

(上接A26版)

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金管理机构可以按照规定的标准收取转托管费。

(十五) 定期定额投资计划

基金管理人以人民币办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定定期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

(十六) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可的符合法律法规的其它非交易过户。无论上述何种情况下，接受划转的主体必须是能够持有基金份额的自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请，基金管理人将根据基金登记机构规定的标准收费。

(十七) 基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 九、基金的投票

(一) 投资目标

综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。

(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、可转换债券、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金及到期日在一年以内（含一年）的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许的其他金融工具。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：股票投资占基金资产的比例为0-95%，持有单只中小企业私募债券市值不超过基金资产净值的10%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金或到期日在一年以内（含一年）的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或中国证监会允许，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。

(三) 投资策略

投资策略的选取，本基金将兼顾下行风险控制和收益获取。在资产配置策略方面，主要采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。

在股票投资策略方面，把握趋势跟踪及绝对收益两个核心，趋势跟踪策略以在某行业或个股出现趋势性机会时，积极跟随时场表现；绝对收益策略以量化策略为目标，以期获取稳定的绝对回报。在债券投资策略方面，本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及转换债券投资策略，在获取稳定收益的同时，降低基金资产净值整体的波动性。

1. 资产配置策略

本组合采用绝对收益策略与战术资产配置相结合的策略，即在各类资产的投资比例范围内，持续评估各类资产的风险收益情况，并据此动态调整各类资产配置比例，以控制基金资产净值下行风险的实时追求相对较高的收益。

本基金管理人的宏观策略和固定收益组采用定性和定量的研究方法对上述关键因素的运行状态、发展方向以及不确定程度进行深入分析和研究，并结合金融工程小组自行研发的量化趋势识别模型、量化风险度量模型以及第三方研究机构的研究成果定期或不定期向投资决策委员会和基金经理提交报告，跟踪市场趋势及对宏观经济、行业、股票、债券等资产的分析，为基金经理根据最新的市场运行情况以及对申购赎回情况的预期对大类资产的比例范围进行适度调整。

2. 股票投资策略

(1) 趋势追随策略

趋势追随策略是指在某行业或个股出现趋势性机会时，积极跟随时场表现。

行业配置策略主要基于对行业景气趋势的分析判断，依据不同行业景气趋势的周期长短采用核心-卫星配置策略。其中，核心资产重点配置于具有中期景气上升趋势的行业，卫星资产则动态配置于短期景气上升趋势的行业中。

本基金通过对上市公司盈利增长趋势以及市场价格趋势两个维度的综合考量，将好公司与好股票有机结合，前瞻性地把握A股市场中存在的具有综合趋势机会的个股，进一步结合对上市公司品质的评价构建最终的投资组合。

(2) 绝对收益策略

绝对收益策略以套利策略为目标，以期获取稳定的绝对回报。

1) 定向增发策略

本基金的定向增发策略将结合考虑标的股票所处行业发展状态、未来成长空间、募投项目情况以及折价率等因素，对定向增发股票进行合理配置。

2) 股票投资策略

本基金将结合基金管理人独立开发并长期实践使用的成长股选股体系，并对定向增发的股票未来ROE(净资产收益率)以及EPS(每股收益)等指标进行重新分析和跟踪。一方面，行业研究员通过对股票的股票(包括上市公司本身,上市公司供应商、客户以及竞争对手等)的实地调研，对公司的营运状况、竞争优势以及治理结构等情况进行定性的深入；另一方面，通过扎实的案头研究，积极跟随时场表现；绝对收益策略以量化策略为目标，以期获取稳定的绝对回报。在债券投资策略方面，本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及转换债券投资策略，在获取稳定收益的同时，降低基金资产净值整体的波动性。

3. 债券投资策略

(1) 趋势追随策略

趋势追随策略是指在某行业或个股出现趋势性机会时，积极跟随时场表现。

行业配置策略主要基于对行业景气趋势的分析判断，依据不同行业景气趋势的周期长短采用核心-卫星配置策略。其中，核心资产重点配置于具有中期景气上升趋势的行业，卫星资产则动态配置于短期景气上升趋势的行业中。

本基金将结合基金管理人独立开发并长期实践使用的成长股选股体系，并对定向增发的股票未来ROE(净资产收益率)以及EPS(每股收益)等指标进行重新分析和跟踪。一方面，行业研究员通过对股票的股票(包括上市公司本身,上市公司供应商、客户以及竞争对手等)的实地调研，对公司的营运状况、竞争优势以及治理结构等情况进行定性的深入；另一方面，通过扎实的案头研究，积极跟随时场表现；绝对收益策略以量化策略为目标，以期获取稳定的绝对回报。在债券投资策略方面，本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及转换债券投资策略，在获取稳定收益的同时，降低基金资产净值整体的波动性。

4) 高送转策略

高送转策略是指在二级市场的买入其公司股票的行为。从逻辑上分析，高送转行为可以反映股东对上市公司的认同，进而显示管理层对公司的未来发展前景充满信心，认为公司未来的发展前景较好。

5) 高管增持

高管增持事件是指高管在二级市场的买入其公司股票的行为。从逻辑上分析，高管增持行为可以反映股东对上市公司的认同，进而显示管理层对公司的未来发展前景充满信心，认为公司未来的发展前景较好。

6) 股权激励

高送转行为对于上市公司而言只是财务报表上的调整，但高送转往往显示公司高速发展的情况，敢于不断的进行股本扩张，一般都有持续的业绩增长作后盾，说明企业对业绩持续增长抱有信心，不惧股东的增持；另一方面，送配后大幅除权使每股价降低，股票的流动性也会有所增强，可以吸引更多的增量资金进入。

3) 大宗交易策略

本基金的大宗交易策略是指通过大宗交易市场股价波动的突发性事件，把握市场上对上市公司定价与实际价值之间的显著差异，对个股进行配置调整和优化，以获取事件发生前后股价与价值之间的回归收益。本基金的个股驱动策略将通过政策研究、公司调研、数据分析、数据收集、数据挖掘等一系列定价与定量的研究方法，对在市场持有期间可获得的事件进行进阶分析并择机买入。

4) 事件驱动策略

本基金的事件驱动策略主要指通过分析影响上市公司股价波动的突发性事件，把握市场上对上市公司定价与实际价值之间的显著差异，对个股进行配置调整和优化，以获取事件发生前后股价与价值之间的回归收益。本基金的个股驱动策略将通过政策研究、公司调研、数据分析、数据收集、数据挖掘等一系列定价与定量的研究方法，对在市场持有期间可获得的事件进行进阶分析并择机买入。

5) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

6) 债券投资策略

本基金在短期、中期、长期品种的配置上主要采用收益曲线策略。

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

7) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

8) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

9) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

10) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

11) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

12) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

13) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

14) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

15) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

16) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

17) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

18) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

19) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

20) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

21) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

22) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

23) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

24) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

25) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

26) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

27) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

28) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

29) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

30) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

31) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

32) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

33) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

34) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

35) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

36) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

37) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

38) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

39) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

40) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

41) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

42) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和子弹策略(即组合的证券期限策略)。

43) 信用策略

本基金将基于信用分析的手段比较不同的收益曲线投资策略，即子弹策略(即组合的证券期限策略)和