

(上接B033版)

4、投资产品投资策略

本基金通过权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘的价差策略，双向对冲策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

(二) 投资决策依据及程序

1、投资决策依据

(1)有关法律、法规、基金合同等条文的相关规定；

(2)经济运行态势和证券市场走势；

(3)投资对象的风险收益配比。

2、投资决策程序

(1)投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划、投资原则及其他重大事项；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作；

(2)基金经理构建、调整投资组合，并在此过程中充分考虑以下因素：每日基金申购和赎回的现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究团队的资源投向建议、绩效与风险评估小组的建议等；

(3)交易执行相关部门根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体品种的交易指令；

(4)风险绩效相关部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关数据评估报告；

(5)监察核保相关部门对投资对象进行监控；

(6)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化实际需要调整上述投资程序，并予以公告。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%

沪深300指数选择样本股的行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是目前市场上较有影响力的股票投资基准比较基准。中证综合债指数的选择券的信用级别全覆盖，期限构成宽泛，适于做基金债券资产的业绩比较基准。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能更真实反映本基金的风格收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或因指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或者有更权威的更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场上出现更适用与本基金的业绩基准的股票指数时，基金管理人可与托管人协商一致后，可以将本基金的业绩基准变更为新推出的指数，并在公告中更新。

十、基金的风险收益特征

本基金为采用高仓位运作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金及普通股票型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十二、报告期末基金资产组合情况

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十三、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十四、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十五、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十六、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十七、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十八、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

十九、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十一、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十二、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十三、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十四、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十五、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十六、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十七、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十八、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

二十九、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

三十、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

三十一、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

三十二、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

三十三、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

三十四、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

三十五、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至2015年3月31日（未经审计）。

三十六、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

本基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年4月16日复核了本报表中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所列财务数据截至20