥投资发展有限公司董事长兼总经理，中诚国际（香港）有限公司副总裁，广东省龙门茶排铅锌矿有限公司财务总监，深圳中金投资管理有限公司财务总监。

### 3、高级管理人员情况

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任开源证券总经理、前海开源基金管理有限公司董事长。

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

李志祥先生，首席运营官，本科学历，经济师，国籍：中国。历任湖北省黄冈市体改委副科长，深圳市农产品股份有限公司秘书科科长，大鹏证券有限责任公司业务秘书，南方基金管理有限公司高级经理，前海开源基金管理有限公司督察长。现任前海开源基金管理有限公司首席运营官、董事会秘书、前海开源资产管理（深圳）有限公司董事。

傅成斌先生，督察长，硕士研究生，国籍：中国。历任中国建设银行深圳分行科技部软件开发工程师，南方基金管理有限公司信息技术部总监助理、监察稽核部副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司督察长、风险控制委员会主席。

### 4、本基金基金经理

刘静女士，经济学硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金经理。刘静女士具备基金从业资格。

### 5、投资决策委员会成员情况

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部

电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

王厚琼先生，工程学士，国籍：中国。历任南方证券武汉分公司证券部副经理，南方证券有限公司资产管理部副处长，南方基金管理有限公司交易管理部主管、交易管理部总助理兼中央交易室主管、交易管理部副总监兼中央交易室主管。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、投资决策委员会主席。

赵雪芹女士，经济学博士研究生，国籍：中国。历任山东财经大学讲师、海通证券股份有限公司首席分析师、中信证券股份有限公司首席分析师。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

侯燕琳女士，工程硕士、管理学硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理、基金经理；益民基金管理有限公司投资总监、基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

刘静女士，经济学硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金经理。

丁骏先生，经济学博士，国籍：中国。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师，国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理，长盛基金管理有限公司行业研究员、机构理财部组合经理助理，基金同盛、长盛同智基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

罗大林先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、专户部投资经理，中信证券股份有限公司自营部高级投资经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理。

付柏瑞先生，硕士，国籍：中国。历任华宝兴业基金管理有限公司分析师；农银汇理基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理。2009年4月至2014年4月担任农银汇理基金管理公司农银平衡双利基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

李东骞先生，美国注册金融分析师（CFA），工学硕士、工商管理硕士，国籍：中国。历任美国前沿（FORE）基金管理有限公司高级经理，中信证券股份有限公司交易与衍生产品

业务部副总裁、投资经理助理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金经理、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理。

曲扬先生，博士研究生，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、南方全球精选基金经理，2009年11月至2013年1月担任南方基金香港子公司投资经理助理、投资经理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金经理、前海开源国家比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

徐立平先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司行业研究员，中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

薛小波先生，流体力学硕士，国籍：中国。历任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

邱杰先生，经济学硕士，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究部行业研究员、中小盘股票研究员、制造业组组长；建信基金管理有限公司研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、研究负责人、前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金基金经理、前海开源再融资主题精选股票型证券投资基金基金经理、前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王霞女士，会计学硕士，注册会计师，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源沪深300指数型证券投资基金基金经理、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

孙亚超先生，数学科博士后，国籍：中国。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员；光大证券理财产品部量化产品系列负责人；齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、产品二部负责人；前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金经理、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金经理、前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金经理。

谢屹先生，金融与经济数学、工程物理学硕士，国籍：德国。历任汇丰银行（德国）股票研究所及投资银行部分析师、高级分析师、副总裁。现任前海开源基金管理有限公司

执行投资总监、前海开源金银珠宝主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈晓晨女士，工商管理硕士，国籍：中国。历任工银瑞信基金管理有限公司交易员、中信证券股份有限公司交易与衍生品部交易员、投资经理助理、前海开源基金管理有限公司交易部总监，现任前海开源基金管理有限公司投资副总监、前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：广发证券股份有限公司（简称：广发证券）

住所：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼、7 楼、18 楼、19 楼、36 楼、38 楼、39 楼、41 楼、42 楼、43 楼和 44 楼

法定代表人：孙树明

成立时间：1994 年 1 月 21 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 7,621,087,664 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510 号

联系人：王玮

联系电话：020-87555888

广发证券成立于 1991 年，是国内首批综合类证券公司。公司先后于 2010 年和 2015 年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所主板上市（股票代码：000776.SZ，1776.HK）。公司营业网点遍布全国各主要经济区域，截至 2014 年 12 月 31 日，公司有证券营业部 249 个。

截至 2014 年 12 月 31 日，公司旗下拥有五家全资子公司，分别是广发期货有限公司、广发控股（香港）有限公司、广发信德投资管理有限公司、广发乾和投资有限公司和广发证券资产管理（广东）有限公司，控股广发基金管理有限公司，并持股易方达基金管理有限公司和广东金融高新区股权交易中心有限公司等公司，间接全资持有广发金融交易（英国）有限公司（伦敦金属交易所 LME 第一类交易会员）和广发证券（加拿大）有限公司，形成了以证券业务为核心、业务跨越境内外的金融控股集团架构。

截至 2014 年 12 月 31 日，公司合并报表资产总额 2401.00 亿元，归属于母公司股东的所有者权益 396.11 亿元；2014 年合并报表实现营业收入 133.95 亿元，实现利润总额 66.49 亿元，实现归属于母公司股东的净利润为 50.23 亿元。资本实力及盈利能力在国内



证券行业持续领先，总市值居国内上市证券公司前列。

广发证券设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经历，具备基金从业资格，员工的学历均在本科以上，专业分布合理，是一支诚实勤勉、积极进取的资产托管从业人员团队。

## 2、主要人员情况

孙树明先生，博士。历任财政部条法司科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长，河北涿州市人民政府挂职副市长，中国经济开发信托投资公司办公室主任、总裁助理，中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，中国银行业监督管理委员会正局级专职监事，中国银河证券有限公司监事会正局级专职监事，中国证监会会计部副主任、主任。现任广发证券党委书记、董事长。

杨龙先生，博士。曾任职于天津市政府研究室、水利局办公室、广发证券深圳红宝路营业部总经理、深圳业务总部总经理、经纪业务总部常务副总经理、人力资源管理部副总经理、银证通营销中心总经理、联通华建网络有限公司顾问、广发证券总经理助理兼深圳分公司总经理。现任广发证券副总经理。

刘洋先生，硕士。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。现任广发证券资产托管部总经理。

## 3、基金托管业务经营情况

广发证券于2014年5月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。截至2015年6月，广发证券已托管宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合、长信利广灵活配置混合型证券投资基金7只证券投资基金。

### （二）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

广发证券严格遵守国家有关托管业务的法律法规、监管规则和内部规章制度，防范和化解基金托管业务经营风险，保证托管资产的安全完整；维护基金份额持有人的合法权益；确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律法规、监管规则及相关合同、协议的规定；保障托管业务安全、有效、稳健运行。

#### 2、内部控制组织结构

广发证券风险控制委员会对资产托管业务的风险管理与内部控制进行监督和评价。广发证券风险管理部负责拟定风险管理政策、对业务进行风险监控和评估；广发证券合规与

法律事务部负责托管业务法律审核与合规检查；广发证券稽核部对托管业务的内部控制进行独立、客观的检查和监督。资产托管部设置专门的内部控制岗，配备了专职监察稽核人员，对业务的运行独立行使监督稽核职权。各业务岗位在各自范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部控制制度及措施

广发证券制订了完善的托管业务管理制度，包括《广发证券证券投资基金托管业务管理办法》、《广发证券资产托管业务内部控制大纲》、《广发证券证券投资基金托管业务操作规程》、《广发证券证券投资基金托管业务会计核算规定》、《广发证券证券投资基金托管业务基金清算管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务投资监督管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务信息披露管理规定》、《广发证券资产托管业务印章及加密设备管理规定》、《广发证券资产托管业务授权管理办法》、《广发证券证券投资基金托管业务系统维护管理规定》、《广发证券资产托管部岗位备份及员工轮岗管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务保密与档案管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务重大可疑情况报告规定》、《广发证券证券投资基金托管业务应急处理流程》、《广发证券证券投资基金托管业务从业人员管理规定》、《广发证券资产托管部员工投资证券投资基金管理办法》等。确保托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度；授权工作实行集中控制；业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人工操作风险，技术系统完整、独立。

#### （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

根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规以及基金合同、基金托管协议相关规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规或基金合同、基金托管协议相关规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、直销机构

（1）前海开源基金管理有限公司直销柜台

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：王兆华

联系人：曾季平

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

（2）前海开源基金管理有限公司网上交易

网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

客户服务电话：4001-666-998

##### 2、代销机构：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	广发证券股份有限公司	注册地址：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 5、18、19、36、38、39、41-43 楼 法定代表人：孙树明 联系人：黄岚 电话：(020)87555888 客服电话：95575 网址： <a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>
2	中国建设银行股份有限公司	注册地址：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 联系人：张静 客服电话：95533 网址： <a href="http://www.ccb.com">www.ccb.com</a>
3	交通银行股份有限公司	办公地址：上海市银城中路 188 号 法定代表人：牛锡明 联系人：曹榕 联系电话：(021)58781234 客服电话：95559 网址： <a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a>

4	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 邮政编码：518028 法定代表人：杨懿 联系人：张燕 电话：010-58325388-1588 传真：010-58325300 客服电话：400-116-1188 网址： <a href="http://8.jrj.com.cn/">http://8.jrj.com.cn/</a>
5	和讯信息科技有限公司	地址：北京朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人：王莉 联系人：于杨 电话：(021)20835779 客服电话：4009-200-022 网址： <a href="http://www.hexun.com">www.hexun.com</a>
6	诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12F 法定代表人：汪静波 联系人：徐诚 电话：(021)38509639 传真：(021)38509777 客服电话：400-821-5399 网址： <a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a>
7	深圳众禄基金销售有限公司	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 联系人：童彩平 电话：(0755)33227950 客服电话：4006-788-887 网址： <a href="http://www.zlfund.cn">www.zlfund.cn</a> , <a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a>
8	上海天天基金销售有限公司	地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼 法定代表人：其实 客服电话：4001-818-188 网址： <a href="http://www.1234567.com.cn">www.1234567.com.cn</a>
9	上海好买基金销售有限公司	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 客服电话：400-700-9665 网址： <a href="http://www.ehowbuy.com">www.ehowbuy.com</a>
10	杭州数米基金销售有限公司	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 联系人：徐映绯 电话：(021)60897840 传真：(0571)26697013 客服电话：4000-766-123 网址： <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>

11	上海长量基金销售投资顾问有限公司	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 客服电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com
12	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：浙江省杭州市文二西路元茂大厦 903 室 办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼 法定代表人：凌顺平 联系人：吴强 电话：(0571)88911818 传真：(0571)88910240 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com
13	北京展恒基金销售有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号 办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层 法定代表人：闫振杰 联系人：王琳 电话：010-62020088 传真：010-62020355 客服电话：400-888-6661 网址：www.myfund.com
14	中期资产管理有限公司	地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号 法定代表人：朱剑林 客服电话：(010)65807609 网址：www.cifcofund.com
15	万银财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元 办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元 法定代表人：王斐 电话：(010)59393923 传真：(010)59393074 客服电话：4008-080-069 网址：www.wy-fund.com
16	北京增财基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号 办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号 法定代表人：罗细安 联系人：李皓 电话：010-67000988 传真：010-67000988-6000 客服电话：400-001-8811 网址：www.zcvc.com.cn

17	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人：梁越 联系人：马鹏程 电话：010-57756084 传真：010-57756199 客服电话：4008-980-618 网址：www.chtfund.com
18	一路财富（北京）信息科技有限公司	注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室 办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208 法定代表人：吴雪秀 联系人：段京璐 电话：010-88312877 传真：010-88312099 客服电话：400-001-1566 网址：www.yilucaifu.com
19	泰诚财富基金销售（大连）有限公司	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 联系人：李春光 电话：18640999991 传真：0411-84396536 客服电话：400-6411-999 网址：www.taichengcaifu.com
20	上海汇付金融服务有限公司	办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼 法定代表人：张晶 电话：021-33323999-8318 客服电话：400-820-2819 网址：www.ttyfund.com
21	中国国际期货有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层 办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层 法定代表人：王兵 联系电话：(010)59539999 传真：(010)59539806 客服电话：95162 网址：www.cifco.net
22	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址：北京市朝内大街188号 法定代表人：王常青 联系人：张颢 电话：(010)85156398 传真：(010)65182261 客服电话：4008-888-108 网址：www.csc108.com

23	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层 法定代表人：何如 联系人：周杨 电话：(0755)82130833 传真：(0755)82133952 客服电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
24	中信证券股份有限公司	注册地址：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：顾凌 联系电话：(010)60838696 客服电话：95548 网址：www.cs.ecitic.com
25	中国银河证券股份有限公司	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：陈有安 联系人：宋明 联系电话：(010)66568450 传真：(010)66568990 客服电话：4008-888-888 网址：www.chinastock.com.cn
26	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市广东路 689 号 办公地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：王开国 联系人：李笑鸣 联系电话：(021)23219000 客服电话：95553 网址：www.htsec.com
27	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 法定代表人：李梅 联系人：曹晔 电话：(021) 33389888 传真：(021) 33388224 电话委托：(021)962505 客服电话：95523, 4008-895-523 网址：www.swhysc.com
28	安信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、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 楼、28 层 A02 单元 法定代表人：牛冠兴 联系电话：(0755)82555551 客服电话：4008-001-001 网址：www.essence.com.cn

29	中信证券（浙江）有限责任公司	注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 层 办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 层 法定代表人：沈强 联系人：李珊 电话：(0571)85776114 客服电话：95548 网址：www.bigsun.com.cn
30	山西证券股份有限公司	地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：侯巍 客服电话：400-666-1618、95573 网址：www.i618.com.cn
31	中信证券（山东）有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 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 联系人：吴忠超 电话：(0532)85022326 客服电话：95548 网址：www.zxwt.com.cn
32	信达证券股份有限公司	地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人：张志刚 联系人：唐静 电话：(010)63080985 客服电话：4008-008-899 网址：www.cindasc.com
33	光大证券股份有限公司	地址：上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人：薛峰 联系人：刘晨 电话：(021)22169081 客服电话：95525 传真：(021)22169134 网址：www.ebscn.com
34	大同证券有限责任公司	注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 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 层 法定代表人：董祥 联系人：薛津 联系电话：(0351) 4130322 客服电话：4007-121-212 网址：www.dtsbc.com.cn
35	华安证券股份有限公司	注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 办公地址：合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室（230081） 法定代表人：李工 联系人：甘霖 电话：(0551)65161821 传真：(0551)65161672 客服电话：4008-096-518 公司网址：www.hazq.com



36	东莞证券股份有限公司	地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 法定代表人：张运勇 客服电话：(0769) 961130 网址：www.dgzq.com.cn
37	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人：许建平 电话：(010)88085858 传真：(010)88085195 联系人：李巍 客服电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com
38	齐鲁证券有限公司	地址：山东省济南市经七路86号 法定代表人：李玮 联系人：吴阳 电话：(0531)68889155 客服电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn
39	中国国际金融股份有限公司	地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27、28层 法定代表人：丁学东 客服电话：400-910-1166 网址：www.cicc.com.cn
40	华鑫证券有限责任公司	地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 法定代表人：俞洋 联系人：陈敏 电话：(021)64316642 客服电话：(021)32109999, (029)68918888, 4001-099-918 网址：www.cfsc.com.cn
41	中山证券有限责任公司	注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层 办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层 法定代表人：黄扬录 联系人：刘军 电话：(0755)82943755 传真：(0755)82960582 客服电话：4001-022-011 公司网址：www.zszq.com
42	华融证券股份有限公司	地址：北京市西城区金融大街8号A座3层 法定代表人：祝献忠 联系人：黄恒 联系电话：(010)58568235 传真：(010)58568062 客服电话：400-898-9999 网址：www.hrsec.com.cn

43	开源证券股份有限公司	注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 办公地址：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 联系人：付琦 电话：(029)81887087 客服电话：400-860-8866 网址：www.kysec.cn
44	上海联泰资产管理有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼 联系人：汤蕾 电话：021-51507071 传真：021-62990063 客服电话：4000-466-788 网址：www.91fund.com.cn
45	中信期货有限公司	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：张磊 联系人：洪诚 电话：0755-23953913 客服电话：400-990-8826 网址：www.citicsf.com

## （二）登记机构

名称：前海开源基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼

法定代表人：王兆华

联系人：任福利

电话：（0755）83180910

传真：（0755）83181121

## （三）律师事务所和经办律师

名称：广东信达律师事务所

注册地址：深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦12楼

负责人：麻云燕

经办律师：杨扬、胡云云

电话：（0755）88265288

传真：（0755）88265537

## （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层

法定代表人：杨剑涛

联系人：胡立新

经办会计师：洪祖柏、胡立新

电话：（010）88095588

传真：（010）88091199

#### 四、基金名称

前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型

#### 六、基金的运作方式

开放式

#### 七、基金的投资

##### （一）投资目标

本基金重点投资于债券和现金类资产，力争在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

##### （二）投资范围

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股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、次级债券、短期融资券、地方政府债、债券回购等）、银行存款、资产支持证券、货币市场工具、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的0-30%；债券、现金等其他金融工具占基金资产的比例不低于70%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产

净值的 5%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

### （三）投资策略

本基金的投资策略主要有以下六方面内容：

#### 1、大类资产配置

在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金通过对债券等固定收益类、股票等权益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。

#### 2、债券投资策略

在债券投资策略方面，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

#### 3、股票投资策略

本基金精选有良好增值潜力的股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手，定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素；定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况，比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标，优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

#### 4、可转债策略

基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等，

本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。

#### 1) 个券选择策略

本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略，在严格控制风险的前提下，精选具有投资价值的可转换债券，力争实现较高的投资收益。

#### 2) 转股策略

转股期内，当本基金所持有可转换债券市场交易价格显著低于转股平价时，即转股溢价率明显为负时，本基金将通过转股并卖出股票以实现收益；当可转换债券流动性不能满足组合需求时，本基金将通过转股来保障基金财产的流动性；当正股价格上涨且满足提前赎回触发条件时，本基金将首先通过转股来锁定已有收益，并进一步分析正股未来的价格走势，做出继续持有正股或立即卖出的决定。

#### 3) 条款博弈策略

本基金将深入分析公司基本面，包括经营状况和财务状况，预测其未来发展战略和融资需求，结合流动性、到期收益率、纯债溢价率等因素，充分发掘这些条款给可转换债券带来的投资机会。

#### 4) 套利策略

本基金将密切关注以下两种套利机会：a) 在可转换债券的转股期内，当转换溢价率为负时，可以买入可转换债券并及时转股，然后在二级市场卖出股票，以获取套利收益；b) 在可转换债券发行期内，当可转换债券的优先配售条款具有吸引力时，可以买入股票并配售可转换债券，待其上市后再卖出，以获取收益。

#### 5、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

#### 6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期

货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### （四）投资决策依据及程序

##### 1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

##### 2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（4）投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

（5）根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由集中交易室执行。

（6）集中交易室按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

（7）基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

（8）风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

#### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%。

业绩比较基准选择理由：

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

沪深300指数是由中证指数公司编制发布、表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了

沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人与基金托管人协商后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

## （六）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

## （七）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的0-30%；债券、现金等其他金融工具占基金资产的比例不低于70%；
- （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- （3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
- （5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- （6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
- （7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- （8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
- （9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
- （10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
- （11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
- （12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有

资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%；

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(18) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(19) 本基金所持有的股票市值、权证和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）比例为0-30%；

(20) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

(21) 本基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同



的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## （八）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## （九）基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

## （十）基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 7 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2015 年 6 月 30 日（未经审计）。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,511,968.49	0.68
	其中：股票	22,511,968.49	0.68
2	固定收益投资	110,798,640.20	3.33
	其中：债券	110,798,640.20	3.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	700,000,000.00	21.03
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,084,426,505.30	32.58
7	其他资产	1,410,319,876.95	42.38
8	合计	3,328,056,990.94	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,547,775.00	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,577,190.22	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	517,786.92	0.02
F	批发和零售业	5,546,904.27	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,536,620.68	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,785,691.40	0.08

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,511,968.49	0.68

### 3. 报告期末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	300005	探路者	222,401	6,093,787.40	0.19
2	600280	中央商场	399,921	5,546,904.27	0.17
3	002447	壹桥海参	203,822	2,547,775.00	0.08
4	600138	中青旅	100,000	2,112,000.00	0.06
5	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.04
6	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.03
7	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.02
8	300479	神思电子	9,600	434,688.00	0.01
9	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.01
10	002768	国恩股份	14,405	362,429.80	0.01

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	99,080,000.00	3.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,263,927.00	0.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,454,713.20	0.04
8	其他	-	-

9	合计	110,798,640.20	3.37
---	----	----------------	------

**5. 报告期末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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	159905	15 贴现国债 05	1,000,000	99,080,000.00	3.01
2	122354	15 康美债	100,000	10,171,000.00	0.31
3	110031	航信转债	5,800	842,798.00	0.03
4	113008	电气转债	3,380	611,915.20	0.02
5	122645	12 苏园建	1,000	82,690.00	0.00

**6. 报告期末按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明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7. 报告期末按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. 报告期末按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. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**
**9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**
**10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**11. 投资组合报告附注**

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	322,494.13

2	应收证券清算款	1,409,363,385.21
3	应收股利	-
4	应收利息	633,997.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,410,319,876.95

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300467	迅游科技	1,107,739.80	0.03	重大事项

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 八、基金的业绩

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资产，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。

#### 前海开源睿远稳健增利混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015.1.14-2015.6.30	9.50%	0.59%	6.53%	0.36%	2.97%	0.23%

#### 前海开源睿远稳健增利混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

				④		
2015.1.14-2015.6.30	8.60%	0.59%	6.53%	0.36%	2.07%	0.23%

注：本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%。

## 九、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.6%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十、其他应披露事项

（一）本基金管理人的董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理（深圳）有限公司（以下简称“前海开源资管公司”）兼职及领薪情况如下：

本基金管理人总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长、法定代表人；

本基金管理人首席运营官、董事会秘书李志祥先生兼任前海开源资管公司董事；

本基金管理人滕大江先生兼任前海开源资管公司监事；

本基金管理人联席投资总监付柏瑞先生兼任前海开源资管公司联席总经理；

本基金管理人专户投资部员工龚自勇、张卫华、陈新、李隽、黄锦良兼任前海开源资管公司投资经理。

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。

本基金管理人除上述人员以外未有其他董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

（三）2015年1月14日至2015年7月14日披露的公告：

时间	公告
2015-07-14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加新兰德为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-03	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中期资产为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-02	关于前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金继续暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告
2015-07-01	前海开源基金管理有限公司旗下基金2015年半年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告
2015-06-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行申购费率优惠活动的公告
2015-06-26	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加泰诚财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-24	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加汇付金融为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-18	关于前海开源睿远稳健增利混合基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告
2015-06-12	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加增财基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-12	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中信期货为代销机构并开通定投和转换业务的公告
2015-06-12	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加联泰资产为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投费率优惠活动的公告
2015-06-10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加一路财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-05-28	关于前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金参与申万宏源证券、申万宏源西部证券申购费率优惠活动的公告
2015-05-27	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与诺亚正行费率优惠活动的公告
2015-05-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加诺亚正行为代销机构并开通定投业务的公告
2015-05-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与开源证券费率优惠活动的公告
2015-04-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告
2015-04-23	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加众禄基金费率优惠活动的公告
2015-04-22	前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金2015年第1季度报告
2015-04-18	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加展恒基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-04-04	前海开源基金管理有限公司关于转换业务实行申购补差费率在直销机构新增支付



	渠道优惠的公告
2015-03-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下证券投资基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告
2015-03-25	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在申万宏源证券、申万宏源西部证券开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-03-04	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与齐鲁证券申购费率优惠活动的公告
2015-02-28	前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告
2015-02-28	关于前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告
2015-02-28	关于前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金增加中山证券、好买基金为代销机构的公告
2015-02-10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中信证券（山东）、中国国际金融为代销机构的公告
2015-01-15	前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金合同生效公告

## 十一、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、中国证监会准予注册前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照

### （二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

## 十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、对“基金管理人”相关信息进行了更新，包括股权结构、董监高人员信息等。
- 2、在“相关服务机构”部分，对代销机构名单进行了更新。
- 3、对“基金的募集”相关信息进行了更新。
- 4、对“基金合同的生效”相关信息进行了更新。

5、对“基金份额的申购与赎回”相关信息进行了更新，包括基金申购费率、开放、定投、转换等。

6、在“基金的投资”部分，增加了“（十）基金的投资组合报告”、“（十一）基金的业绩”。

7、在“其他应披露事项”部分，披露了本基金管理人董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理（深圳）有限公司兼职及领薪情况；披露了2015年1月14日至2015年7月14日期间涉及本基金的公告。

8、对部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一五年八月二十七日