

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金(FOF) 招募说明书(更新)摘要

(2020年1月)

基金管理人:诺德基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
二〇二〇年一月

【重要提示】

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)的募集已获得中国证监会2019年8月9日证监会许可【2019】1478号文注册。本基金于2019年12月9日生效。

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。

基金中基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金投资应当充分了解基金定期定额投资和零存零取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单可行的投资方式,但不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

本基金主要投资于证券市场中的其他公开募集证券投资基金的基金份额,为基金中基金,基金净值会因证券市场波动、所投资的基金的基金份额净值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,并自行承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格、基金份额净值产生影响而形成的系统性风险,个别证券、持有基金特有的非系统性风险,由于基金经理人连续大量赎回基金产生的流动性风险。基金管理人将在基金实施管理过程中产生的基金管理人过错、合规性风险,本基金的特有风险等详见招募说明书“风险提示”章节。

本基金为混合型基金中基金,风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币型基金及货币型基金中基金,低于股票型基金、股票型基金中基金。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否与投资人的风险承受能力相适应。投资人应当通过本基金管理人或销售机构购买本基金,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

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。基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的表现也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资“买者自负”原则,在投资人做出投资决策后,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。

本招募说明书的本次更新为依中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》作出的相应修订,其余内容截至2020年1月8日。截至本招募说明书公告日,本基金无已披露的投资组合报告和净值表现数据。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:诺德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号18层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼18层
邮政编码:200120
法定代表人:潘福祥
成立日期:2006年6月8日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监基金字[2006]88号
经营范围:基金管理服务;募集、发起设立基金;及中国证监会批准的其他业务。

组织形式:有限责任公司

注册资本:壹亿元人民币
联系人:孟晓君
联系电话:021-69895199
股权结构:
清华控股有限公司 51%
宜信惠民投资管理(北京)有限公司 49%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员:
潘福祥先生,董事长,清华大学学士、硕士,中国社会科学院金融学博士。历任清华大学经济管理学院院长助理、安徽省国投上海证券部副总经理和清华实业投资管理有限公司总经理,清华大学经济管理学院和国家会计学院客座教授,诺德基金管理有限公司董事、副总经理、总经理。
罗凯先生,董事,总经理,清华大学工商管理硕士。曾任职于江苏省交通产业集团投资发展处。2007年7月加入诺德基金管理有限公司,先后担任华北区渠道经理、华北区总监、市场总监助理、市场副总监兼专户理财部负责人、市场总监、副总经理。
薛嘉麟先生,董事,华中理工大学工学学士,北京邮电大学工学硕士。现任清控资产管理公司总裁,曾任朗讯科技(中国)有限公司贝尔实验室高级研究员,中关村科技软件园有限公司咨询服务总监、副总裁、总裁,北京通联联合信息技术有限公司首席执行官,中国通关网首席运营官,启迪融资租赁有限公司总经理,启迪金控投资有限公司副总裁,清控资产管理有限责任公司投资业务总监、副总裁。

唐宇先生,董事,美国 The University of the South 经济学学士。现任宜信惠民投资管理(北京)有限公司执行董事、总经理,华创资本(CGC)董事长,宜信(香港)控股有限公司董事,富安易达(北京)网络技术有限公司总经理,上海(香港)有限公司总经理。曾任美国 DJJ 投资银行部(DJJ Investment Bank)投资分析师,亚信(Asia Info)战略投资部总监。

侯琳女士,董事,北京大学法学学士、硕士。现任宜信惠民投资管理(北京)有限公司副总经理。
商薇女士,董事,河海大学经济学学士、清华大学工商管理硕士。现任宜信卓越财富投资管理(北京)有限公司高级副总裁,曾任上海博而思企业咨询服务(香港)咨询有限公司顾问、上海安硕信息科技有限公司高级经理。

陈达先生,独立董事,对外经济贸易大学学士,University of Minnesota Law School 硕士。现任北京市及天津律师事务所律师,曾任北京金杜律师事务所律师,高伟绅律师事务所律师,德普律师事务所律师。

王凤女士,独立董事,北京大学法学学士,法国巴黎商学院(Paris School of Business)及美国华盛顿大学(University of Washington)访问学者。现任北京德恒律师事务所律师,曾任上海建纬律师事务所北京分所创始合伙人等职务。

许亮先生,独立董事,清华大学文学和经济学双学士,哈佛商学院 MBA。现任合一资本创始合伙人、董事长,新财社董事长,曾任北京清华永新信息工程有限公司市场部副总裁,英特尔(中国)有限公司高级软件工程师,战略项目经理,鼎晖投资基金公司助理副总裁,北京永新视博电视技术有限公司执行董事兼副总裁,首席财务官,博纳影业集团有限公司首席财务官、集团副总裁,光影工场文化传播有限公司董事长。

2、基金管理人监事会成员:

刘大伟先生,监事,西安交通大学学士,国防科技大学硕士,清华大学硕士。现任宜信惠民投资管理(北京)有限公司总裁助理,曾任北京军区自动化站主任,北京市天元网络技术有限公司经理助理,宜信汇付(北京)有限公司渠道总监。

薛雯女士,监事,苏州大学法学院法学硕士,对外经济贸易大学法学硕士。现任清控资产管理(北京)风控总监,曾任启迪控股股份有限公司金融资产管理运营中心投资经理,建纬(北京)律师事务所律师,苏州正文律师事务所律师。

冯奕先生,监事,北京广播学院(现更名:中国传媒大学)学士,清华大学经管学院硕士。现任诺德基金管理有限公司北京分公司总经理,曾任清华兴业投资管理有限公司培训部经理、赛尔教育科技发展有限公司培训部总监、诺德基金管理有限公司公共事务总监。

刘静女士,监事,清华大学本科毕业。现任职于诺德基金管理有限公司北京分公司,曾任任职于清华校友总会、诺德基金管理有限公司综合管理部。

3、公司高级管理人员:

潘福祥先生,董事长。清华大学学士、硕士,中国社会科学院金融学博士。历任清华大学经济管理学院院长助理、安徽省国投上海证券部副总经理和清华实业投资管理有限公司总经理,清华大学经济管理学院和国家会计学院客座教授,诺德基金管理有限公司董事、副总经理、总经理。

罗凯先生,董事、总经理,清华大学工商管理硕士。曾任职于江苏省交通产业集团投资发展处。2007年7月加入诺德基金管理有限公司,先后担任华北区渠道经理、华北区总监、市场总监助理、市场副总监兼专户理财部负责人、市场总监、副总经理。

郑阳培先生,督察长,清华大学法学学士,国立首尔大学国际商硕硕士。历任财信里昂证券有限责任公司法律合规专员,诺德基金管理有限公司监察稽核主管、监察稽核部负责人、市场总监助理、FOFH 事业部副总监,利得资产管理(北京)有限公司法律事务部副总监,华泰资产管理有限公司风险合规部总经理助理等职务。

严辉先生,首席信息官,南京大学学士。曾任杭州金宏软件有限公司软件工程师,杭州新利软件有限公司开发项目经理,上海华腾软件有限公司项目经理,华安基金管理有限公司信息技术部项目经理,天相投资有限公司信息技术技术部总经理助理。2011年7月加入诺德基金管理有限公司,先后担任信息技术项目经理,信息技术部副经理,信息技术部总监。

4、本基金基金经理

郑源先生,香港理工大学计算机博士。曾任高扬集团有限公司(香港)投资经理,中国创新投资股份有限公司(香港)投资经理,华泰联合证券有限责任公司资深研究员、民生证券股份有限公司资深研究员以及中国银河证券股份有限公司高级研究员。2017年1月加入诺德基金管理有限公司,曾任投资经理职务,现任 FOF 管理部投资总监、深圳分公司总经理。

5、FOF 基金投资决策委员会成员

公司总监兼 FOF 管理部总监罗凯先生、FOF 管理部投资总监兼深圳分公司总经理郑源先生、运营总监兼产品中心总监曹刚先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路111号
法定代表人:崔达
成立时间:1993年8月1日
组织形式:股份有限公司
注册资本:66.99亿元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可[2014]78号
联系人:韩鑫
联系电话:0755-26951111

招商证券是首批招商局旗下金融企业,经过二十多年创业发展,已成为拥有证券市场主体业务牌照的一流券商,并经中国证监会监督管理委员会评定为 A 类 A 级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力,科学合理的风险管理架构,专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道,在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 249 家批准设立的证券营业部和 12 家证券经纪业务管理分公司,同时在香港设有分支机构,全资拥有招商证券国际有限公司,招商期货有限公司,招商致远资本管理有限公司,招商证券投资咨询有限公司,招商证券资产管理有限公司,参股德信基金托管公司、招商基金管理有限公司、广东股权交易中心股份有限公司及证通股份有限公司,构

建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力,打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长,推动证券行业进步,立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构,成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

(二)主要人员情况

招商证券证券服务部门多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验,以及大型 IT 公司的软件设计与开发经验,人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各个领域,其中本科以上学历占比 100%,高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。(三)基金托管业务经营情况

招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司,可为各类公募基金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施,稳定、高效的托管业务系统,完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实守信、谨慎勤勉”的原则,为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外,招商证券于 2012 年 10 月获得证监会准予开展私募基金综合托管服务试点的正式批复,成为业内首家可从事私募托管业务的券商,经验丰富,服务优质,业绩突出。截至 2019 年四季度,招商证券共托管 36 只公募基金。(四)基金托管人的内部控制制度说明

1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人:
(1)托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2)建立科学合理的、控制严密、运行高效的内部控制体系,保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

(3)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,使托管业务稳健运行和受托资产安全完整,实现托管业务持续、稳定、健康发展。

(4)不断改进和完善内控制机制、体制和各项业务制度、流程,提高业务运作效率和效果。

2、内部控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会,作为公司内部最高风险控制机构,风险管理委员会负责审议公司风险管理政策,风险评估,容忍度和经济资本与风险限额配置方案,拥有公司重大风险政策和风险偏好项目的最终决策权。风险管理部、法律合规部及稽核部为公司的风险管理职能部门。

托管部内设专门负责稽核工作的内控稽核岗位,配备专职稽核人员,依照有关法律法规,对业务的运行独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

招商证券针对制定了各项管理制度和操作规程,建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,保持托管业务健全、有效执行;安全保管基金财产,保持基金财产的独立性;实行经营场所封闭式管理,并配备录音和录像监控系统;有独立的综合托管服务系统;业务管理实行复核和检查机制,建设和严格执行的操作制约体系;托管部树立内控优先和风险管理理念,培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

(五)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

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定,对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督,并及时提示基金管理人违规行为。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定的,应及时以电话提醒方式提示并通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定的期限内及时改正。在上述规定期限内,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。基金托管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。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构:

1、直销机构
名称:诺德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号18层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼18层
法定代表人:潘福祥
客户服务电话:400-888-0009 021-68604888
传真:021-68985121
联系人:许品晶
网址:www.nuodefund.com

2、代销机构

(1)招商证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
法定代表人:聂达
客服电话:95565
网址:www.newone.com.cn
(2)平安银行股份有限公司
住所:广东省深圳市深南东路 5047 号
办公地址:广东省深圳市深南东路 5047 号
法定代表人:谢永林
客服电话:95511-3
网址:www.bank.pingan.com
(3)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田區益田路 4036 号荣超大厦 16—20 层
办公地址:深圳市福田区益田路 4036 号荣超大厦 16—20 层
办公地址:深圳市福田区益田路 4036 号荣超大厦 16—20 层
法定代表人:杨宇辉
联系人:丁向冲
客服电话:400-619-9059
网址:www.fund-zn.cn
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代理销售本基金,并在基金管理人网站公示。

(4)登记机构:

名称:诺德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号18层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼18层
法定代表人:崔达
电话:021-20333333
传真:021-40098825
联系人:王一菲
客服电话:95531-400-8888-588
网址:www.loungone.com.cn

(5)鼎信汇金(北京)投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路1号院8号楼1701室
办公地址:北京市海淀区清华科技园科技大厦 C 座 17 层 1701 室
法定代表人:李凌峰
客服电话:400-158-5050
公司网站:www.9ifund.com

(6)上海煜德基金销售有限公司
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室
法定代表人:王朔
客服电话:400-820-5369
网址:www.yufund.com.cn

(7)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址: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:陈共炎
客户服务电话:400-8888-888
电话:010-66568430
联系人:田薇
公司网站:www.chinastock.com.cn

(8)国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门内大街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内大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:王少华
客服电话:400-818-8118
公司网站:www.guodu.com

(9)大同证券有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号山西城中心21层
办公地址: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
客服电话:400-712-1212
公司网站: http://www.dtsbc.com.cn

(10)中天证券股份有限公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马劲松
客服电话:(024)95346
网址:www.itzqj.com

(11)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧国际中心大厦9楼B座
办公地址:北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财国际中心27层
法定代表人:吕春生
客服电话:400-620-6868
网址:www.lczq.com

(12)民生证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
法定代表人:冯鹤年
联系人:赵明
业务联系电话:010-85127622
客服电话:4006198888
公司网站:www.mszzq.com

(13)华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯洋
联系人:周志娟
客户服务电话:028-86135991
传真:028-86150040
网址: http://www.hx168.com.cn

(14)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
电话:023-63786141

传真:023-63786212
联系人:张煜
客服电话:4008960696
网址:www.swsc.com.cn

(15)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层、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层、28层 A02 单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:王连志
电话:0755-82825551
传真:0755-82825355

统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.esence.com.cn
(16)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:北京朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
客服电话:4008888108
公司网址:www.csc108.com

(17)珠海米基金销售有限公司
办公地址:广州海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼 B1201-1203
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.com

(18)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号
法定代表人:李勇
客户服务电话:4008-888-999 或 95579
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
长江证券官网地址:www.95579.com

(19)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层
法定代表人:罗树斌
客服电话:95322
网址:www.gfzq.com

(20)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:广东省深圳市福田区福华一路投行大厦16-20层
法定代表人:刘学民
客户服务或投诉电话:4008881888
公司网址: http://www.firstcapital.com.cn

(21)财达证券股份有限公司
注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦26层
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦26层
法定代表人:翟建强
客服电话:4006128888
公司网站:www.s10000.com

(22)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区金融路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楼
法定代表人:杨德红
客服电话:95521
网址:www.gtja.com

(23)山西证券股份有限公司
住所: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:侯魏
联系人:郭娜
客户服务电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客服电话:400-666-1618、95573
网址:www.i618.com.cn

(24)光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区太平桥大街25号,甲25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号,甲25号中国光大中心
法定代表人:李耀鹏
客服电话:95595
公司网站:www.cebbank.com

(25)太平洋证券股份有限公司
住所:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
办公地址:北京市西城区北展北街9号华远企业大厦D座
法定代表人:李长伟
客服电话:95397
公司网站:www.tpyzq.com

(26)北京汇金基金销售有限公司
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:王刚
联系人:丁向冲
客服电话:400-619-9059
网址:www.fund-zn.cn

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代理销售本基金,并在基金管理人网站公示。

(4)登记机构:
名称:诺德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号18层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼18层
法定代表人:崔达
电话:021-20333333
传真:021-40098825
联系人:王一菲
客服电话:95531-400-8888-588
网址:www.loungone.com.cn

(5)鼎信汇金(北京)投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路1号院8号楼1701室
办公地址:北京市海淀区清华科技园科技大厦 C 座 17 层 1701 室
法定代表人:李凌峰
客服电话:400-158-5050
公司网站:www.9ifund.com

(6)上海煜德基金销售有限公司
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室
法定代表人:王朔
客服电话:400-820-5369
网址:www.yufund.com.cn

(7)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址: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:陈共炎
客户服务电话:400-8888-888
电话:010-66568430
联系人:田薇
公司网站:www.chinastock.com.cn

(8)国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门内大街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内大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:王少华
客服电话:400-818-8118
公司网站:www.guodu.com

(9)大同证券有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号山西城中心21层
办公地址: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
客服电话:400-712-1212
公司网站: http://www.dtsbc.com.cn

(10)中天证券股份有限公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马劲松
客服电话:(024)95346
网址:www.itzqj.com

(11)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧国际中心大厦9楼B座
办公地址:北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财国际中心27层
法定代表人:吕春生
客服电话:400-620-6868
网址:www.lczq.com

(12)民生证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
法定代表人:冯鹤年
联系人:赵明
业务联系电话:010-85127622
客服电话:4006198888
公司网站:www.mszzq.com

(13)华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯洋
联系人:周志娟
客户服务电话:028-86135991
传真:028-86150040
网址: http://www.hx168.com.cn

(14)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
电话:023-63786141

传真:023-63786212
联系人:张煜
客服电话:4008960696
网址:www.swsc.com.cn

(15)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层、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层、28层 A02 单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:王连志
电话:0755-82825551
传真:0755-82825355

统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.esence.com.cn
(16)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:北京朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
客服电话:4008888108
公司网址:www.csc108.com

(17)珠海米基金销售有限公司
办公地址:广州海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼 B1201-1203
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.com

(18)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号
法定代表人:李勇
客户服务电话:4008-888-999 或 95579
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
长江证券官网地址:www.95579.com

(19)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层
法定代表人:罗树斌
客服电话:95322
网址:www.gfzq.com

(20)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:广东省深圳市福田区福华一路投行大厦16-20层
法定代表人:刘学民
客户服务或投诉电话:4008881888
公司网址: http://www.firstcapital.com.cn

(21)财达证券股份有限公司
注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦26层
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦26层
法定代表人:翟建强
客服电话:4006128888
公司网站:www.s10000.com

(22)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区金融路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楼
法定代表人:杨德红
客服电话:95521
网址:www.gtja.com

(23)山西证券股份有限公司
住所: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:侯魏
联系人:郭娜
客户服务电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客服电话:400-666-1618、95573
网址:www.i618.com.cn

(24)光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区太平桥大街25号,甲25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号,甲25号中国光大中心
法定代表人:李耀鹏
客服电话:95595
公司网站:www.cebbank.com

(25)太平洋证券股份有限公司
住所:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
办公地址:北京市西城区北展北街9号华远企业大厦D座
法定代表人:李长伟
客服电话:95397
公司网站:www.tpyzq.com

(26)北京汇金基金销售有限公司
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:王刚
联系人:丁向冲
客服电话:400-619-9059
网址:www.fund-zn.cn

资产配置(TAA),以及动态资产配置(DAA)。战略资产配置(SAA)层面,主要依据宏观经济周期的商业周期对各类资产的配置约束做出初步的判断。战术资产配置(TAA)层面,通过不同类资产的短期趋势分析并结合量化模型分析,确定各类资产配置的具体配置比例。在动态资产配置(DAA)层面,本基金将通过紧密跟踪市场,以防突发风险为主,在必要时进行各类资产权重的调节。

(1)战略资产配置(SAA)
主要根据宏观经济指标以及政策因素,对中国宏观经济所处的库存周期、货币周期,以及设备更新周期的相应阶段进行判定和识别。基于宏观经济处于以上各个周期的不同阶段,对权益类、固收类,以及流动性资产配置比例的大小关系进行确定和约束。这种确定和约束的有效性以6个月为周期,每6个月进行重新判定和调整。

(2)战术资产配置(TAA)
综合考虑宏观经济变量,政策因素,以及各类资产本身的投资逻辑与估值水平,利用不同类资产的量化指标或模型,对各类资产的短期趋势进行分析。同时,分析各类资产本身的风险收益特性分布,各类资产之间的相关性,日效应等因素。利用以上分析结果所形成的主观判断结果,再利用“Black-litterman(B-L)”为基准的量化模型对各类资产的权重进行确定。量化模型通过融入主观的投资观点,来修正静态历史数据估计带来的预期偏差,使得投资组合更加逼近有效资产配置前沿的组合。其次,本基金还将利用战略资产配置层面的结论,对量化模型的优化进行约束,使得最终的战术资产配置结果与战略资产配置结果相匹配。

(3)动态资产配置(DAA)
考虑到市场中的突发事件冲击,资产趋势的突然转变,以及市场波动突然大幅提升等因素,本基金将对这类突发事件所造成的风险进行及时控制。一旦出现显著下行风险,将采用各种风控措施及时截断相关资产的下行风险,从而有效保护投资人的利益。

2、基金投资策略
本基金通过定量分析策略和定性分析策略相结合的方式优选标的,主要通过通过分析基金的费率水平、历史收益、历史排名、夏普比率、历史回撤、波动率以及相应基金标的择时、择券、稳定性等量化指标,挑选出合适的基金组成不同投资类型的标的基金池,再对标的基金池中的基金进行筛选和配置,通过深入了解标的基金的具体策略及投资领域,并对其基金管理人、历史、组织架构,以及标的基金基金经理的优势及稳定性进行分析,将资产分散投资于不同基金管理人、投资策略的基金,分别构建股票型基金投资组合、债券型基金投资组合以及货币型基金投资组合。