

## A56 信息披露 | Disclosure

## (上接A55版)

住所:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层  
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层  
法定代表人:赵春晖  
联系人:陈剑伟  
联系电话:010-57418813  
客服电话:400-893-6885  
公司网址:www.qianjin.com  
(83)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泰街6号  
办公地址:北京市朝阳区安福路15-1号邮电新闻大厦2层  
法定代表人:闫振杰  
电话:010-59601366  
传真:010-62020355  
联系人:董文  
客户服务电话:4008188000  
公司网址:www.wyfund.com.cn  
(94)深圳市金斧子基金销售有限公司  
住所:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108  
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

法定代表人:鞠任军  
电话:0755-29330613  
传真:0755-29320530  
联系人:刘丽群  
客户服务电话:400-930-0660  
公司网址:www.ifzinv.com  
(85)上海广源达信基金销售有限公司  
住所:上海市西城区新街口外大街28号C座6层606室  
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层  
法定代表人:齐剑伟  
电话:4002228960  
传真:010-82055860  
联系人:王英霞  
客户服务电话:400-623-6060  
公司网址:www.niuniuni.com  
(86)上海中正达丰基金销售有限公司  
住所:上海市徐汇区龙漕路2815号302室  
办公地址:上海市徐汇区龙漕路2815号302室  
法定代表人:黄欣  
电话:021-33768132  
传真:021-33768132-802  
联系人:戴珉歌  
客户服务电话:4006765232  
公司网址:www.zhongzhengfund.com  
(87)北京盈泰基金销售有限公司  
办公地址:北京市西城区德胜大街合生财富广场1302室  
住所:北京市西城区德胜大街合生财富广场1302室  
法定代表人:王兴吉  
联系人:高雪超  
联系电话:18601207732  
传真:010-82057741  
客服电话:4006988080  
公司网址:www.yintaijijin.com  
(88)上海基煜基金销售有限公司  
住所:上海市崇明县长兴镇潘浦公路1800号2号楼6153室(上海泰晤士经济开发区)  
办公地址:上海市杨浦区明通路518号A1002室  
法定代表人:王翔  
联系人:蓝杰  
电话:021-65370077-220  
传真:021-56480941  
客户服务电话:021-65370077  
网址:www.jiayufund.com.cn  
(89)北京微猫金融信息服务有限公司  
住所:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119号  
办公地址:北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号  
法定代表人:许现昆  
电话:010-57649619  
传真:010-57649620  
联系人:朱翔宇  
客户服务电话:010-57649619  
公司网址:www.lanmao.com  
(90)一路财富(北京)信息科技有限公司  
住所:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208  
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208  
法定代表人:吴雪涛  
电话:4861088312877  
传真:4861088312877  
联系人:徐越  
客户服务电话:400-001-1566  
公司网址:http://www.yilucaifu.com/  
(91)南京苏宁基金销售有限公司  
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号  
法定代表人:王锋  
电话:025-66996699-887226  
传真:025-66008800-887226  
联系人:张慧  
联系电话:95177  
公司网址:www.snjijin.com  
(92)北京蛋卷基金销售有限公司  
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507  
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507  
法定代表人:钟斐斐  
电话:010-61840668  
联系人:程小涛  
客户服务电话:4000618518  
公司网址:https://danjuanapp.com/  
(93)上海联合基金销售有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k  
法定代表人:袁飞  
电话:61621602  
传真:61621602\*819  
联系人:袁振振  
客户服务电话:61621602  
公司网址:www.g-fund.com  
(94)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A座1108室  
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室  
法定代表人:王恒智  
电话:010-56251471  
传真:010-62680827  
联系人:熊小川  
客户服务电话:400-619-9059  
公司网址:www.hcjijin.com  
(95)厦门广鑫源投资股份有限公司  
住所:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼  
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼  
法定代表人:陈洪生  
电话:0692-312672  
传真:0692-3122701  
联系人:袁云波  
客户服务电话:400-9189086  
公司网址:www.xlsc.com.cn  
(96)上海攀矿基金销售有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号太平金融大厦6楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号太平金融大厦6楼  
法定代表人:田为奇  
联系人:沈捷睿  
电话:13816230097  
传真:021-68898283  
电话:021-68898082  
公司网址:htp://www.pytz.cn/  
(97)北京新浪仓石基金销售有限公司  
住所:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室  
办公地址:北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座  
法定代表人:赵志坚  
电话:010-62675888  
传真:010-62675882  
联系人:赵志坚  
客户服务电话:400-62675369  
公司网址:www.xincai.com  
(98)天津国美基金销售有限公司  
住所:天津经济技术开发区南开区工业区综合服务区办公楼D座二层202-1室  
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层  
法定代表人:丁华芳  
电话:010-58287984  
传真:010-58287825  
联系人:郭宝亮  
客服电话:400-111-0889  
公司网址:www.gomefund.com  
(99)上海华信证券有限责任公司  
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼  
办公地址:上海市黄浦区南京西路399号明天广场2号楼  
法定代表人:郭林  
电话:021-63894227  
传真:021-68776977-8427  
联系人:徐露  
客户服务电话:400-625-5999  
公司网址:www.shhxzq.com  
(100)凤凰金信(银川)基金销售有限公司  
住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402号  
办公地址:上海市浦东新区明月路18号 朝来科技产业园18号楼  
法定代表人:程刚  
电话:010-58160168  
传真:010-58160173  
联系人:张煜  
客户服务电话:400-810-5919  
公司网址:www.fengfd.com  
(101)上海云湾基金销售有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
办公地址:上海市浦东新区锦康路308号6号楼6楼  
法定代表人:戴新蓉  
电话:021-20638899  
联系人:江辉  
客户服务电话:400-820-1515  
公司网址:www.zhengtongfunds.com  
(102)南京途牛基金销售有限公司  
注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号  
办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号  
法定代表人:宋娟娟  
联系人:张士帅  
联系电话:025-86853969  
客服电话:4007-999-999  
公司网址:htp://tuniu.com  
(103)上海万得基金销售有限公司  
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心11楼B座  
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼  
法定代表人:王廷富  
联系人:徐亚丹  
联系电话:021-51327185  
传真:021-50710161  
客户服务电话:400-821-0203  
公司网址:www.520fund.com.cn  
(104)杭州蚂蚁财富基金销售有限公司  
住所:杭州市下城区武林时代商务中心1604室  
办公地址:杭州市下城区上塘路15号蚂蚁金服天广场2C楼  
法定代表人:陈刚  
联系人:张丽娟  
联系电话:0571-85262700

传真:0571-85262900  
客服电话:0571-86915761  
公司网址:www.cd121.com  
(105)北京植信基金销售有限公司  
住所:北京市密云县昌盛南路8号院2号楼106室-67  
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号  
法定代表人:杨纪伟  
联系人:魏蜀  
电话:010-56075718  
传真:010-67767615  
客服电话:400-680-2123  
网址:www.zhixin-inv.com  
(106)北京肯特瑞基金销售有限公司  
住所:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06  
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座  
法定代表人:江卉  
联系人:赵德赛  
电话:4000988511/4000888816  
传真:010-89188000  
客服电话:95118  
网址:htp://fund.jd.com  
(107)上海利得基金销售有限公司  
住所:浦东新区上北路977号1幢B8812室  
办公地址:上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼  
法定代表人:廖冰  
联系人:郑秋月  
联系电话:021-80234888-6694  
传真:021-80234888  
客服电话:4008961988  
公司网址:www.lidifund.com  
(108)中证金牛(北京)投资咨询有限公司  
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室  
办公地址:北京市朝阳区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层  
法定代表人:钱昊旻  
联系人:徐英  
电话:010-59336639  
传真:010-59336600  
客服电话:4008-908-988  
(109)上海华夏财富投资管理有限公司  
住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室  
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座10层  
法定代表人:王淮平  
联系人:李秋明  
电话:010-59066632  
传真:010-63136184  
客服电话:400-817-5666  
公司网址:www.amcfortune.com  
(110)武汉市伯嘉基金销售有限公司  
住所:湖北省武汉市汉阳区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层14号

办公地址:湖北省武汉市汉阳区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层14号  
法定代表人:吴捷  
联系人:陆锋  
客户服务电话:4000279899  
公司网址:www.huoyifund.com.cn  
(111)和耕传承基金销售有限公司  
住所:郑州市郑东新区东风南路东1街互联网金融大厦六层  
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层  
法定代表人:李淑慧  
联系人:罗聪  
客户服务电话:0371-85618396  
公司网址:www.hgccpb.com  
(112)戴萌期货有限责任公司  
住所:安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层,6号楼1、2层  
办公地址:安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层,6号楼1、2层  
法定代表人:吴国辉  
联系人:申倩倩  
客户服务电话:4000878707  
公司网址:www.hsqh.net  
(113)北京微动利基金销售有限公司  
住所:北京市石景山区古城西路133号景山财富中心341  
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341  
法定代表人:李长军  
联系人:何鹏  
客户服务电话:400-819-6665  
公司网址:www.buyiforyou.com.cn  
(114)成都华羿恒信基金销售有限公司  
住所:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦南路8号1号楼32楼2号  
办公地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦南路8号1号楼32楼2号  
法定代表人:赵慧  
联系人:徐利  
客户服务电话:400-8010-009  
公司网址:htp://www.huayihengxin.com  
(115)上海挖财基金销售有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01\_02\_03室  
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01\_02\_03室  
法定代表人:冷飞  
联系人:李刚  
客户服务电话:021-50810687  
客服电话:021-50810673  
公司网址:www.wacaijijin.com  
(116)上海大智慧基金销售有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102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单元  
法定代表人:申健  
联系人:宋翔  
联系电话:021-20219988  
客服电话:021-20292031  
网址:https://www.wq.com.cn/  
(117)北京加和基金销售有限公司  
注册地址:北京市西城区德胜大街1号院1号楼4单元1018号一层  
办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号文化创新工场四层404  
法定代表人:徐福耀  
联系人:李奕  
电话:010-68292940  
传真:010-68292964  
客户服务电话:400-800-0030  
公司网址:www.bzfunds.com  
(118)北京晟视天下基金销售有限公司  
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号Q3室  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层&28层  
法定代表人:蒋辉  
联系人:刘慧/徐晓荣  
电话:010-58170906/010-58170976  
传真:010-58100900  
客户服务电话:400-818-8966  
网址:www.shengshiview.com.cn  
(119)北京上信基金销售有限公司  
住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室  
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室  
法定代表人:李悦宸  
联系人:曹庆泽  
客户服务电话:400-066-8586  
公司网址:www.iqisave.com  
(120)北京金盈基金销售有限公司  
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室  
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室  
法定代表人:程刚  
联系人:赵宇凡  
客户服务电话:400-100-3391  
公司网址:htp://www.danyingfund.com/  
(121)天津财富基金销售有限公司  
住所:天津自贸区(中心商务区)迎水道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室  
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层  
法定代表人:李修婷  
联系人:邱玉慧  
客户服务电话:010-59013825  
公司网址:www.tianjicaiwu.com/  
(122)深圳前海厚泽基金销售有限公司  
住所:深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)  
办公地址:广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室  
法定代表人:杨艳华  
联系人:胡静  
客户服务电话:400-128-6800  
公司网址:www.caibao.com  
(123)东方财富证券股份有限公司  
住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼  
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦  
法定代表人:陈宏  
联系人:付志  
电话:021-23586603  
客服电话:95357  
公司网址:htp://www.18.cn  
(124)北京百度百盈基金销售有限公司  
住所:北京市海淀区上地十街10号百度大厦  
办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号科贸科技大厦  
法定代表人:张旭阳  
联系人:杨博超  
电话:010-61954203  
客服电话:90065-4  
公司网址:www.baiyingfund.com  
(二)注册登记机构  
名称:中海基金管理有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层  
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层  
法定代表人:杨皓瑜  
总经理:杨皓瑜  
成立日期:2004年3月18日  
电话:021-38429808  
传真:021-68419328  
联系人:周琳  
(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海锦天城律师事务所  
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
法定代表人:韩朝  
电话:021-31358666  
传真:021-31358600  
联系人:倪悦民、王利民  
(四)审计会计师事务所  
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室  
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室  
执行事务合伙人:毛锐宇  
联系电话:010-58153000  
传真:010-58153000  
联系人:徐皓  
经办会计师:徐皓、陶育化  
4.基金的名称

名称:中海增强收益债券型基金

基金的投资范围

本基金的投资范围限于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。

本基金固定收益类资产主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、可转债、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、银行存款等品种。

本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%,持有的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%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,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、基金的投资理念

本基金的投资理念是基于宏观经济周期趋势性变化,确定利率变动的方向和趋势,据此合理安排资产组合的配置结构,在控制投资风险的前提下获取超过债券市场平均收益水平的投资业绩。此外,本基金还将通过积极的新股申购和个股精选等来增强基金资产的收益。

九、基金的投资策略

(一)资产配置

1.一级资产配置主要取自自上而下的方式。

本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析判断,采取自上而下的分析方法,比较不同证券市场和金融工具的收益及风险特征,动态确定基金资产在固定收益类资产和权益类资产的配置比例。

2.债券投资策略(可转债除外)

(1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。

流动性配置:基于宏观经济趋势性变化,主要基于中长期的资产配置,可通过债、市此预测和利率变动的方向及趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,即资产市场属性,调整债券市场配置的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。

(2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。

在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各期限的收益率进行预测,通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

子弹组合,即,使组合的现金流尽量集中分布;

杠铃组合,即,使组合的现金流尽量呈两极分布;

梯形组合,即,使组合的现金流尽量呈均匀分布。

(3)债券类别配置/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。

本基金根据国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、短期融资券,可通过债、市分离可转债、资产支持证券等品种,以其各自价格体系为定价分析为依据,同时兼顾不同类别品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化,在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券,可分离可转债、资产支持证券等信用债,在信用利差水平较低时持有国债,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

个券选择:基于各个投资品种具体情况,自上而下的资产配置。

个券选择应遵循如下原则:

相对价值原则:同等风险下收益率较高的品种,同等收益率风险较低的品种。

流动性原则:同等收益下,选择流动性较好的品种。

(4)其它交易策略

a.短期资金运用:在短期资金运用上,如果预期回购利率较高,选择逆回购融出资金。

b.公司债跨市场套利:公司债将在银行间市场和交易所市场同时相同,根据以往的经验,两个市场的品种将出现差价套利的机会。本基金将利用两个市场同时公司债券交易价格的差异,锁定其中收益进行跨市场套利,增加基金资产收益。

3.可转换债券投资策略

(1)可转换债券投资策略:本基金将根据其相关性,其投资风险和收益介于债券和股票之间,在进行可转换债券筛选时,本基金将首先对可转换债券自身的内在价值进行评估(如果票面利息、利息补偿及无条件回售价格)、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究;并结合可转换债券的基础债券的基本面进行分析,形成对基础股票的价值评估;最后将可转换债券自身的基本面分析和其基础债券的基本面分析结合在一起以确定投资的可转换债券品种。

4.股票投资策略

(1)本基金通过股票策略,将充分借助公司研究平台和股票估值体系,深入研究首次发行(IPO)募资及增发新股的上市公司基本面,在有效控制风险的前提下制定相应的新股申购策略。通过对新股申购获得的股票,根据其实际投资价值确定持有或卖出。

(2)股票二级市场投资策略

本基金可适当参与股票二级市场投资,增强基金资产收益。本基金股票二级市场投资采用红利精选投资策略,通过运用分红模型和红利潜力模型,精选出现股息率高、分红潜力强并具有成长性的优质上市公司,结合投资团队的综合判断,构造股票投资组合。

5.权证投资策略

本基金将在允许的范围内采用权证投资,权证投资策略主要从价值投资的角度出发,将权证作为套利避险的工具,使用包括套利投资策略、风险控制策略和股票替代策略进行权证投资,由于权证市场的高波动性,本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险,寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃权证进行流动性配置。

十、基金的投资限制

1.本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(2)本基金管理人管理的且由本基金持有同一发行人发行的证券,不超过该证券的百分之十;本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(3)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(4)本基金在全国银行间买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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,不得超过该基金资产净值的10%;

(8)本基金投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券,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;

(9)本基金资产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(10)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(11)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(12)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资比例和投资策略的约定;

(13)相关法律法规及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制,本基金在履行适当程序后,基金不受上述限制。

有关投资、基金托管、基金费用的投资监督与检查自基金合同生效之日起开始。

除上述第(10)、(11)项另有规定外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人以外的因素导致投资不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2.为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券;

(2)向他人提供担保或提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但法律法规和中国证监会另有规定的除外。

(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。

(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7)从事内幕交易、操纵证券价格及不正当关联交易;

(8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人将在履行适当程序后不受上述规定的限制。

十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

中国债券总指数收益率×90%+上证红利指数收益率×10%。

中国债券总指数由中证指数有限公司编制,自2009年1月1日编制发布,样本涵盖交易所、银行间市场记账式国债、记账式国债、金融债、上证红利指数于2006年1月4日发布,挑选在上交所上市的市场股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的50只股票为样本,以及上海证券交易所高红利股票的整体状况和走势。

本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%,持有的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%,因此,“中国债券总指数收益率×90%+上证红利指数收益率×10%”是衡量本基金投资业绩的合理基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金债券型基金投资策略,为证券投资基金中的较低风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

十三、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十四、基金的风险收益特征

本基金债券型基金投资策略,为证券投资基金中的较低风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

十五、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十六、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十七、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十八、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十九、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十一、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十二、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十三、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十四、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十五、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十六、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十七、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十八、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

二十九、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

三十、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

三十一、基金的投资组合报告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告中披露投资组合报告,投资组合报告在年度报告中,经基金管理人及基金托管人协商一致后,本基金可以在报