

（上接A26版）

A类份额	持有期限(N为日历日)	费率	计入基金财产比例
	1天≤N<7天	1.50%	100%
	7天≤N<30天	0.75%	100%
	30天≤N<90天	0.50%	75%
	90天≤N<180天	0.50%	50%
C类份额	持有期限(N为日历日)	费率	计入基金财产比例
	1天≤N<30天	0.50%	100%
	30天≤N<365天	0.10%	100%
	365天≤N<730天	0.05%	100%
	N≥730天	0%	—

3.基金管理人可以在履行相关手续后,在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或收费方式,基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上公告。

4.对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),在不违背法律法规规定的情况下,基金管理人可以适当调低基金申购费和基金赎回费率。

5.基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对基金投资者适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

七、申购费用和赎回费用的计算公式

申购费用=申购金额×申购费率
(1)若投资者选择A类基金份额,则申购份额的计算公式为:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
净申购金额=申购金额-固定申购费金额
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
申购当日基金份额净值=申购当日基金份额净值
例,某投资者投资50,000元申购本基金A类基金份额,对应费率为1.2%,假设申购当日A类基金份额净值为1.016元,则其可得申购的申购份额为:
净申购金额=50,000/(1+1.2%)=49,407.11元
申购费用=50,000-49,407.11=592.89元
申购份额=49,407.11/1.016=48,629.06份
申购者投资50,000元申购本基金A类基金份额,对应费率为1.2%,假设申购当日A类基金份额净值为1.016元,则其可得申购的申购份额为:
净申购金额=50,000/(1+1.2%)=49,407.11元
申购费用=50,000-49,407.11=592.89元
申购份额=49,407.11/1.016=48,629.06份

(2)若投资者选择申购C类基金份额,则申购份额的计算公式为:
申购费用=申购金额×申购费率
净申购金额=申购金额-申购费用
申购当日基金份额净值=申购当日基金份额净值
例,某投资者投资50,000元申购本基金的C类基金份额,假设申购当日C类基金份额净值为1.016元,则其可得申购的申购份额为:
申购费用=50,000/(1+0.16%)=49,918.24份

2.本基金赎回费率的计算:
采用“份额赎回”方式,赎回按赎回日T日的基金份额净值为基础进行计算,计算公式:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例,某投资者赎回10万份本基金基金份额,份额持有期限100天,对应赎回费率为0.5%,假设赎回当日A类基金份额净值是1.213元,则其可得赎回的赎回金额为:
赎回总金额=100,000×1.213=121,300.00元
赎回费用=121,300.00×0.5%=606.50元
净赎回金额=121,300.00-606.50=120,693.50元

例,某投资者赎回本基金10万份A类基金份额,份额持有期限100天,假设赎回当日A类基金份额净值是1.213元,则其可得赎回的赎回金额为120,693.50元

例,某投资者赎回10万份C类基金份额,份额持有期限10天,对应赎回费率为0.50%,假设赎回当日C类基金份额净值为1.100元,则其可得赎回的赎回金额为:
赎回金额=100,000×1.100=110,000.00元
赎回费用=110,000.00×0.50%=5500.00元
净赎回金额=110,000.00-5500.00=104,500.00元

例,某投资者赎回10万份C类基金份额,份额持有期限10天,对应赎回费率为0.50%,假设赎回当日C类基金份额净值为1.100元,则其可得赎回的赎回金额为109,450.00元

3.本基金基金份额净值的计算:
计算公式为:T日某类基金份额净值=T日该类基金份额的基金资产净值/T日该类基金份额的余额数量

本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值将在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

4.申购份额、赎回金额的处理方式:
申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均四舍五入至小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

5.赎回金额的处理方式:
赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

八、申购赎回的注册登记
1.投资者于T日申购本基金成功后,正常情况下,基金注册登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理注册登记手续,投资者于T+2日起有权赎回该部分基金份额。

2.投资者于T日赎回本基金成功后,正常情况下,基金注册登记机构在T+1日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施前3个工作日内在指定媒介上公告。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理
发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

- 因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资者的申购申请。
- 证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益。
- 基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金财产产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 法律法规及中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、7项暂停申购情形且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理
发生下列情况时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项:

- 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益。
- 法律法规及中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日公告暂停赎回,并已在指定媒介上刊登暂停赎回公告。如果发生上述暂停赎回情形,基金管理人应暂停接受赎回申请,并暂停支付赎回款项。在暂停赎回期间,基金管理人应暂停接受赎回申请,并暂停支付赎回款项。在暂停赎回期间,基金管理人应暂停接受赎回申请,并暂停支付赎回款项。在暂停赎回期间,基金管理人应暂停接受赎回申请,并暂停支付赎回款项。

十一、巨额赎回的情形及处理方式
若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换转出申请份额总数扣除申购申请份额总数及基金转换转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2.巨额赎回的处理方式
当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应当在指定媒介上公告,并暂停接受下一个开放日基金份额的赎回申请,并暂停接受下一个开放日基金份额的赎回申请。

1.发生上述暂停申购或赎回情形时,基金管理人应当立即向中国证监会备案,并在指定媒介上刊登暂停公告。

2.如发生暂停申购的情形为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近一个开放日的基金份额净值。

3.如发生暂停赎回的情形超过一天但少于两周,暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

4.如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

十三、基金的分红
基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构,但本基金A类基金份额和C类基金份额之间暂不允许进行互相转换。

十四、基金份额的转让
在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十五、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可受理符合法律法规规定的其它非交易过户,无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

继承指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给合法的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、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提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的办理规定,并经基金登记机构审核后办理。

十六、转托管
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,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十七、定期定额投资计划
基金管理人可以受理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,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扣款金额。

十八、基金的销售与解除
基金登记机构只受理国家有关基金立法要求的基金份额的销售与解除,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的销售与解除。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第九部分 基金的投资

一、投资目标
在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。

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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,以及债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行上市国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、国债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)、国债期货以及法律法规和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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金,基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例不超过30%,债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于70%,其中每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的保证金后,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%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围,并做出相应调整。

三、投资策略
(一)大类资产配置
本基金在宏观经分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况进行调整,债券和现金等大类资产配置比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。

(二)债券投资策略
本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。

1.久期配置策略
本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。

2.类属配置策略
类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金通过情景分析和历史预测相结合的方法,“自上而下”在债券一级市场和二级市场、银行间市场和交易所市场、银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置,进而确定具有最优风险收益特征的投资组合。

3.个股选择策略
(1)国债、央行票据等非信用类债券,本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析,预测未来收益率曲线的变动趋势,综合考虑流动性及信用风险因素,对信用类债券,本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素,对信用债进行信用风险评估,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略,严格控制组合整体的违约风险水平。

4.可转债投资策略
可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入研究以明确该可转债的偿债保障,防范信用风险,另一方面,还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究,从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察,精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。

5.中小企业私募债券投资策略
本基金对中小企业私募债券的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的资质、行业、经营情况,以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整,适度分散投资来管理组合的风险。

6.资产支持证券投资策略
资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

(三)股票投资策略
在严格控制风险、保持资产流动性的前提下,本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资,以增加基金收益。

本基金主要采用“自下而上”的个股选择方法,在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法筛选个股。

(1)首先,用定量分析的方法,通过财务和运营数据对企业价值进行评估,初步筛选出具备优势的股票备选库。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。

①盈利能力
本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力,主要参考的指标包括净资产收益率(ROE)、毛利率、净利率、EBITDA/主营业务收入等。

②成长能力
投资行业上重视投资价值与成长潜力的平衡,一方面利用价值投资标准筛选低股价股票,避免市场波动和个股估值溢价率较高的个股,另一方面,利用成长性分析分享高成长收益的机会。本基金通过成长能力分析评估上市公司未来的盈利增长潜力,主要参考的指标包括EPS、增长率和主营业务收入增长率等。

③估值水平
本基金通过估值水平分析评估当前市场估值的合理性,主要参考的指标包括市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈增长比率(PEG)、自由现金流贴现(PCFF、FCFE)和股利支付率/EBITDA等。

(2)其次,使用定性分析的方法,从持续增长、市场前景以及公司治理结构等方面进行对上市公司进行进一步的筛选。

①持续增长性的分析,通过上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入研究,评估具有持续成长能力的上市公司。

②在市场前景方面,需要考察的因素包括市场广度、深度、政策扶持的力度以及上市公司利用技术创新能力取得竞争优势、开拓市场、进而创造利润增长的能力。

③公司治理结构的优劣对包括公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。本基金将从上市公司治理结构评价、战略定位和管理制度体系等方面对公司治理结构进行评价。

(4)金融衍生品投资策略
1.股指期货投资策略
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的期货合约,并跟踪对证券市场风险和期货市场运行趋势的判断,以及对股指期货合约的估值定价,与股票资产进行匹配,实现多或空头的套期保值操作,由此获得套期保值产生的超额收益。本基金在运用股指期货时,将充分考虑到股指期货的流动性及风险收益特征,对冲系统性风险以及特殊情况下下的流动性风险,以改善投资组合的风险收益特征。

2.权证投资策略
权证为基金管理人投资,投资原则为有利于加强基金组合的投资管理,有利于基金资产增值。在行使权证投资时,基金管理人将通过权证估值的基本面分析,并结合权证定价模型寻求其合理公允价值,根据权证的红利性、成长性、流动性等特性,选择收益投资、趋势投资、优化组合、获利投资策略进行权证投资。基金管理人将充分关注权证的投资价值、流动性及特殊情况下下的流动性风险,以改善投资组合的风险收益特征。

3.国债期货投资策略
国债期货作为风险管理衍生工具,有助于管理债券组合的久期、流动性及风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对国债期货进行定价及资金管理,构建量化分析体系,对国债期货和现货基金、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度内降低基金资产成本的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

四、投资决策依据和投资程序
(一)投资决策依据
1.国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

2.宏观经济政策趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。

(二)投资决策程序
1.投资决策委员会制定整体投资策略。

2.研究发展部根据自身或其他研究机构的研究成果,构建股票备选库,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供个股投资支持;固定收益部提供研究小组提供债券投资支持。

3.基金管理人根据投资决策委员会的投资决策,根据投研联席会议的决议,结合对证券市场、上市公司、投资标的的分析,拟订详细具体的投资建议计划,包括:资产配置、行业配置、重仓个股投资方案。

4.投资决策委员会对基金投资组合的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

5.根据决策纪要,基金管理人小组构造具体的投资组合及操作方案,由中央交易室执行。

6.中央交易室按照相关交易规则执行,并将投资信息反馈基金经理小组。

7.监察稽核部对绩效评价与风险管理小组重点监控基金投资组合的市场风险和流动性风险,定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交评估意见和改进方案。

五、业绩比较基准
本基金业绩比较基准:30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率。

采用上述比较基准主要基于以下考虑:

1.作为行业指数提供服务的指数,中证指数公司提供的中证系列指数体系具有一定的优势和市场影响力;

(2)在中证系列指数中,沪深300指数的市场代表性比较强,适合作为本基金股票投资的比较基准;而中证全债指数能够较好的反映债券市场变动趋势,适合作为本基金债券投资的比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制指数或更改指数名称,本基金可以在中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、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,本基金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。

六、风险收益特征
本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益特征的基金。

七、组合限制
本基金的投资组合将遵循以下限制:

1.股票等权益类资产占基金资产的比例不超过30%,债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不超过70%;

2.每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

3.本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

4.本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

5.本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

6.本基金管理人管理的全部基金持有一同一权证,不得超过该权证的10%;

7.本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

8.本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

9.本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

10.本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

11.本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

12.本基金投资于信用评级为BBB(含BBB)的资产支持证券,其基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

13.本基金资产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过该次股票发行总规模的比例;

14.本基金一年内,债券回购到期后滚动进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%,债券回购购最长为1年,债券回购期间后不得展期;

15.本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

16.本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

17.在任何交易日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中有:有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入的金融债券等;

18.在任何交易日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金资产净值的20%;在任何交易日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金资产净值的20%;在任何交易日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金资产净值的20%;

19.本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

20.本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

21.在任何交易日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;在任何交易日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金资产净值的15%;本基金持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

22.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

23.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

24.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

25.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

26.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

27.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

28.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

29.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

30.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

31.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

32.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

33.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

34.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

35.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

36.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

37.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

38.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

39.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

40.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

41.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

42.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

43.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

44.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

45.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

46.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

47.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

48.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

49.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

50.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

51.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

52.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

53.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

54.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

55.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

56.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

57.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

58.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

59.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

60.在任何交易日终,持有的国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;