

信息披露 Disclosure

(上接A22版)

本基金在实现权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,谨慎地进行投资,以追求较为稳定的收益。

6. 支持待售的证券的投票

本基金的投资支持表决权将综合运用久期管理、收益曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(四) 行业债投资基准

本基金业绩比较基准:60%×中证800指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

如果今后法律法规发生变化,或者更有权的,更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市埸上出现更广泛用于本基金的业绩基准的指数时,基金管理人可以根据本基金的投资范围及投资策略,决定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告,并在新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

(五) 风险收益特征

本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

7. 投资组合限制

1. 组合限制

(1) 股票投资比例为基金资产的0%-95%;

(2) 每个交易日股票资产扣除股指期货合约的预缴保证金后的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年内的政府债券;

(3) 本基金持有的单一公司发行的债券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金管理人持有的全部基金资产不得超过该基金资产的10%;

(5) 本基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(6) 本基金在任何交易日买入权证的金额,不得超出上个交易日基金资产净值的0.5%;

(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,不得超过基金资产净值的10%;

(8) 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%;

(9) 本基金持有的同一类别的资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(10) 本基金持有的同一类别的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,不得超过其各资产支持证券规模的10%;

(12) 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评级期间,如果信用等级下降,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) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过发行公司首次公开发行股票的数量;

(14) 基金财产在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%;

(15) 本基金在任何交易日终,持有的买入股票的公允价值不得超过基金资产净值的10%,其中买入股票的公允价值与买入股票的成交金额之比不得超过基金资产净值的5%,其中买入股票的公允价值与买入股票的成交金额之比不得超过该基金资产的5%;

(16) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

本基金在任何交易日终,持有的买入股票的公允价值与买入股票的成交金额之比不得超过基金资产净值的5%;

(17) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

因回购或期货市场波动,证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素导致其投资比例不符合上述规定时,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,法律法规或监管部门另有规定的除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

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,不得超过其各资产支持证券规模的10%;

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