（上接 D25 版）

联系人：陈铭洲
客服电话：400-068-1176
网址：www.jimu.com
（33）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元
办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层
法人代表：赵学军
电话：010-60842306
联系人：李雯
客服电话：400-021-8850
网站：www.harvestwm.cn
（34）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 6 号丹棱 soho1008-1012
法人代表：赵荣春
电话：18501250851
联系人：陈剑炜
客服电话：400-893-6885
网站：www.dyxtw.com
（35）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：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：021-65681111-119
联系人：徐江
客服电话：400-641-1999
网站：www.taichengziben.com
（36）北京加和基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层
办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404
法人代表：徐福星
电话：13811685981
联系人：王晨
客服电话：400-600-0030
网址：www.bzfunds.com
（37）深圳富济基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
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
法人代表：齐小贺
电话：0755-83999907-806
联系人：刘勇
客服电话：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn
（38）上海汇付基金销售有限公司
注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
办公地址：上海市徐汇区虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼
法人代表：冯修敏
电话：18001713632/021-54677088-6726
联系人：甄宝林
客服电话：021-34013996
网址：www.hotjijin.com
（39）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
法人代表：杨懿
电话：18502354557
联系人：文雯
客服电话呢：400-166-1188
网址：8.jrj.com.cn
（40）上海中正达广基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
法人代表：黄欣
电话：13774232592
联系人：戴珉微
客服电话：400-676-7523
网址：www.zzwealth.cn
（41）浙江金观诚基金销售有限公司
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：浙江省杭州市登云路 43 号金诚集团 10 楼
法人代表：徐黎云
电话：0571-88337717
联系人：孙成岩
客服电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com
（42）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 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室
办公地址：南京市建邺区江东中路 222 号奥体中心文体创业园
法人代表：袁顾明
电话：021-22267994
联系人：赵明
客服电话：400-928-2266
网址：www.dtfunds.com
（43）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 号院望京 SOHO 塔 3 19 层
法人代表：钟斐斐
电话：15910450297
联系人：侯芳芳
客服电话：400-061-8518
网站：www.ncfjj.com
（44）泰信财富投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间
办公地址：北京市朝阳区建国路甲 92 号 世茂大厦 C 座 5 层
法定代表人：李静
电话：13601264918
联系人：李丹
客服电话：400-881-5596
网址：www.taixincf.com
（45）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
法人代表：沈继伟
电话：18901780806
联系人：陈洁
客服电话：400-921-7733
网址：www.leadbank.com.cn
（46）上海联泰基金销售有限公司
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 座 3 层
法人代表：燕斌
电话：021-52822063
联系人：陈东
客服电话：400-046-6788
网址：www.66zichan.com
（47）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室
办公地址：北京海淀区中关村海淀北 2 街 10 号泰鹏大厦 12 楼
法定代表人：张琪
电话：18511773539
联系人：李唯
客服电话：010-62676979
网址：www.xincai.com
（48）北京广源达信投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层
法定代表人：齐剑辉
电话：15201586214
联系人：王永霞
客服电话：400-623-6060
网址：www.niuniufund.com
（49）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A
办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A
法定代表人：高锋
电话：0755-83655588-605
联系人：廖嘉琦
客服电话：400-804-8688
网址：www.foreseakeynes.com
（50）上海万得基金销售有限公司
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：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
法定代表人：王廷富
电话：021-68882280
联系人：徐亚丹
客服电话：400-820-9463
网址：www.wind.com.cn
（51）众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08
法定代表人：李招弟
电话：13611256407
联系人：李艳
客服电话：400-059-8888
网址：www.wy-fund.com
（52）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市北京经济技术开发区科创十一街 18 号 C 座 2 层 221 室
办公地址：北京市北京经济技术开发区科创十一街 18 号 C 座 2 层 222 室
法定代表人：陈超
电话：18612439949
联系人：黄立影
客服电话：400-088-8816
网址：jr.jd.com
（53）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 号
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号
法定代表人：王伟刚
电话：18001102931
联系人：丁向坤
客服电话：400-619-9059
网址：www.fundzone.cn
（54）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：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 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809
法定代表人：戎兵
电话：13520443582
联系人：张得仙
客服电话：400-6099-200
网址：www.yixinfund.com
（55）奕丰基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1116 室及 1307 室
法定代表人：TEO WEE HOWE
电话：13424264100
联系人：叶健
客服电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
（56）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
办公地址：中国北京西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号
法定代表人：梁蓉
电话：010-66154828-8047
联系人：王瑶
客服电话：400-626-2818
网址：www.5irich.com
（57）北京格上富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 03 室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 03 室
法定代表人：安立欣
电话：15600355787
联系人：张林
客服电话：400-080-5828
网址：www.licai.com
（58）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区郭守敬路 498 号浦东软件园 14 幢 22301—130 座
办公地址：上海市杨高南路 428 号由由世纪广场 1 号楼
法定代表人：张长虹
电话：18901685505
联系人：施燕华
客服电话：021-20219997
网址：www.gw.com.cn
（59）中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦五层
办公地址：上海市浦东新区商城路 618 号良友大厦 B303 室
法定代表人：窦玉明
电话：021-68609600
联系人：屠帅颖
客服电话：400-700-9700
网址：www.zofund.com
（60）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（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503-1504 室
法定代表人：王翔
电话：17721005485
联系人：吴鸿飞
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
（61）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402
办公地址：朝阳区来广营中街甲 1 号朝来高科技产业园 5 号楼
法定代表人：程刚
电话：18701236910
联系人：陈旭
客服电话：400-810-5919
网址：www.fengfd.com
（62）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人：王兴吉
联系人：刘金佩
电话：15901073209
客服：400-088-8080
网址：www.qiandaojr.com
（63）深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
法定代表人：赖任军
联系人：刘昕霞
电话：0755-29330513
客服：400-930-0660
网址：www.jfzinv.com
传真：0755-26920530
（64）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 4F
法定代表人：陈继武
联系人：高皓辉
电话：13861784145
客服：21-6333-3389-230
网址：www.vstonewealth.com
（65）东海期货有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号
办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼
法定代表人：陈太康
联系人：陶云
电话：15527357161
客服：400-8888-588
网址：www.qh168.com.cn
（66）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
法定代表人：陈刚
电话：15925665590
联系人：张丽琼
客服电话：0571-86655920
网址：www.cd121.com
（67）深圳盈信基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1
办公地址：大连市中山区南山路 155 号南山 1910-A3-1
法定代表人：苗宏升
联系人：王清臣
电话：13522300698
客服：4007-903-688
网址：www.fundying.com
（68）江西正融资产管理有限公司
注册地址：江西省南昌市高新区紫阳大道绿地新都会 38 栋 2107 室
办公地址：江西省南昌市高新区紫阳大道 3333 号绿地新都会 38 栋 2108 室
法定代表人：陆雯
联系人：傅翌乔
电话：13879129841
客服：0791-86692560
网址：www.jxzrzg.com.cn
（69）上海朝阳永续基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区张江碧波路 690 号 4 号楼 2 楼
办公地址：上海市浦东新区张江碧波路 690 号 4 号楼 2 楼
法定代表人：廖冰
联系人：陆纪青
电话：15902135304
客服：400-998-7172
网址：www.998fund.com
（70）嘉晟瑞信（天津）基金销售有限公司
注册地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场 1 号楼 2503 室
办公地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场 1 号楼 2503 室
法定代表人：孙伟
电话：15510846151
联系人：孙颖
客服：400-883-2993
网址：www.jsrxfund.com
（71）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
法定代表人：刘汉青
电话：025-66996699-887226
联系人：王锋
客服：95177
网址：www.sujijin.com
（72）上海挖财基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 700 号 5 层 01、02、03 室
办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 5 层
法定代表人：胡燕亮
电话：021-50810687
联系人：李娟
客服：400-025-6569
网址：wacaijijin.com
（73）中民财富基金销售（上海）有限公司
注册地址：上海黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元
办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层
法定代表人：弭洪军
电话：18521506916
联系人：黄鹏
客服：400-876-5716
网址：www.cmiwm.com
（74）万家财富基金销售（天津）有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层
法定代表人：李修辞
电话：13811914597
联系人：杨雪
客服电话：010-59013828
网址：www.wjasset.com
（75）洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司
注册地址：山东省青岛市香港东路 195 号 9 号楼 701 室
办公地址：北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室
法定代表人：任淑桢
电话：010-66121830
联系人：周映筱
客服电话：0532-66728591
网址：www.hongtaiwealth.com
（76）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 栋 2 楼 268 室
办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
法定代表人：毛淮平
电话：010-88066632
联系人：仲秋玥
客服电话：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com
（77）和耕传承基金销售有限公司
注册地址：郑州市郑东新区东凤东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间
办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 6 号楼国际电子城 b 座
法定代表人：李淑慧
电话：13810222517
联系人：董亚芳
客服电话：400-360-000
网址：www.hgccpb.com
（78）通华财富（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融大厦广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼
法定代表人：马刚
电话：021-60810586
联系人：杨涛
客服电话：95156
网址：www.tonghuafund.com
（79）江西银行股份有限公司
注册地址：江西省南昌市红谷滩新区金融大街 699 号
办公地址：江西省南昌市红谷滩金融大街 699 号
法定代表人：陈晓明
电话：0791-86790794
联系人：万俊
客户服务热线：400-78-96266
网址：www.jx-bank.com
（80）嘉兴银行股份有限公司
注册地址：浙江省嘉兴市昌盛南路 1001 号
办公地址：浙江省嘉兴市南湖区城南街道昌盛南路 1001 号
法定代表人：夏林生
电话：0573-82099660
联系人：余舟
客户服务热线：0573-96528
网址：www.bojx.com
（81）珠海华润银行股份有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大九州大道中 1346 号珠海华润银行大厦
办公地址：广东省珠海市吉大九州大道中 1346 号珠海华润银行大厦
法定代表人：刘晓勇
电话：0756-8121844
传真：0756-8121987
联系人：陈天翔
客户服务热线：0756-96588
网站：www.crbank.com.cn
（82）长沙银行股份有限公司
注册地址：长沙市岳麓区滨江路 53 号凯林商务中心 B 座
办公地址：长沙市岳麓区滨江路 53 号凯林商务中心 B 座
法定代表人：朱玉国
电话：0731-89736250
联系人：于立娜
客户服务热线：40067-96511
网站：www.bankofchangsha.com
3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构调整为本基金的销售机构，并及时公告。
（二）登记机构
名称：天弘基金管理有限公司
住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号
办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层
法定代表人：井贤栋
电话：（022）83865560
传真：（022）83865563
联系人：薄贺龙
（三）律师事务所和经办律师
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
经办律师：黎明、孙睿
联系人：孙睿
（四）会计师事务所和经办注册会计师
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
经办注册会计师：薛竞、周祎
联系人：周祎

四、基金的名称

本基金名称：天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：股票型。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

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，以中证证券保险指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于中证证券保险指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；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，应当保持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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

1、大类资产配置

本基金管理人主要按照中证证券保险指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于中证证券保险指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；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，应当保持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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于中证证券保险指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%的投资比例限制。

（2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据中证证券保险指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

1）定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

2）不定期调整

A. 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

C. 根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将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，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4、资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

5、其他金融工具投资策略

本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资

（二）投资决策流程

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；

（2）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；

（3）国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

（1）本基金管理人每月定期召开资产配置会议，讨论基金的资产组合以及个股配置，形成资产配置建议，会议参加人员为全体投资研究团队。

（2）投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

（3）基金经理在投资决策委员会的授权下，根据本基金的资产配置要求，参考资产配置会议、投资研究联席会议讨论结果，制定基金的投资策略，在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。

（4）金融工程分析师运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算，并提供数量化风险分析报告，行业分析师对标的指数成分股中基本面情况及时提供研究报告。

（5）基金经理根据量化风险分析报告，在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下，采取适当的方法控制与指数的偏差风险、流动性风险、降低交易成本。

九、业绩比较基准

本基金投资组合的业绩比较基准为：中证证券保险指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。

中证证券保险指数从保险与证券行业中依照日均总市值选取不超过 50 家上市公司作为样本股，反映证券与保险行业上市公司整体表现，为投资者提供投资标的。

如果指数编制单位变更或停止中证证券保险指数的编制、发布或授权，或中证证券保险指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证证券保险指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

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责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 01 月 22 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。

（下转 D27 版）