

# 国联安锐意成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)

## 摘要

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

### 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2016 年 12 月 1 日证监许可[2016]2934 号文准予注册募集。

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做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。

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。

投资有风险，投资者在认购或申购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的买者自负原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金资产净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，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，自主判断基金的投资价值，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作

出独立决策，并自行承担投资风险。投资者根据所持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：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险。本基金属于混合型证券投资基金，属于中等预期风险、中等预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2017 年 7 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期：2017 年 1 月 23 日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

法定代表人：庾启斌

成立日期：2003 年 4 月 3 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]42 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期限：五十年或股东一致同意延长的其他期限

电话：（021）38992888

联系人：茅斐

股权结构：

股东名称 持股比例

国泰君安证券股份有限公司 51%

德国安联集团 49%

## （二）、主要人员情况

### 1、董事会成员

（1）虞启斌先生，董事长，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国联安基金管理有限公司董事长。

（2）谭晓雨女士，公司总经理，经济学硕士，国务院特殊津贴专家，高级经济师。历任君安证券有限公司研究所行业部研究员、二级研究员及高级研究员；国泰君安证券股份有限公司研究所副所长、咨询部总经理及财富管理部联席总经理。现任国联安基金管理有限公司总经理职务。

（3）JiachenFu（付佳晨）女士，董事，工商管理学士。2007年起进入金融行业，历任安联集团董事会事务主任、安联全球车险驻中国业务发展主管兼创始人，忠利保险公司内部顾问，戴姆勒东北亚投资有限公司金融及监控部成员，美国克赖斯勒汽车集团市场推广及销售部学员。现任安联资产管理公司驻中国业务董事兼业务拓展总监，管理董事会成员。

（4）EugenLoeffler先生，董事，经济与政治学博士。2017年3月底退休前，担任安联投资管理新加坡公司行政总裁/投资总监，负责监督安联亚洲保险实体的投资管理事务。1990年起进入金融行业，他历任安联全球投资韩国公司董事总经理/投资主管、安联全球投资亚太区投资总监、安联苏黎世公司投资总监、安联苏黎世房地产及安联资产管理苏黎世公司行政总裁、安联投资管理公司环球股票团队主管、安联全球投资韩国公司主席及行政总裁、安联人寿韩国公司投资总监、安联资产管理香港办事处投资总监兼主管、安联资产管理欧洲股票研究部主管、安联慕尼黑总部财务部工作（股票/长期参与计划投资管理）。

（5）汪卫杰先生，董事，经济学硕士，会计师职称。1994年起进入金融行业，历任君安证券有限责任公司财务部主管、稽核部副总经理、资金计划部副总经理、长沙营业部总经理、财务总部总经理、深圳分公司总经理助理、计划财务总部总经理、国泰君安证券股份有限公司计划财务总部总经理、资产负债管理委员会专职主任委员、子公司管理小组主任。现任国泰君安证券股份有限公司纪委副书记、纪检监察室主任。

（6）程静萍女士，独立董事，高级经济师职称。历任上海市财政局副科长、副处长、处长、局长助理，上海市财政局、税务局副局长，上海市计划委员会、上海市发展计划委员会副主任兼上海市物价局局长、上海市发展和改革委员会副主任、第十届全国人大代表、上海市决策咨询委员会专职委员。现任上海银行独立董事。

（7）王鸿斌女士，独立董事，法学士。历任台湾摩根资产管理旗下的怡富证券投资信托有限公司副总经理、怡富证券投资顾问公司总经理，中国摩根资产管理董事总经理、上投摩根基金管理有限公司总经理。现任上海富汇财富投资管理有限公司董事长。

（8）胡斌先生，独立董事，特许金融分析师(CFA)，美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA)、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理公司担任 StandishMellon 量化分析师、公司副总裁，CoefficientGlobal 公司创始人之一兼基金经理。2007年11月起，担任梅隆资产管理中国区负责人。2010年7月起，于纽银梅隆西部基金管理有限公司担任首席执行官（总经理）。现任上海系数股权投资基金管理合伙企业（有限合伙）担任总经理。

### 2、监事会成员

（1）王越先生，监事会主席，大专学历。1975年3月参加工作，历任上海民生中学会计、上海城市建设学院财务科副科长等职务。1993年7月加入原国泰证券，历任国泰证券国际业务部副经理、国际业务部经理、国际业务部副总经理等职务，1999年8月公司合并后至2000年9月任国泰

君安证券公司会计部副总经理；现任国泰君安证券稽核审计部副总经理。

(2) Uwe Michel 先生，监事，法律硕士。历任慕尼黑 AllianzSE 亚洲业务部主管、主席办公室主任、AllianzLifeInsuranceJapanLtd. 主席及日本全国主管、德国慕尼黑 GroupOPEX 安联集团内部顾问主管。现任慕尼黑 AllianzSE 业务部 H3 投资与亚洲主管。

(3) 朱慧女士，职工监事，经济学学士，历任国泰证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司财务部副经理，现任国联安基金管理有限公司财务部总监。

(4) 刘涓女士，职工监事，经济学学士，现任国联安基金管理有限公司基金事务部副总监。

### 3、高级管理人员

(1) 庾启斌先生，董事长，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国联安基金管理有限公司董事长。

(2) 谭晓雨女士，公司总经理，经济学硕士，国务院特殊津贴专家，高级经济师。历任君安证券有限公司研究所行业部研究员、二级研究员及高级研究员；国泰君安证券股份有限公司研究所副所长、咨询部总经理及财富管理联席总经理。现任国联安基金管理有限公司总经理职务。

(3) 刘轶先生，督察长，法学博士。曾先后任职于中国建设银行辽宁省分行、中国民生银行北京管理部、中国证券监督管理委员会、全国人民代表大会财政经济委员会证券法修改工作小组，并曾在南开大学等从事研究工作。

(4) 李柯女士，副总经理，经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理，现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(5) 魏东先生，副总经理，经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；2003 年 1 月加盟华宝兴业基金管理有限公司，先后担任交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理和华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009 年 6 月加入国联安基金管理有限公司，先后担任总经理助理、投资总监的职务。2009 年 9 月起，担任国联安德盛精选股票证券投资基金的基金经理。2009 年 12 月至 2011 年 8 月，兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月起，兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(6) 满黎先生，副总经理，研究生学历。曾任职于华安基金管理有限公司，先后担任上海分公司高级投资顾问、西安分公司总经理、华东业务总部总经理、北京总部高级董事总经理；2012 年 9 月加盟国联安基金管理有限公司，担任市场总监。自 2012 年 11 月起，担任国联安基金管理有限公司副总经理。

### 4、基金经理

王超伟，硕士研究生。2008 年 7 月至 2011 年 8 月在国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部任投资经理。2011 年 8 月至 2015 年 9 月在国泰君安证券股份有限公司权益投资部任投资经理。2015 年 9 月加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理。2016 年 2 月起担任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月起任国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月起任国联安锐意成长混合型证券投资基金基金经理。5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益

业务负责人、研究部负责人及高级基金经理 1-2 人(根据需要)组成。投资决策委员会成员为:

谭晓雨(总经理)投委会主席

魏东(投资总监、副总经理)投委会执行主席

邹新进(投资组合管理部总监)

杨子江(研究部总监)

高级基金经理 1-2 人(根据需要)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### (一)基金托管人概况

##### 1.基本情况

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称中国民生银行)

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

成立时间:1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101 号

组织形式:其他股份有限公司(上市)

注册资本:28,365,585,227 元人民币

存续期间:持续经营

电话:010-58560666

联系人:罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行,同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了快速健康的发展势头。

2000 年 12 月 19 日,中国民生银行 A 股股票(600016)在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日,中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上海交易所正式挂牌交易。2004 年 11 月 8 日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券,成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行,为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009 年 11 月 26 日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来,按照团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为,敬业守法;讲究质量,提高效益,健康发展的经营方针,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了大集中科技平台、两率考核机制、三卡工程、独立评审制度、八大基础管理系统、

集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2010年2月3日，在卓越2009年度金融理财排行榜评选活动中，中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评，荣获卓越2009年度金融理财排行榜十佳电子银行奖。

2010年10月，在经济观察报主办的2009年度中国最佳银行评选中，民生银行获得评委会奖中国银行业十年改革创新奖。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓越的银行而特别设立的。

2011年12月，在由中国金融认证中心（CFCA）联合近40家成员行共同举办的2011中国电子银行年会上，民生银行荣获2011年中国网上银行最佳网银安全奖。这是继2009年、2010年荣获中国网上银行最佳网银安全奖后，民生银行第三次获此殊荣，是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的高度肯定。

2012年6月20日，在国际经济高峰论坛上，民生银行贸易金融业务以其2011-2012年度的出色业绩和产品创新最终荣获2012年中国卓越贸易金融银行奖项。这也是民生银行继2010年荣获英国《金融时报》中国银行业成就奖最佳贸易金融银行奖之后第三次获此殊荣。

2012年11月29日，民生银行在《TheAsset》杂志举办的2012年度AAA国家奖项评选中获得中国最佳银行-新秀奖。

2013年度，民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构最佳资金托管银行及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届21世纪亚洲金融年会上，民生银行荣获2013亚洲最佳投资金融服务银行大奖。

在2013第五届卓越竞争力金融机构评选中，民生银行荣获2013卓越竞争力品牌建设银行奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书（2013）》中，民生银行荣获中国企业上市公司社会责任指数第一名、中国民营企业社会责任指数第一名、中国银行业社会责任指数第一名。

在2013年第十届中国最佳企业公民评选中，民生银行荣获2013年度中国最佳企业公民大奖。

2013年还获得年度品牌金博奖品牌贡献奖。

2014年获评中国银行业协会最佳民生金融奖、年度公益慈善优秀项目奖。

2014年荣获《亚洲企业管治》第四届最佳投资者关系公司大奖和2014亚洲企业管治典范奖。

2014年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予亚洲贸易金融创新服务称号。

2014年还荣获《亚洲银行家》中国最佳中小企业贸易金融银行奖，获得《21世纪经济报道》颁发的最佳资产管理私人银行奖，获评《经济观察报》年度卓越私人银行等。

2015年度，民生银行在《金融理财》举办的2015年度金融理财金貔貅奖评选中荣获金牌创新力托管银行奖。

2015年度，民生银行荣获《EUROMONEY》2015年度中国最佳实物黄金投资银行称号。

2015年度，民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书（2015）》中国银行业社会责任发展指数第一名。

2015年度，民生银行在《经济观察报》主办的2014-2015年度中国卓越金融奖评选中荣获年度卓越创新战略创新银行和年度卓越直销银行两项大奖。

## 2、主要人员情况

杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

## 3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 66 人，平均年龄 36 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承诚信、严谨、高效、务实的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2017 年 6 月 30 日，中国民生银行已托管 170 只证券投资基金，托管的证券投资基金总净值达到 4829.73 亿元。中国民生银行于 2007 年推出托付民生安享财富托管业务品牌，塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象，赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评，深化了与客户的战略合作。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的最具潜力托管银行、最佳创新托管银行和金牌创新力托管银行奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的最佳金融服务托管银行奖。

### (二)基金托管人的内部控制制度

#### 1.内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

#### 2.内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部控制组织结构由中国民生银行股份有限公司审计部、资产托管部内设风险监督中心及资产托管部各业务中心共同组成。总行审计部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的风险监督中心，负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划，组织、指导、协调、监督各业务中心风险控制工作的实施。各业务中心在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

#### 3.内部风险控制原则

(1)全面性原则：风险控制必须覆盖资产托管部的所有中心和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则：资产托管部设立独立的风险监督中心，该中心保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则：各中心在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

#### 4.内部风险控制制度和措施

(1)制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估：风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6)应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 5.资产托管部内部控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2)实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

#### (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《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，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确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项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有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### 四、相关服务机构

##### (一) 基金份额发售机构

###### (1) 直销机构

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

法定代表人：虞启斌

客户服务电话：(021) 38992888

联系人：茅斐

网址：[www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com) 或 [www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com)

###### (2) 其他销售机构

1) 名称：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

联系电话：010-57092592

联系人：徐野

客服电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

2) 名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系电话：0755-82960167

联系人：黄婵君

客服电话：95555

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

3) 名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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：杨德红

联系电话：（021）38032284

联系人：钟伟镇

客服电话：95521

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

4) 名称：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：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

电话：010-67596084

联系人：王琳

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

5) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

电话：021-61616192

联系人：吴斌

客服电话：95528

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

6) 名称: 海通证券股份有限公司

住所: 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: 周杰

电话: 021-23219275

联系人: 李楠

客服电话: 95553

网址: [www.htsec.com.cn](http://www.htsec.com.cn)

7) 名称: 东吴证券股份有限公司

住所: 苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址: 苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人: 范力

电话: 0512-65581136

联系人: 魏纯

客服电话: 95330

网址: [www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

8) 名称: 申万宏源证券有限公司

住所: 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

电话: 021-33388211

联系人: 黄莹

客服电话: 95523 或 4008895523

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

9) 名称: 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: 上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

电话：021-38509735

联系人：张裕

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

10) 名称：上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-58870011

联系人：张茹

客户服务电话：400-700-9665

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

11) 名称：上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C-9 楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C-9 楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998

联系人：朱玉

客户服务电话：400-181-8188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

12) 名称：北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

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：010-62020088

联系人：翟飞飞

客户服务电话：400-818-8000

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

13) 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

14) 名称：深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：广东省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：0755-33227950

联系人：童彩平

客户服务电话：400-678-8887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

15) 名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：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

联系电话：021-20691832

联系人：胡雪芹

客户服务电话：400-820-2899

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

16) 名称：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：010-67000988

联系人：李皓

客户服务电话：400-001-8811

网址：<http://www.zcvc.com.cn>

17) 名称：上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

电话：021-50583533

联系人：曹怡晨

客户服务电话：400-921-7755

网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

18) 名称：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 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

联系人：吴强

客户服务电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

19) 名称：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：周斌

电话：400-898-0618

联系人：张晔

客户服务电话：400-898-0618

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

20) 名称：北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO1006-1008

法定代表人：赵荣春

电话：010-57418813

联系人：崔丁元

客户服务电话：400-893-6885

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

21) 名称：浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：徐黎云

电话：0571-88337529

联系人：邵俊

客户服务电话：400-068-0058

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

22) 名称：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：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层A区

法定代表人：马勇

电话：15810206817

联系人：张燕

客户服务电话：400-166-1188

网址: <http://8.jrj.com.cn/>

23) 名称: 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 15 楼

法定代表人: 鲍东华

电话: 021-20665952

联系人: 宁博宇

客户服务电话: 400-821-9031

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

24) 名称: 北京虹点基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙楼 2 层 222 单元

办公地址: 北京市朝阳区工体北路甲 2 号盈科中心 B 座裙房 2 层

法定代表人: 胡伟

电话: 010-85643600

联系人: 葛亮

客户服务电话: 400-068-1176

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

25) 名称: 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: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人: 燕斌

电话: 021-52822063

联系人: 兰敏

客户服务电话: 4000-466-788

网址: <http://www.66zichan.com>

26) 名称: 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 层

法定代表人：袁顾明

电话：021-22267943

联系人：朱真卿

客户服务电话：4009-282-266

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

27) 名称：一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：88312877

联系人：段京璐

客户服务电话：400-001-1566

网址：<http://www.yilucaifu.com/>

28) 名称：珠海盈米财富管理有限公司

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

法定代表人：肖雯

电话：020-89629099

联系人：吴煜浩

客户服务电话：020-89629066

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

29) 名称：奕丰金融服务（深圳）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（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人：TANYIKUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460507；0755-89460500

客户服务电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

30) 名称：深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址：广东省深圳市南山区智慧广场第 A 栋 11 层 1101-02

办公地址：广东省深圳市南山区科苑路 18 号东方科技大厦 18 楼

法定代表人：赖任军

电话：0755-84034499

联系人：张烨

客户服务电话：4009-500-888

网址：<http://www.jfzinv.com/>

31) 名称：武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法人代表：陶捷

电话：027-87006003（8026）

联系人：陆锋

客户服务电话：400-027-9899

网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

32) 名称：上海万得投资顾问有限公司

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：王廷富

电话：021-51327185

联系人：021-50710161

客户服务电话：400-821-0203

33) 名称: 深圳富济财富管理有限公司

注册地址: 深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

办公地址: 深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

法人代表: 刘鹏宇

电话: 0755-83999907-819

联系人: 马力佳

客户服务电话: 0755-83999907

网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

34) 名称: 北京电盈基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号36层3603室

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B室

法人代表: 程刚

电话: 010-56176118

联系人: 张旭

客户服务电话: 400-100-3391

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

35) 名称: 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

法人代表: 王伟刚

电话: 010-62680827

联系人: 丁向坤

客户服务电话: 400-619-9059

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

36) 名称: 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21&28 层

法人代表：蒋煜

电话：010-58170876

联系人：徐晓荣/刘聪慧

客户服务电话：400-818-8866

网址：<http://www.shengshiview.com/>

37) 名称：深圳前海微众银行股份有限公司

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：广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

法人代表：顾敏

电话：0755-89462447

联系人：罗曦

客户服务电话：400-999-8877

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

38) 名称：上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济功能区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法人代表：王翔

电话：021-65370077-209

联系人：俞申莉

客户服务电话：021-65370077

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

39) 名称：杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法人代表：陈刚

电话：0571-85267500

联系人：胡璇

客户服务电话：0571-86655920

网址：www.cd121.com

40) 名称：上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法人代表：陈继武

电话：021-63333389

联系人：王哲宇

客户服务电话：4006-433-389

网址：<https://www.lingxianfund.com>

41) 名称：深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

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 6019 号金润大厦 23A

法人代表：高锋

电话：0755-83655588

联系人：廖苑兰

客户服务电话：400-804-8688

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

42) 名称：贵州华阳众惠基金销售有限公司

注册地址：贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区 C 栋标准厂房

办公地址：贵州省贵阳市云岩区北京路 9 号君派大厦 16 楼

法人代表：李陆军

电话：0851-86909950

联系人：陈敏

客户服务电话：400-839-1818

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

43) 名称: 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法人代表: 钟斐斐

电话: 010-61840688

联系人: 戚晓强

客户服务电话: 4000618518

网址: <https://danjuanapp.com/>

基金管理人可以根据相关法律法规要求, 调整或选择其他符合要求的机构销售本基金, 并及时公告。

#### (二) 登记机构

名称: 国联安基金管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

法定代表人: 鹿启斌

联系人: 茅斐

电话: 021-38992863

#### (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

联系人: 安冬

电话: 021-31358666

传真: 021-31358600

经办律师: 安冬、孙睿

#### (四) 审计基金财产的会计师事务所

名称: 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

办公地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

负责人：蔡廷基

联系人：王国蓓

联系电话：021-22122888

传真：021-62881889

经办注册会计师：王国蓓、张楠

## 五、基金的名称

本基金名称：国联安锐意成长混合型证券投资基金

## 六、基金的类型

本基金类型：混合型

## 七、基金的投资目标

精选具有较高成长性 & 盈利质量的上市公司，在严格控制投资风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

## 八、基金的投资范围

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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、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。

本基金股票投资占基金资产的 60%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；在每个交易日日终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以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，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。

## 九、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。

### 2、股票投资策略

本基金主要从定量和定性两个方面对上市公司进行分析。

#### 1) 定量分析

本基金从获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平等方面对上市公司进行定量分析。

首先，通过 ROIC(ReturnOnInvestedCapital)指标来衡量公司的获利能力，通过 WACC(WeightedAverageCostofCapital)指标来衡量公司的资本成本，将公司的获利能力和资本成本指标相结合，选择出创造价值的公司。

其次，对公司的成长能力和估值指标以及财务指标进行分析：

成长指标主要包括：主营业务收入增长率、净利润增长率；

估值指标主要包括：市盈率、市盈率/净利润增长率；

财务指标主要包括：净资产收益率、资产负债率。

本基金将重点关注公司的主营业务收入增长率、净利润增长率等成长性指标。

主营业务收入增长率是把握公司成长性的主要指标。本基金将在考察历史主营业务收入增长率的基础上，结合分析公司的产能扩张、主导产品的市场供求变化趋势、行业竞争格局以及产品的差异性 or 替代性等因素，参考上市公司的存货周转率、应收账款周转率指标，准确把握预期主营业务收入增长的质量和有效性。

主营业务利润率是企业一定时期主营业务利润同主营业务收入净额的比率。它表明企业每单位主营业务收入所产生的主营业务利润，反映了企业主营业务的获利能力。公司主营业务突出，即主营业务利润率较高，表明其在竞争中占据优势地位。

## 2) 定性分析

本基金将把握中长期中国经济结构调整的方向，通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等因素的分析，确定宏观及行业经济变量对不同行业的潜在影响，判断各行业的相对投资价值与投资时机。本基金从经济周期因素、行业政策因素和行业基本面（包括行业生命周期、行业发展趋势和发展空间、行业内竞争态势、行业收入及利润增长情况等）三个方面评估行业的成长性。

本基金进一步从技术优势、资源优势和商业模式等方面，把握公司的成长性。

技术优势分析。较强的技术优势和可持续的研发能力及研发投入，可以促使公司所掌握的技术不断转化为新产品或服务，为公司成长提供动力。

本基金通过分析公司拥有的专利和专有技术的数量、新产品的数量及推出的速度、核心技术是否具有较高的竞争壁垒、产品和研发上的经费投入情况等，判断公司的技术优势及其可持续性。

资源优势分析。垄断资源可以为公司在较长时期内的发展提供较好的利润来源。对于具有特许权、专有技术、品牌等独特资源或者矿产、旅游等自然资源的公司，本基金将主要通过对公司的行业垄断性、进入壁垒、政策扶持力度等方面的分析，判断公司的资源优势是否支持其持续成长。

商业模式分析。公司的商业模式决定了其在行业中的地位和发展潜力，独特的商业模式将支持公司的快速发展。本基金将从商业模式的独特性、可复制性、可持续性 & 赢利性等角度考察公司的商业模式是否符合行业发展的趋势、是否可以维持公司销售规模和盈利的持续增长。

## 3、普通债券投资策略

在债券投资上，本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

(1) 信用等级高、流动性好；

(2) 资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；

(3) 在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；

(4) 公司基本面良好,具备良好的成长空间与潜力,转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。

#### 4、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的中小型企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市中小企业,企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司,信息披露情况相对滞后,对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司,且定向发行方式限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券的投资将重点关注信用风险和流动性风险。

本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,对中小企业私募债券进行分类,以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。

本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良,估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。

#### 5、股指期货投资策略

在股指期货投资上,本基金以套期保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中,将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究现货和期货市场的发展趋势,运用定价模型对其进行合理估值,谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调整投资组合仓位,以降低组合风险、提高组合的运作效率。

#### 6、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证的投资。

(1) 综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素,根据BS模型和溢价率对权证的合理价值做出判断,对价值被低估的权证进行投资;

(2) 基于对权证标的股票未来走势的预期,充分利用权证的杠杆比率高的特点,对权证进行单边投资;

(3) 基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断,将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资,或利用权证进行风险对冲。

#### 7、资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,结合蒙特卡洛模拟等数量化方法,对资产支持证券进行定价,评估其内在价值进行投资。

对于监管机构允许基金投资的其他金融工具,本基金将在谨慎分析收益性、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资,以降

低组合风险，实现基金资产的保值增值。

#### 十、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 60%+上证国债指数收益率 40%。

沪深 300 指数由专业指数提供商中证指数有限公司编制和发布，由从上海和深圳证券交易所中选取的 300 只 A 股作为样本股编制而成。该指数以成份股的自由流通股数进行加权，指数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和市场影响力。

上证国债指数全称为上海证券交易所国债指数，是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。其编制方法借鉴了国际成熟市场主流债券指数的编制方法和特点，并充分考虑了国内债券市场发展的现状，具备科学性、合理性、简便性和易于复制等优点。

上证国债指数可以表征整个中国国债市场的总体表现。

如果今后法律法规发生变化，或指数编制机构调整或停止该等指数的发布，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比较基准的指数时，基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### 十一、风险收益特征

本基金属于混合型证券投资基金，属于中高预期风险、中高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

#### 十二、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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保证责任。

本基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核本招募说明书中的财务指标、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 2017 年 6 月 30 日，本报告财务资料未经审计师审计。

##### 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 159,261,666.91 65.46

其中：股票 159,261,666.91 65.46

2 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 --

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 73,371,031.61 30.16

7 其他各项资产 10,676,935.94 4.39

8 合计 243,309,634.46 100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 --

B 采矿业 -

-

C 制造业 137,679,227.29 57.03

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 7,310,000.00 3.03

F 批发和零售业 7,553,000.00 3.13

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 1,419,639.62 0.59

J 金融业 --

K 房地产业 3,151,800.00 1.31

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 2,148,000.00 0.89

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 --

5 综合 --

合计 159,261,666.91 65.97

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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 600309 万华化学 170,000 4,868,800.00 2.02

2 600276 恒瑞医药 90,000 4,553,100.00 1.89

3 000963 华东医药 90,000 4,473,000.00 1.85

4 002508 老板电器 100,000 4,348,000.00 1.80

5 002572 索菲亚 105,000 4,305,000.00 1.78

6 600519 贵州茅台 9,000 4,246,650.00 1.76

7 000651 格力电器 100,000 4,117,000.00 1.71

8 002372 伟星新材 220,000 4,109,600.00 1.70

9 002271 东方雨虹 110,000 4,081,000.00 1.69

10 000858 五粮液 70,000 3,896,200.00 1.61

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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持有股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。

套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货

### 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持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门

立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 100,289.73

2 应收证券清算款 9,704,783.05

3 应收股利 -

4 应收利息 18,353.57

5 应收申购款 853,509.59

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 10,676,935.94

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

### 十三、基金的业绩

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。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

国联安锐意成长：

基金份额净值增长率 同期业绩比较基准收益率 - 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率标准差 -

2017-1-23 至 2017-6-30 8.93% 5.72% 3.21% 0.65% 0.35% 0.30%

### 十四、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/期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、账户开户费用、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 0.9%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.9\% \times \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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：

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

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

基金托管费每日计算，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、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按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \times \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，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划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同约定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费专门用于基金的销售与基金份额持有人服务等。

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。

#### 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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，对本基金管理人于2016年12月15日刊登的本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、更新了三、基金管理人部分的内容。
- 2、更新了四、基金托管人部分的内容。
- 3、更新了五、相关服务机构部分的内容。
- 4、更新了六、基金的募集部分的内容。
- 5、更新了七、基金合同的生效部分的内容。
- 6、更新了九、基金的投资部分的内容。
- 7、新增了十、基金的业绩部分的内容。
- 8、更新了二十二、其他应披露事项部分的内容。

国联安基金管理有限公司

二〇一七年九月五日