

(上接B168版)

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 52, 53, 54, 55, 56, 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69, 70, 71, 72, 73, 74, 75, 76, 77, 78, 79, 80, 81.

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 82, 83, 84, 85, 86, 87, 88, 89, 90, 91, 92, 93, 94, 95, 96, 97, 98, 99, 100, 101, 102, 103, 104, 105, 106, 107, 108, 109, 110, 111, 112.

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 113, 114, 115, 116, 117, 118, 119, 120, 121, 122, 123, 124.

资类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面,并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等因素,确定最终的投资决策。
4. 权证投资策略
本基金在进行权证投资时,将通过对其标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑权证的风险收益、价值投资策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖出保护性的认购权证策略等。
5. 股指期货等投资策略
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
6. 资产支持证券投资
资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和评估后进行投资。
7. 基金资产估值
本基金将按照《证券投资基金会计核算业务指引》估值,以公允价值为基础,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值时,采用成本法估值。
8. 基金费用
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的费用列支按照基金合同约定执行。
9. 基金业绩比较基准
沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
10. 基金的投资目标
本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
11. 基金的投资策略
本基金的投资范围包括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的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。
12. 报告期末按行业分类的股票投资组合
13. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
14. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
15. 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股票投资明细
16. 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
17. 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
18. 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
19. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
20. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns for financial metrics and performance indicators. Includes sections for 11.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细, 11.15 报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明, 11.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细, 11.17 报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明, 11.18 基金的费用概览, 11.19 基金业绩比较基准, 11.20 基金的投资目标, 11.21 基金的投资策略, 11.22 报告期末按行业分类的股票投资组合, 11.23 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合, 11.24 报告期末按债券品种分类的债券投资组合, 11.25 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股票投资明细, 11.26 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, 11.27 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, 11.28 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, 11.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细, 11.30 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细.