

(上接A21版)

(3) 杠杆投资策略
本基金将按资产组合进行综合分析的基础上,比较债券收益率、存款利率和融资成本,判断利率曲线,通过投资组合操作来加大收益。

(4) 可转换债券投资策略
可转换债券兼具股权和债权,债券价值和内嵌期权价值。本基金管理人将可转换债券的价值进行估计,选取具有较高投资价值的可转换债券进行投资。此外,本基金还将根据相关交易所的临时公告、定期定结果、积极参与可转债申购与股票。

3. 股票投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下适度参与股票资产投资。本基金股票资产的主要来源为“自下而上”的证券策略,精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业竞争力、公司资源禀赋、治理、对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司治理结构和管理模式等方面进行定量和定性分析,在严格控制风险的基础上进行股票投资。

在法律法规和基金合同允许的情况下,本基金将投资股票期权、股指期货、期货、场外衍生品等金融产品,其投资原则及比例按照法律法规及监管机构的相关规定执行。控制下跌风险,实现保值和锁定收益。权证为本基金辅助性投资品种,投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

(二) 开放运作期间
开放运作期间,本基金为为了方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将增加投资于股票品种的投资比例,以降低基金净值波动。

(四) 申购和赎回安排
同时申购中国人民银行公告的三年期银行定期存款利率(税后)+1.75%
上述“三年期银行定期存款利率”是指中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”和“三年期银行定期存款基准利率”,指在中国人民银行网站已三年期银行定期存款利率每日计算得出的存款利率,按照中国人民银行调整利率时,自调整生效之日起,调整相应的利率进行计算。

上述指标与本基金净值反映本基金“在控制基金资产净值波动的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值”的投资目标,但并不代表基金本金的投资风险降低,并且“三年期银行定期存款利率”也容易受到市场变化影响。
如果有关法律法规发生变化或者有更有效的,更能公平地保护投资者的,则更加适用于本基金的业绩比较基准。基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,调整相应的业绩比较基准,但应取得基金托管人、中国证监会备案,并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

(五) 风险提示
本基金为混合型基金,基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

(六) 基金资产净值与限制

1. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1) 承销证券;
(2) 向他人贷款或提供担保;
(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
(6) 从事内幕交易、操纵市场交易及证券欺诈等违反法律法规及中国证监会有关禁止性规定的行为;
(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制,则本基金投资不再受相关限制。

2. 投资组合比例

(1) 本基金的投资组合应遵循以下限制:
(a) 本基金投资于债券资产不低于基金资产净值的70%;对权益类资产的投资不超过基金资产净值的30%;以上两比例限制在开放运作期间开放后15个自然日至开放运作结束前15个自然日不受上述比例限制;

(b) 开放运作期间,现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;
(c) 本基金持有一家公司发行的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(d) 本基金管理人管理的全部基金有一切投资于证券,不超过该证券的10%;
(e) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的2%;
(f) 本基金管理人管理的全部基金有一切权证,不得超过该证券的 10%;
(g) 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%;
(h) 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,不得超过基金资产净值10%;
(i) 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%;
(j) 本基金持有的同一(同一同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(k) 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%;
(l) 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%;

(m) 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%;

(n) 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%;

(o) 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%;

(p) 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%;

(q) 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%;

(r) 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%;

(s) 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%;

(t) 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%;

(u) 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%;

(v) 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%;

(w) 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%;

(x) 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%;

(y) 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%;

(z) 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%;

(aa) 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%;

(ab) 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%;

(ac) 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%;

(ad) 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%;

(ae) 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%;

(af) 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%;

(ag) 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%;

(ah) 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%;

(ai) 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%;

(aj) 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%;

(ak) 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%;

(al) 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%;

(am) 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%;

(an) 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%;

(ao) 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%;

(ap) 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%;

(aq) 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%;

(ar) 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%;

(as) 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%;

(at) 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%;

(au) 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%;

(av) 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%;

(aw) 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%;

(ax) 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%;

(ay) 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%;

(az) 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%;

(ba) 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%;

(bb) 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%;

(bc) 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%;

(bd) 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%;

(be) 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%;

(bf) 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%;

(bg) 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%;

(bh) 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%;

(bi) 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%;

(bj) 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%;

(bk) 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%;

(bl) 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%;

(bm) 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%;

(bn) 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%;

(bo) 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%;

(bp) 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%;

(bq) 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%;

(br) 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%;

(bs) 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%;

(bt) 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%;

(bu) 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%;

(bv) 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%;

(bw) 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%;

(bx) 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%;

(by) 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%;

(bz) 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%;

(ca) 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%;

(cb) 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%;

(cc) 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%;

(cd) 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%;

(ce) 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%;

(cf) 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%;

(cg) 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%;

(ch) 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%;

(ci) 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%;

(cj) 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%;

(ck) 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%;

(cl) 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%;

(cm) 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%;

(cn) 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%;

(co) 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%;

(cp) 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%;

(cq) 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%;

(cr) 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%;

(cs) 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%;

(ct) 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%;

(cu) 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%;

(cv) 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%;

(cw) 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%;

(cx) 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%;

(cy) 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%;

(cz) 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%;

(da) 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%;

(db) 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%;

(dc) 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%;

(dd) 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%;

(de) 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%;

(df) 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%;

(dg) 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%;

(dh) 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%;

(di) 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%;

(dj) 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%;

(dk) 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%;

(dl) 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%;

(dm) 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%;

(dn) 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%;

(1) 基金合同终止事由;

(2) 基金合同终止事由;

(3) 基金合同终止事由;

(4) 基金合同终止事由;

(5) 基金合同终止事由;

(6) 基金合同终止事由;

(7) 基金合同终止事由;

(8) 基金合同终止事由;

(9) 基金合同终止事由;

(10) 基金合同终止事由;

(11) 基金合同终止事由;

(12) 基金合同终止事由;

(13) 基金合同终止事由;

(14) 基金合同终止事由;

(15) 基金合同终止事由;

(16) 基金合同终止事由;

(17) 基金合同终止事由;

(18) 基金合同终止事由;

(19) 基金合同终止事由;

(20) 基金合同终止事由;

(21) 基金合同终止事由;

(22) 基金合同终止事由;

(23) 基金合同终止事由;

(24) 基金合同终止事由;

(25) 基金合同终止事由;

(26) 基金合同终止事由;

(27) 基金合同终止事由;

(28) 基金合同终止事由;

(29) 基金合同终止事由;

(30) 基金合同终止事由;

(31) 基金合同终止事由;

(32) 基金合同终止事由;

(33) 基金合同终止事由;

(34) 基金合同终止事由;

(35) 基金合同终止事由;

(36) 基金合同终止事由;

(37) 基金合同终止事由;

(38) 基金合同终止事由;

(39) 基金合同终止事由;

(40) 基金合同终止事由;

(41) 基金合同终止事由;

(42) 基金合同终止事由;

(43) 基金合同终止事由;

(44) 基金合同终止事由;

(45) 基金合同终止事由;

(46) 基金合同终止事由;

(47) 基金合同终止事由;

(48) 基金合同终止事由;

(49) 基金合同终止事由;

(50) 基金合同终止事由;

(51) 基金合同终止事由;

(52) 基金合同终止事由;

(53) 基金合同终止事由;

(54) 基金合同终止事由;

(55) 基金合同终止事由;

(56) 基金合同终止事由;

(57) 基金合同终止事由;

(58) 基金合同终止事由;

(59) 基金合同终止事由;

(60) 基金合同终止事由;

(61) 基金合同终止事由;

(62) 基金合同终止事由;

(63) 基金合同终止事由;

(64) 基金合同终止事由;

(65) 基金合同终止事由;

(66) 基金合同终止事由;

(67) 基金合同终止事由;

(68) 基金合同终止事由;

(69) 基金合同终止事由;

(70) 基金合同终止事由;

(71) 基金合同终止事由;

(72) 基金合同终止事由;

(73) 基金合同终止事由;

(74) 基金合同终止事由;

(75) 基金合同终止事由;

(76) 基金合同终止事由;

(77) 基金合同终止事由;

(78) 基金合同终止事由;

(79) 基金合同终止事由;

(80) 基金合同终止事由;

(81) 基金合同终止事由;

(82) 基金合同终止事由;

(83) 基金合同终止事由;

(84) 基金合同终止事由;

(85) 基金合同终止事由;