

(上接B051版)

20%;

(7) 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%;

(8) 本基金应投资于信用级别评级为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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(10) 本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(11) 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%;

(12) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(13) 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%;

(14) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(15) 本基金的基金总资产净值不得超过基金资产净值的140%;

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

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约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2. 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) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 购买实物基金份额,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、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金托管人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

(五) 调整估值对象、估值方法

增加了该基金相应权益资产的估值对象、估值方法,并重新进行了表述,在基金合同、托管协议、招募说明书中的估值对象、估值方法的内容修改如下:

原文为:

二、估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易证券上市实行净价交易的证券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。

如最近交易日后经济环境发生重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2) 交易证券上市未实行净价交易的证券按收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(3) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(4) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(5) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(6) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(7) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(8) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(9) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(10) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(11) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(12) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(13) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(14) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(15) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(16) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(17) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(18) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(19) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(20) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(21) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(22) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(23) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(24) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(25) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(26) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(27) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(28) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(29) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(30) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(31) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(32) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(33) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(34) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(35) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(36) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(37) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(38) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(39) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(40) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(41) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(42) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(43) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(44) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(45) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

如最近交易日未发生净价交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化,按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;

(46) 交易证券上市未实行净价交易的证券按估值日的收盘价减去债券收盘价中所含的应计利息后的余额估值;