

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金  
招募说明书摘要  
(2017年10月更新)

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 【重要提示】

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金（以下简称：“本基金”）经中国证监会2010年6月30日证监许可[2010]888号文核准募集。本基金基金合同于2010年9月8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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有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、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“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净值变化导致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，其中权证投资的比例不超过基金资产净值的3%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人管理的其他基金的过往业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书摘要所载内容截止日期为2017年9月8日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2017年6月30日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司于2017年9月18日对本招募说明书

摘要（2017年10月更新）进行了复核。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：国投瑞银基金管理有限公司

英文名称：UBS SDIC FUND MANAGEMENT CO., LTD

住所：上海市虹口区东大名路 638 号 7 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

法定代表人：叶柏寿

成立日期：2002 年 6 月 13 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】25 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：杨蔓

客服电话：400-880-6868

传 真：（0755）82904048

股权结构：

股东名称	持股比例
国投泰康信托有限公司	51%
瑞银集团	49%
合计	100%

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

叶柏寿先生，董事长，中国籍，经济学学士。现任国投安信股份有限公司董事长、国家开发投资公司副总经济师、国投资本控股有限公司董事长、兼任国投泰康信托有限公司董事长、安信证券股份有限公司董事，曾任国家计委经济研究所干部、

副主任科员、财政金融研究室副主任，国家开发投资公司财务会计部干部、处长，深圳康泰生物制品股份有限公司董事长，国家开发投资公司财务会计部副主任、主任，国投资本控股有限公司副董事长。

王彬女士，总经理，董事，中国籍，工商管理硕士，高级经济师，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长及国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书、国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书、国投泰康信托有限公司资产管理部经理兼董事会秘书，北京京能热电股份有限公司董事会秘书、北京国际电力开发投资公司董事会秘书、北京市人民政府新闻处主任科员、北京天然气联合公司职员。

董日成先生，董事，中国香港籍，文学学士。现任瑞银资产管理（香港）有限公司中国区董事总经理，曾任瑞银资产管理公司中国区业务经理、执行董事，瑞银资产管理对冲基金亚太区首席营运官，瑞银资产管理台湾总经理，香港瑞银财富管理部门主管，国投瑞银基金管理有限公司的代总经理和首席营运官，美林投资经理人公司亚太地区首席营运官，美国国际集团亚太地区的金融及营运领域担任多个重要职务等。

李涛先生，董事，中国籍，管理学硕士。现任国投泰康信托有限公司财务总监，曾任国投泰康信托有限公司信托财务部副经理、信托财务部经理、计划财务部总经理，国家开发投资公司金融投资部项目经理，国融资产管理有限公司证券投资部业务主管、国投煤炭公司计划财务部业务主管，山东省茌平造纸厂设计部职员。

黄雪婷女士，董事，中国香港籍，工商学学士。现任瑞银资产管理（新加坡）有限公司亚太区产品开发及管理主管，曾任美盛集团（Legg Mason, Inc.）亚洲及澳大利亚产品开发部主管，瀚亚投资（Eastspring Investments）区域投资解决方案及基金平台主管，富达基金（Fidelity）亚洲产品部董事，苏黎世保险（Zurich Insurance Company）业务规划及项目高级经理，怡富基金 Jardine Fleming（JPMorgan）产品开发部业务分析师。

李哲平先生，独立董事，中国籍，金融学硕士。现任《当代金融家》杂志执行社长兼主编，兼任鸿儒金融教育基金会理事、光大证券股份有限公司独立董事、南粤银行独立董事、中航证券有限公司独立董事。曾担任中国证券报理论版主编、统

信资产评估有限公司董事长、中信银行股份有限公司独立董事。

史克通先生，独立董事，中国籍，法学学士。现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人、律师，主要从事公司及证券业务，兼任中国忠旺控股有限公司独立董事、昆山金利表面材料应用科技股份有限公司独立董事、北京公共交通控股（集团）有限公司外部董事、渤海产业投资基金管理有限公司独立董事及重庆广电数字传媒股份有限公司独立董事。曾任职于山东鲁中律师事务所、北京市京都律师事务所。

龙涛先生，独立董事，中国籍，经济学硕士。现任北京海问投资咨询有限公司董事长，兼任庆铃汽车股份有限公司独立董事、王府井百货（集团）股份有限公司独立董事、爱慕股份有限公司独立董事、中外名人文化传媒股份有限公司独立董事、皇冠环球集团股份有限公司独立董事。曾任中央财经大学会计系副教授和华夏基金管理有限公司独立董事，曾在毕马威国际会计纽约分部担任审计和财务分析工作。

## 2、监事会成员

卢永燊先生，监事会主席，中国香港籍，工商管理硕士，现任瑞银资产管理公司中国区财务部主管和瑞银资产管理(中国)有限公司监事。曾任瑞银资产管理公司泛亚地区财务部主管。以往在金融服务及电信行业担任多个财务部管理职位。

张宝成先生，监事，中国籍，资源产业经济学博士，经济师。现任国投泰康信托有限公司股权管理部总经理。曾任国投创新投资管理有限公司投资经理，国家开发投资公司办公厅公司领导秘书，国投信托有限公司行政助理，中国石油管道分公司内部控制处科员，中国石油管道秦京输油气分公司计划科科长。

王明辉先生，监事，中国籍，经济学硕士，特许金融分析师协会会员、全球风险协会会员，拥有特许金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)、国际注册内部审计师(CIA)资格。现任国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部部门总经理。曾任职国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部副总监、国泰君安证券股份有限公司稽核审计总部审计总监。

冯伟女士，监事，中国籍，经济学硕士，高级会计师。现任国投瑞银基金管理有限公司总经理助理。曾任职中融基金管理有限公司清算主管，深圳投资基金管理有限公司投研人员。

## 3、公司高级管理人员及督察长

王彬女士，总经理，董事，中国籍，香港中文大学工商管理硕士，高级经济师，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长及国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书、国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书、国投泰康信托有限公司资产管理部经理兼董事会秘书，北京能热电股份有限公司董事会秘书、北京国际电力开发投资公司董事会秘书、北京市人民政府新闻处主任科员、北京天然气联合公司职员。

王书鹏先生，副总经理，中国籍，北京航空航天大学工程硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司总经理及董事。曾任职内蒙古哲盟交通规划设计院，内蒙古自治区交通征费稽查局哲盟分局，北京拓宇交通通用设施有限公司财务经理，利安达信隆会计师事务所项目经理，国投信托有限公司财务、信托资产运营管理部门经理。

张南森先生，副总经理，中国籍，北京大学高级管理人员工商管理硕士。曾任湘财证券有限公司营业部总经理助理，银华基金管理有限公司市场营销部执行主管，中邮创业基金管理有限公司机构理财部副总经理，国投瑞银基金管理有限公司机构服务部总监、总经理助理。

袁野先生，副总经理，中国籍，复旦大学工商管理硕士。曾任深圳投资基金管理公司基金经理，国信证券基金债券部投资经理，国投瑞银基金管理有限公司基金经理、基金投资部总监，招商基金管理有限公司总经理助理。

储诚忠先生，副总经理，中国籍，武汉大学经济学博士。曾任重庆建筑专科学校（现重庆大学）经济学教研组组长，武汉大学金融系副主任、副教授，国信证券有限公司综合研究部总经理，国投瑞银基金管理有限公司研究部总监、产品开发部总监、渠道服务部总监，长盛基金管理有限公司营销策划部总监、北京分公司总经理、华南营销中心总经理，宝盈基金管理有限公司总经理助理、副总经理。

刘凯先生，督察长，中国籍，复旦大学工商管理学硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事及国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事。曾任尊荣集团证券投资项目经理，君安证券东门南营业部研究员，平安证券蛇口营业部投资顾问，招商基金管理有限公司客户服务部总监，国投瑞银基金管理有限公司市场服务部总监、总经理助理。

#### 4、本基金基金经理

李怡文女士，固定收益部副总监，中国籍，芝加哥大学工商管理硕士，16年证券行业从业经历，曾任 Frolely Revy Investment Company 分析师、中国建设银行（香港）资产组合经理。2008年6月加入国投瑞银基金管理有限公司基金投资部任高级研究员。2010年9月8日起任国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金经理，2011年12月20日起兼任国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金基金经理，2015年10月28日起兼任国投瑞银境煊保本混合型证券投资基金基金经理，2016年4月30日起兼任国投瑞银和安债券型证券投资基金基金经理。曾于2012年12月11日至2016年12月2日期间任国投瑞银纯债债券型证券投资基金基金经理，2014年3月11日至2016年12月2日期间任国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年9月26日至2016年12月2日期间任国投瑞银岁增利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，2015年6月3日至2016年12月2日期间任国投瑞银招财保本混合型证券投资基金基金经理。

狄晓娇女士，中国籍，香港大学金融学硕士，8年证券从业经历。2010年7月加入国投瑞银基金管理有限公司，2011年7月转入固定收益部任研究员。2015年6月27日起担任国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金经理。2016年4月15日起兼任国投瑞银进宝灵活配置混合型证券投资基金（原国投瑞银进宝保本混合型证券投资基金）基金经理，2016年5月17日起兼任国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016年6月2日起兼任国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金基金经理，2016年7月13日起兼任国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017年5月20日起兼任国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新动力灵活配置混合型证券投资基金及国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

董晗先生，中国籍，南京大学理学硕士，11年证券从业经历。曾任易方达基金管理有限公司金属、非金属行业研究员，2007年9月加入国投瑞银基金管理有限公司研究部。2014年11月22日起兼任国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年3月14日起兼任国投瑞银创新动力混合型证券投资基金（原国投瑞银创新动力股票型证券投资基金）基金经理，2015年6月19日起兼任国投瑞银



成长优选混合型证券投资基金（原国投瑞银成长优选股票型证券投资基金）基金经理，2016年1月19日起兼任国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金及国投瑞银境煊保本混合型证券投资基金的基金经理，2017年5月20日起兼任国投瑞银优化增强债券型证券投资基金及国投瑞银和安债券型证券投资基金基金经理。曾于2011年7月21日至2014年7月23日期间担任国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)基金经理，于2014年7月24日至2016年2月29日期间担任国投瑞银景气行业证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员的姓名、职务

(1) 投资决策委员会召集人：袁野先生，副总经理

(2) 投资决策委员会成员：

韩海平先生：总经理助理兼固定收益部部门总经理

李怡文女士：固定收益部副总监，基金经理

何明女士：研究部部门总经理

蒋旭东先生：总经理助理，量化投资部负责人

杨俊先生：交易部部门总经理

马少章先生：专户投资部部门副总经理，投资经理

汤海波先生：基金投资部海外投资副总监，基金经理

陈小玲女士：基金投资部副总监，基金经理

杨冬冬先生：基金投资部副总监，基金经理

(3) 总经理和督察长列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

资产负债稳步增长。2016年末，本集团资产总额20.96万亿元，较上年增加2.61万亿元，增幅14.25%，其中客户贷款总额11.76万亿元，较上年增加1.27万亿元，增幅12.13%。负债总额19.37万亿元，较上年增加2.47万亿元，增幅14.61%，其中客户存款总额15.40万亿元，较上年增加1.73万亿元，增幅12.69%。

核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响，本集团实现净利润2,323.89亿元，较上年增长1.53%。手续费及佣金净收入1,185.09亿元，在营业收入中的占比较上年提升0.83个百分点。平均资产回报率1.18%，加权平均净资产收益率15.44%，净利息收益率2.20%，成本收入比为27.49%，资本充足率14.94%，均居同业领先水平。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份

中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珩，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年一季度末，中国建设银行已托管 719 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、直销机构：国投瑞银基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

法定代表人：叶柏寿

电话：(0755)83575992 83575993

传真：(0755)82904048 82904007

联系人：杨蔓、贾亚莉

客服电话：400-880-6868

网站：[www.ubssdic.com](http://www.ubssdic.com)

##### 2、代销机构

###### （1）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

传真：010-66107914

联系人：杨菲

客服电话：95588

公司网站：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

###### （2）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

传真：010-85109219

联系人：客服中心

客服电话：95599

公司网站：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

###### （3）中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

办公地址：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

电话：010-66596688

联系人：客户服务中心

客服电话：95566

网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

（4）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：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼（长安兴融中心）

法定代表人：王洪章

电话：010-66275654

传真：010-66275654

联系人：王琳

客服电话：95533

网站：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（5）交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：张宏革

客服电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

（6）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

公司网站：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

（7）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

电话：010-65558888

传真：010-65550827

联系人：郭伟

客服电话：95558

公司网站：<http://bank.ecitic.com>

（8）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：高天 虞谷云

客服电话：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（9）兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路154号

办公地址：上海江宁路168号9楼

法定代表人：高建平

电话：021-52629999-218022

传真：021-62569070

联系人：卞晷煜

客服电话：95561

公司网站：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

（10）中国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

法定代表人：唐双宁

电话：010-63636150

传真：010-63636157

联系人：薛军丽

客服电话：95595

公司网站：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

（11）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

电话：010-82806180

传真：010-82806363

联系人：许广圣

客服电话：95568

直销银行客服电话：10100123

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

直销银行网址：[www.mszyh.com](http://www.mszyh.com)

（注：目前仅在民生银行直销银行开通，民生银行柜台开通时间需另行公告。

（12）中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号

法定代表人：李国华

电话：010-68859404

传真：010-68858057

联系人：王硕

客服电话：95580

公司网站：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

（13）北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

电话：010-66223587

传真：010-66226045

联系人：谢小华

客服电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

（14）华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

电话：010-85238820

传真：010-85238680

联系人：刘军祥

客服电话：95577

公司网站：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

（15）上海银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号



法定代表人：范一飞

电话：021-68475888

传真：021-68476111

联系人：张萍

客服电话：021-962888

公司网站：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

（16）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

联系人：施艺帆

电话：021-50979384

传真：021-50979507

客服电话：95511-3

公司网站：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

（17）渤海银行股份有限公司

住所：天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联系人：王宏

电话：022 5831 6666

传真：022 5831 6569

客服电话：95541

公司网站：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

（18）大连银行股份有限公司

住所：大连市中山区中山路 88 号

办公地址：大连市中山区上海路 51 号

法定代表人：陈占维

电话：0411-82356627

传真：0411-82356590

联系人：李格格

客服电话：4006640099

公司网站：[www.bankofdl.com](http://www.bankofdl.com)

(19) 江苏吴江农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号

办公地址：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号

法定代表人：陆玉根

电话：0512-63969841

传真：0512-63969841

联系人：王健

客服电话：0512-96068、400-8696-068

公司网站：[www.wjrcb.com](http://www.wjrcb.com)

(20) 包商银行股份有限公司

住所：内蒙古包头市钢铁大街 6 号

办公地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号

法定代表人：李镇西

电话：0472-5189051

传真：0472-5189057

联系人：刘芳

客服电话：96016（内蒙、北京），967210（深圳、宁波），65558555（成都）

公司网站：<http://www.bsb.com.cn/>

(21) 杭州联合农村商业银行股份有限公司

住所：杭州市建国中路 99 号

办公地址：杭州市建国中路 99 号

法定代表人：张晨

电话：0571—87923324

传真：0571—87923314

联系人：张强

客服电话：96592

公司网址：[www.urcb.com](http://www.urcb.com)

(22)江西银行股份有限公司

住所：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新区金融大街 699 号

法定代表人：陈晓明

联系人：陈云波

电话：0791-86796029

传真：0791-86771100

客服电话：0791-96266

公司网站：<http://www.jx-bank.com.cn>

(23)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

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

客服电话：95521

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(24)中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

传真：010-65182261

联系人：权唐

客服电话：4008888108

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（25）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客服电话：95536

公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

（26）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

联系人：黄婵君

客服电话：95565、4008888111

公司网站：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（27）广发证券股份有限公司

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

办公地址：广东广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

（28）中信证券股份有限公司

住所：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：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客服电话：95548

公司网站：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（29）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

电话：010-83574507

传真：010-83574807

联系人：[辛国政](#)

客服电话：4008-888-888、95551

公司网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（30）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号海通证券大厦

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：95553

公司网站：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（31）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：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：李玉婷

客服电话：95523 或 4008895523

公司网站：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

（32）申万宏源西部证券有限公司

住所：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：韩志谦

电话：0991-5801913

传真：0991-5801466

联系人：王怀春

客服电话：4008-000-562

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

（33）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

电话：021-38565547

传真：021-38565783

联系人：乔琳雪

客服电话：95562

公司网站：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

（34）安信证券股份有限公司

住所：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：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客服电话：4008-001-001

公司网站：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

（35）万联证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 栋 12 层

法定代表人：张建军

联系电话：020-38286026

传真：020-38286930

联系人：甘蕾

客服电话：400-8888-133

网址：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

（36）民生证券有限责任公司

住所：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

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 16-20 层

法定代表人：余政

电话：010-85127999

传真：010-85127917

联系人：赵明

客户服务电话：400-619-8888

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

（37）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：蔡咏

电话：0551-62272101

传真：0551-62272100

联系人：李蔡

客服电话：95578

公司网站：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

（38）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

传真：022-28451892

联系人：蔡霆

客服电话：400-651-5988

公司网站：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

（39）华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

公司网站：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（40）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼



办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

客服电话：95573、400-666-1618

公司网站：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

（41）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

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20层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

联系人：赵艳青

客服电话：95548

公司网站：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

（42）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号东吴证券大厦

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话：4008-601-555

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

（43）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：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

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：尹旭航

客服电话：95321

公司网站：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（44）方正证券股份有限公司

住所：北京市西城区阜外大街甲34号方正证券大厦5楼

办公地址：北京市西城区阜外大街甲34号方正证券大厦5楼

法定代表人：雷杰

电话：010-68546765

传真：010-68546792

联系人：徐锦福

客服电话：95571

公司网站：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

（45）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

授权代表人：何伟

电话：0755-83516998

传真：0755-83515567

联系人：胡永君

客服电话：0755-33680000、400-6666-888

公司网站：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

（46）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

客服电话：95525、4008888788

公司网站：www.ebscn.com

（47）广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836920

联系人：梁微

客服电话：95396

公司网站：www.gzs.com.cn

（48）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市净月区生态大街6666号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

客服电话：95360

公司网站：www.nesc.cn

（49）上海证券有限责任公司

住所：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

办公地址：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人：李俊杰

电话：021-53686888

传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008

联系人：王芬

客服电话：021-962518

公司网站：[www.962518.com](http://www.962518.com)

（50）国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦7-9层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：祁昊

客服电话：95570

公司网站：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

（51）浙商证券股份有限公司

住所：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座

办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座

法定代表人：吴承根

电话：021-80108518

传真：021-80106010

联系人：陆云

客服电话：95345

公司网站：[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)

（52）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：詹露阳

电话：021-38631117

传真：0755-82400862

联系人：石静武

客服电话：95511-8

公司网站：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

（53）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

联系人：汪燕、范超

客服电话：95318，4008096518

公司网站：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

（54）国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦28楼

法定代表人：何春梅

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

客户服务电话：95563

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

（55）财富证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：孙智勇

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

联系人：郭磊

客服电话：0731-84403350

公司网站：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

（56）东莞证券股份有限公司

住所：东莞市莞城区可园南路1号金源中心

办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心

电话：0769-22115712

传真：0769-22115712

联系人：李荣

客服电话：95328

公司网站：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

（57）中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：菅明军

电话：0371-69099882

传真：0371-65585899

联系人：程月艳 李盼盼

客服电话：95377

公司网站：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

（58）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街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南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：王少华

电话：010-84183333

传真：010-84183311

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

公司网站：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

（59）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层  
办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦  
法定代表人：朱科敏  
电话：021-20333333  
传真：021-50498825  
联系人：王一彦  
客服电话：95531；400-888-8588  
公司网站：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（60）中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F  
办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F  
法定代表人：宁敏  
电话：021-20328000  
传真：021-50372474  
联系人：王炜哲  
客服电话：400-620-8888  
公司网站：[www.bocichina.com.cn](http://www.bocichina.com.cn)

（61）国盛证券有限责任公司

住所：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦  
办公地址：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦  
法定代表人：徐丽峰  
电话：0791-86281305  
传真：0791-86281305  
联系人：周欣玲  
客服电话：4008222111  
公司网站：[www.gsstock.com](http://www.gsstock.com)

（62）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

传真：021-20315137

联系人：许曼华

客服电话：95538

公司网站：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

（63）第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-23838751

传真：0755-25838701

联系人：吴军

客服电话：95358

公司网站：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

（64）中航证券有限公司

住所：南昌市红谷滩中心区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 41 层

办公地址：南昌市红谷滩中心区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 41 层

法定代表人：王宜四

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：史江磊

客服电话：400-8866-567

公司网站：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

（65）华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层



办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼

法定代表人：黄金琳

电话：021-20655183

传真：021-20655196

联系人：王虹

客服电话：96326（福建省外加拨 0591）

公司网站：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

（66）华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

联系人：范坤

客服电话：95368

公司网站：[www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

（67）中国国际金融股份有限公司

住所：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：陈曦、杨涵宇、任敏

客服电话：4009101166

公司网站：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

（68）财通证券股份有限公司

住所：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

电话：0571-87925129

传真：0571-87818329

联系人：夏吉慧

客服电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

公司网站：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

（69）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

传真：021-54967293

联系人：杨莉娟

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

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

（70）瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12、15层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12、15层

法定代表人：程宜荪

电话：010-58328971

传真：010-58328748

联系人：马牧

客服电话：400-887-8827

公司网站：[www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com)

（71）中国中投证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

办公地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

电话：0755-820236907

传真：0755-82026539

联系人：万玉琳

客服电话：400-600-8008、95532

公司网站：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（72）国融证券股份有限公司

住所：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与呈祥路交汇处武川立农村镇  
银行股份有限公司四楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融大厦11层

法定代表人：张智河

电话：010-83991777

传真：010-66412537

联系人：郭一非

客服电话：95385

公司网站：[www.grzq.com](http://www.grzq.com)

（73）联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

电话：0752-2119700

传真：0752-2119660

联系人：彭莲

客户服务电话：95564

公司网址：[www.lxsec.com](http://www.lxsec.com)

（74）江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

联系人：周俊

客服电话：400-666-2288

公司网站：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

（75）国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服电话：95310

公司网站：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

（76）华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

法定代表人：陈林

电话：021-68778790

传真：021-68777992

联系人：刘闻川

客服电话：400-820-9898

公司网站：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

（77）长城国瑞证券有限公司

住所：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人：王勇

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

联系人：赵钦

客服电话：0592-5163588

公司网站：[www.xmzq.cn](http://www.xmzq.cn)

（78）爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼

办公地址：上海市浦东世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼

法定代表人：钱华

电话：021-32229888

传真：021-68728707

联系人：王薇

客服电话：4001-962502

公司网站：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

（79）华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12层

法定代表人：祝献忠

电话：010-85556100

传真：010-85556153

联系人：李慧灵

客服电话：400-898-9999

公司网站：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

（80）财达证券有限责任公司

住所：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至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23至26层

法定代表人：翟建强

电话：0311-66006342

传真：0311-66006201

联系人：马辉

客服电话：4006128888

公司网址：[www.S10000.com](http://www.S10000.com)

（81）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座505

法定代表人：林义相

联系电话：010-66045515

传真：010-66045518

联系人：谭磊

客服电话：010-66045678

天相投顾网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

（82）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

电话：010-85650628

传真：010-65884788

联系人：刘洋

客服电话：400-920-0022

公司网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

（83）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：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：021-38602377

传真：021-38509777

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)

（84）深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳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

传真：0755-33227951

联系人：童彩平

客户服务电话：4006-788-887

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

（85）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509988

传真：021-54660501

客服电话：95021

公司网站：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

（86）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：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

传真：021-68596916

联系人：王诗琦

客户服务电话：400-700-9665

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

（87）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

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

（88）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

联系人：单丙焱

电话：021-20691832

传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

（89）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常大道同顺路18号同花顺大楼4层

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818-8653

传真：0571-86800423

联系人：刘晓倩

客服电话：4008-773-772



公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(90) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366

传真：010-62020355

联系人：张云

客服电话：400-818-8000

公司网站：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(91) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：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SOHO现代城C座1809室

法定代表人：戎兵

电话：010-52413385

传真：010-85894285

联系人：魏晨

客服电话：400-6099-200

公司网站：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(92) 上海大智慧财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元

法定代表人：申健

电话：021-20219988

传真：021-20219923

联系人：胡旦

客服电话：021-20292031

公司网站：[8.gw.com.cn](http://8.gw.com.cn)

（93）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：上海市福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

电话：021-52822063

传真：021-52975270

联系人：兰敏

客服电话：400-046-6788

网站：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

（94）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区100号19层

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：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

联系人：周丹

客服电话：400-820-2819

网站：[fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

（95）中信建投期货有限公司

住所：重庆渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B、C

办公地址：重庆渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼

法定代表人：彭文德

电话：023-86769637

传真：023-86769629

联系人：刘芸

客服电话：400-8877-780

公司网站：[www.cfc108.com](http://www.cfc108.com)

(96) 中信期货有限公司

住所：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

办公地址：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：张皓

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

联系人：刘宏莹

客户服务电话：400-990-8826

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

(97) 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14楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户服务电话：4008219031

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

(98) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：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

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

电话：020-89629021

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

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

(99) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市河东区三亚河东路海康商务 12、13 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

电 话：010-59053779

传 真：010-59053700

联系人：龙尧

客户服务电话：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com>

(100) 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 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

电 话：0571-88337717

传 真：0571-88337666

联系人：孙成岩

客户服务电话：400-068-0058

公司网站：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(101) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人：陈超

联系人：江卉

电话：010-89189288

传真：010-89188000

客服电话：400 098 8511

网站：<http://fund.jd.com/>

(102) 北京汇成基金销售有限公司

住所：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

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

公司网站：[www.hcjjin.com](http://www.hcjjin.com)

(103) 上海通华财富资产管理有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼9楼

法定代表人：兰奇

传真：021-60818280

联系人：庄洁茹

客服电话：95156

公司官网：<https://www.tonghuafund.com>

(104) 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：上海市浦东新区峨山路91弄61号14楼

法定代表人：李兴春

传真：021-50583633

联系人：陈孜明

客服电话：400-921-7755

公司官网：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

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代理销售

本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：国投瑞银基金管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路638号7层

办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

法定代表人：叶柏寿

电话：(0755)83575836

传真：(0755)82912534

联系人：冯伟

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：廖海、刘佳

联系人：刘佳

（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）

注册地址：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：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：陈玲、曹阳

#### 四、基金的名称

本基金名称：国投瑞银优化增强债券型证券投资基金。

#### 五、基金的类型

本基金类型：债券型。基金运作方式：契约型、开放式。

#### 六、基金的投资目标

在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资金流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。本基金既可以参与一级市场新股申购或增发新股，也可以在二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，其中权证投资的比例不超过基金资产净值的3%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

#### 八、基金的投资策略

##### （一）资产配置

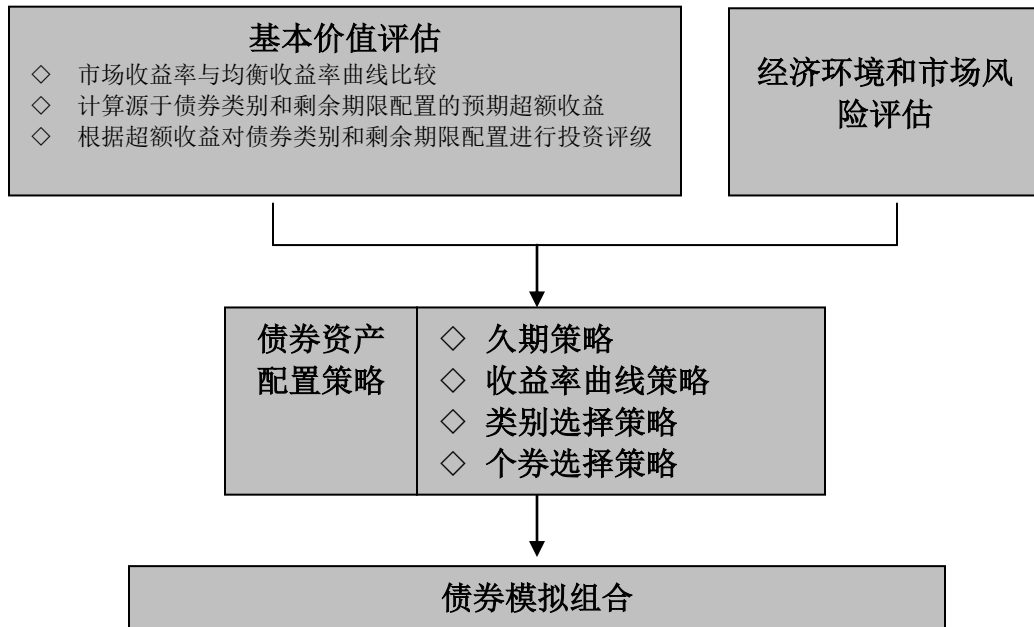
本基金采取稳健灵活的投资策略，通过固定收益类金融工具的主动管理，力求降低基金净值波动风险，并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测，适度参与一级市场新股和增发新股的申购以及二级市场的股票投资，力求提高基金总

体收益率。

（二）债券投资管理

本基金借鉴 UBS AM 固定收益组合的管理方法，采取“自上而下”的债券分析方法，注重挖掘债券收益率曲线期限结构与信用利差的变动趋势中隐含的投资机会，确定债券模拟组合，并管理组合风险。

图 1、债券组合构建流程



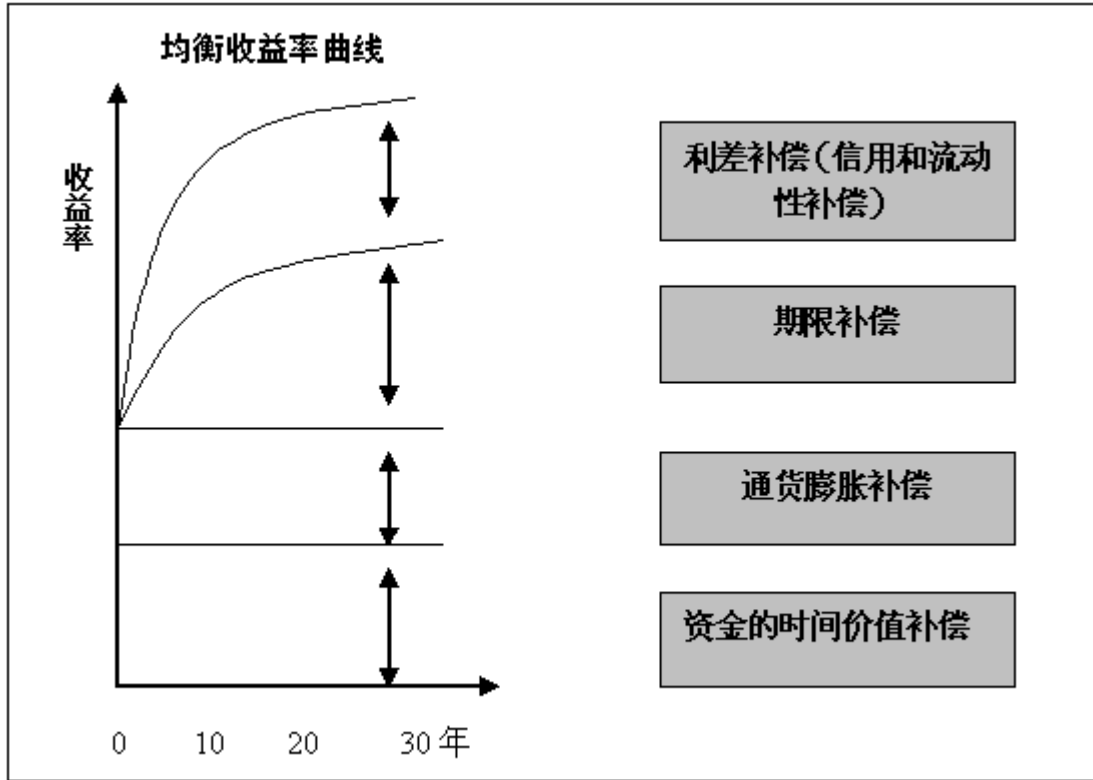
1、基本价值评估

债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线(Equilibrium Yield Curves)。

均衡收益率曲线是指，当所有相关的风险都得到补偿时，收益率曲线的合理位置。风险补偿包括四个方面：资金的时间价值（补偿）、通货膨胀补偿、期限补偿、利差补偿（流动性及信用风险补偿）。通过对这四个部分风险补偿的计量分析，得到均衡收益率曲线及其预期变化。市场收益率曲线与均衡收益率曲线的差异是估算各种剩余期限的个券及组合预期回报的基础。

图 2、均衡收益率曲线图





基于均衡收益率曲线，计算不同资产类别、不同剩余期限债券品种的预期超额回报，并对预期超额回报进行排序，得到投资评级。在此基础上，卖出内部收益率低于均衡收益率的债券，买入内部收益率高于均衡收益率的债券。

## 2、债券投资策略

债券投资策略主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同的时期，采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同，基金管理人根据债券组合允许的风险程度和市场状况运用相关策略。

久期策略是指，根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估，基于市场利率走势预判以及基金债券投资对风险收益的特定要求，确定债券组合的久期配置。由于债券久期反映了债券价格对市场利率变化的敏感度，一般情况下，如果预测利率将上升，基金管理人可适当降低组合的目标久期；如果预测利率将下降，则可适当延长组合的目标久期。

收益率曲线策略是指，首先评估均衡收益率水平，以及均衡收益率曲线合理形态。然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，评估不同剩余期限下的价

值偏离程度。在满足既定的组合久期要求下，通过分析预测收益率曲线可能发生的形变，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，优化组合的期限结构，以获取收益率曲线变动带来的收益。

类别选择策略是指在国债、金融债、央行票据和企业债等债券类别间的配置。债券类别间估值比较基于类别债券市场基本因素的数量化分析（包括利差波动、信用转移概率、流动性等数量分析），在遵循价格/内在价值原则下，根据类别资产间的利差合理性进行债券类别选择。在类别选择上，本基金注重挖掘信用品种中信用利差隐含的投资机会，包括高品质信用产品的信用风险利差溢价和信用利差波动带来的互换套利，等等。

个券选择策略是指，通过自下而上的债券分析流程，鉴别出价值被市场误估的债券，择机投资低估债券，抛出高估债券。个券分析建立在价格/内在价值分析基础上，并将考虑信用风险、流动性和个券的特有因素等。

### 3、可转换债券的投资管理

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本面优良的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具进行定价。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

### 4、资产支持证券的投资管理

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，以数量化模型确定其内在价值。

### 5、组合构建及调整

由基金管理人投资主管和债券组负责人组成债券策略组。该小组将借鉴 UBS AM 债券研究方法，结合各成员债券投资管理经验，评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠，据此构建债券模拟组合。

债券策略组定期开会讨论债券策略组合，买入低估债券，卖出高估债券。同时从风险管理的角度，评估组合调整对组合久期、类别权重等的影响。

随着债券市场的发展与金融创新的深入，以及日后相关法律法规允许本基金可

投资的固定收益类金融工具出现时，本基金将基于审慎的原则，对这些新品种予以评估，在满足本基金投资目标的前提下适时调整基金投资品种的范围和投资比例。

### （三）股票投资策略

#### 1、一级市场新股申购策略

本基金将在评估新股申购收益与风险状况的基础上参与新股申购。在进行新股申购时，基金管理人将结合金融工程数量化模型，使用 GEVS 模型等方法评估股票的内在价值，充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果，对于拟发行上市的新股（或增发新股）等权益类资产价值进行深入发掘，评估申购收益率，并通过对申购资金的积极管理，制定相应的申购和择时卖出策略以获取较好投资收益。

#### 考量公司基本面

本基金评估公司基本面的主要指标包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。分析师从定性和定量两个方面考量行业竞争趋势、公司的竞争地位、短期和长期内公司现金流增长的主要驱动因素，业务发展的关键点以及公司治理结构状况。

#### 评估股票价值

本基金借鉴 GEVS，以合适方法评估股票投资价值。GEVS 是 UBS AM 在全球使用了 20 多年的权益估值模型。模型分阶段考量现金流量增长率，得到各阶段现金流的现值总和，即股票的内在价值。市场价格与内在价值的差幅是本基金买入或沽出股票的主要参考依据。本基金在借鉴 GEVS 方法时，将会考虑中国股票市场特点和某些行业或公司的具体情况。

在实践中，现金流量贴现模型可能有应用效果不理想的情形。根据实际情况和基金管理人对 IPO 公司的了解深入程度，本基金还将选用其它合适的估值方法，如 P/E、P/B、EV/EBITA 等方法。

#### 投资管理策略

本基金结合发行市场资金状况和近期新股上市首日表现，预测股票上市后的市场价格，分析和比较申购收益率和中签率，从而决定是否参与新股申购和参与金额。

一般情况下，本基金对获配新股将在可流通之首日起即择机卖出，以控制基金净值的波动。若可流通初期价格低于合理估值，则会等待至价格上升至合理价位时

卖出。

## 2、二级市场股票投资策略

基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，在本基金合同约定范围内直接投资二级股票市场，努力获取超额收益。在股票投资方面，基金管理人将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。

基金管理人在剔除了流动性差或公司经营存在重大问题且近期无解决方案的上市公司股票后，形成股票初选库。在稳健投资方面，基金管理人以现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好现金分红记录或分红潜力的优质公司作为主要投资目标。其中主要研究指标包括股息收益率、历史分红频率和数量等。在灵活投资方面，则以主题投资为主线，着重投资在中国经济增长进程和股票市场发展中均有代表性的投资主题所覆盖的优质上市公司股票。投资主题的挖掘主要是通过深入研究中国经济、社会发展过程中的结构性变化和趋势性规律，有效分析影响经济发展和企业盈利的关键性、群体性和趋势性因素，结合股票市场板块运行特征和动态估值水平而得来的。

对于所有股票的选择，基金管理人会借鉴 UBS AM 在全球使用了 20 多年的权益估值模型 GEVS 等估值方法来合理估计股票投资价值，并从定量和定性两方面全面考量公司基本面，包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。

在形成可执行组合之前，组合需经风险考量和风险调整。基金管理人借鉴 GRS 等风险管理系统技术，对模拟组合（事前）和实际投资组合（事后）进行风险评估、绩效与归因分析，从而确定可执行组合以及组合调整策略。

## 九、基金的业绩比较基准

中债总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

沪深 300 指数是由中证指数公司开发的中国 A 股市场统一指数，它的样本选自

沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势，具有权威性，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

本业绩比较基准符合本基金的投资风格，并反映本基金的风险收益特征。

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，基金管理人可以在与基金托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

## 十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	248,656,150.50	11.12
	其中：股票	248,656,150.50	11.12
2	固定收益投资	1,830,474,574.10	81.85
	其中：债券	1,830,474,574.10	81.85
	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	58,896,249.95	2.63
	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	45,640,955.54	2.04
7	其他各项资产	52,699,112.90	2.36
8	合计	2,236,367,042.99	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	105,048,287.94	5.94
C	制造业	74,886,977.00	4.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,311,888.32	1.03
F	批发和零售业	11,742,385.96	0.66
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	-	-
J	金融业	26,006,593.28	1.47
K	房地产业	6,922,812.00	0.39

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	-	-
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	5,737,206.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	248,656,150.50	14.05

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	14,216,280.00	84,302,540.40	4.76
2	000968	蓝焰控股	1,434,699.00	20,745,747.54	1.17
3	600019	宝钢股份	2,737,925.00	18,371,476.75	1.04
4	601668	中国建筑	1,891,724.00	18,311,888.32	1.03
5	601328	交通银行	2,504,200.00	15,425,872.00	0.87
6	600835	上海机电	705,427.00	14,912,726.78	0.84
7	600030	中信证券	621,664.00	10,580,721.28	0.60
8	002456	欧菲光	492,700.00	8,952,359.00	0.51
9	002013	中航机电	846,531.00	8,668,477.44	0.49

10	600998	九州通	380,366.00	8,200,690.96	0.46
----	--------	-----	------------	--------------	------

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	164,251,681.40	9.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	184,570,000.00	10.43
	其中：政策性金融债	184,570,000.00	10.43
4	企业债券	598,664,014.10	33.83
5	企业短期融资券	70,235,000.00	3.97
6	中期票据	671,385,000.00	37.94
7	可转债（可交换债）	141,368,878.60	7.99
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,830,474,574.10	103.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	160210	16国开10	1,900,000	174,591,000.00	9.87
2	101451061	14万科MTN001	800,000	80,400,000.00	4.54
3	113011	光大转债	700,270	73,577,368.90	4.16
4	101651022	16中生科技MTN001	700,000	68,649,000.00	3.88
5	136789	16东航01	700,000	65,359,000.00	3.69

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  
根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的, 在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2) 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3) 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	220,277.40
2	应收证券清算款	12,536,141.08
3	应收股利	-
4	应收利息	23,084,239.05
5	应收申购款	16,858,455.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,699,112.90

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	---------------

1	132002	15天集EB	30,516,114.00	1.72
2	110032	三一转债	9,866,340.00	0.56
3	110033	国贸转债	1,963,403.60	0.11
4	120001	16以岭EB	1,169,151.00	0.07
5	128013	洪涛转债	594,631.00	0.03

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002013	中航机电	8,668,477.44	0.49	重大事项停牌

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、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代表其未来表现。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。

基金净值表现详见下表：

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表（截止2017年6月30日）

国投瑞银优化增强债券 A/B

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
2010. 09. 08 (基金合同生效日) 至 2010. 12. 31	0.70%	0.20%	-2.38%	0.21%	3.08%	-0.01%

2011.01.01至 2011.12.31	-4.87%	0.29%	-0.45%	0.16%	-4.42%	0.13%
2012.01.01至 2012.12.31	6.58%	0.30%	0.31%	0.14%	6.27%	0.16%
2013.01.01至 2013.12.31	1.96%	0.16%	-5.33%	0.18%	7.29%	-0.02%
2014.01.01至 2014.12.31	31.96%	0.39%	11.43%	0.18%	20.53%	0.21%
2015.01.01至 2015.12.31	16.96%	0.41%	5.34%	0.27%	11.62%	0.14%
2016.01.01至 2016.12.31	1.10%	0.31%	-2.58%	0.19%	3.68%	0.12%
2017.01.01至 2017.06.30	3.17%	0.14%	-1.21%	0.12%	4.38%	0.02%
自基金合同生 效日至今	67.57%	0.31%	4.25%	0.19%	63.32%	0.12%

国投瑞银优化增强债券 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
2010.09.08 (基金合同生 效日) 至2010.12.31	0.60%	0.20%	-2.38%	0.21%	2.98%	-0.01%
2011.01.01至 2011.12.31	-5.27%	0.29%	-0.45%	0.16%	-4.82%	0.13%
2012.01.01至 2012.12.31	6.19%	0.30%	0.31%	0.14%	5.88%	0.16%
2013.01.01至 2013.12.31	1.48%	0.16%	-5.33%	0.18%	6.81%	-0.02%

2014.01.01至 2014.12.31	31.28%	0.39%	11.43%	0.18%	19.85%	0.21%
2015.01.01至 2015.12.31	16.57%	0.41%	5.34%	0.27%	11.23%	0.14%
2016.01.01至 2016.12.31	0.65%	0.31%	-2.58%	0.19%	3.23%	0.12%
2017.01.01至 2017.06.30	3.13%	0.13%	-1.21%	0.12%	4.34%	0.01%
自基金合同生 效日至今	63.13%	0.31%	4.25%	0.19%	58.88%	0.12%

注：1、本基金以中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%作为业绩比较基准。

中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映A股市场总体发展趋势，具有权威性，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 十三、费用概览

#### （一）与基金运作有关费用

##### 1、与基金运作有关费用列示

- （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：本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- （4）基金财产拨划支付的银行费用；
- （5）基金合同生效后的基金信息披露费用；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （8）基金的证券交易费用；

（9）银行账户维护费；

（10）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

（2）基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

（3）销售服务费

本基金A类/B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0.40%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

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提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

基金销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

基金销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

(4) 除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况，履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。调低基金管理费率、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。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、本基金的申购费用

本基金申购采用金额申购的方式。本基金A类基金份额在申购时收取基金前端申购费用；B类基金份额在赎回时收取基金后端申购费用；C类基金份额不收取申购费用（但本基金从C类基金资产中计提销售服务费）。本基金A类/B类基金份额的最

高申购费率不超过5%，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。其中，面向通过基金管理人的直销中心申购本基金A类份额（前端收费模式）的养老金客户实施特定申购费率。养老金客户范围包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，具体包括全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金和企业年金单一计划及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人将在招募说明书更新或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。本基金的申购费率如下表：

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类份额的养老金客户申购费率见下表：

A 类基金份额	
申购金额 M	前端申购费率
M<50 万	0.32%
50 万≤M<100 万	0.24%
100 万≤M<500 万	0.16%
500 万≤M	按笔收取，1000 元/笔

非养老金客户申购本基金 A 类基金份额的申购费率见下表：

A 类基金份额	
申购金额 M	前端申购费率
M<50 万	0.80%
50 万≤M<100 万	0.60%
100 万≤M<500 万	0.40%
500 万≤M	按笔收取，1000 元/笔

B 类基金份额	
持有年限 Y	后端申购费率
Y <1 年	0.90%

1年 $\leq$ Y<2年	0.70%
2年 $\leq$ Y<3年	0.40%
3年 $\leq$ Y	0%

注：上表中，1年按365天计算。

C类基金份额	
申购费率	0%

## 2、本基金的赎回费用

A、B类基金份额采取一致的赎回费率，仅对持有期不足60天的赎回申请收取赎回费，即持有期限在60日以内的A、B类基金份额，赎回费率为0.10%；持有期限超过60日（含60日）的A、B类基金份额，不收取赎回费用。C类基金份额不收取赎回费用。

### （三）基金的税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、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》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）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2017年4月21日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及投资组合报告的截止日期。
- 2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的信息。
- 3、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的信息。
- 4、在“五、相关服务机构”部分，更新了原有代销机构的信息，增加了新增代



销机构的概况。

5、在“七、基金份额的申购与赎回”部分，对基金管理人拒绝或暂停申购情形的内容做了补充说明。

6、在“八、基金的投资”部分，更新了本基金最近一期投资组合报告内容。

7、在“九、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。

8、在“二十一、其他应披露事项”部分，更新了本报告期内涉及本基金的相关公告以及其他应披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录国投瑞银基金管理有限公司网站 [www.ubssdic.com](http://www.ubssdic.com)。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一七年十月二十日