信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)(原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金转型)

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告日期:2015年6月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银稳定增利分级债券
场内简称	信达增利
基金主代码	166105
交易代码	166105
基金运作方式	契约型,本基金基金合同生效之日起3年内,信达利A日基金合同生效之日起每满6个月开放一次,信达利B长期封闭运作,上市交易;本基金基金合同生效后3年期满时,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2012年6月7日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	108,407,025.04份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012-7-16
下属分级基金的基金简称	信达澳银稳定增利债券A 信达澳银稳定增利债券B
下属分级基金的场内简称	信达利A 信达利B
下属分级基金的交易代码	166106 150082
报告期末下属分级基金的份额总额	17,166,526.96份 91,240,498.48份

信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)

基金简称	信达澳银稳定增利分级债券(LOF)
场内简称	信达增利
基金主代码	166105
交易代码	166105
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015年6月17日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,940,733.92份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-6-4

2.2 基金产品说明

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

投资目标	在严格控制风险的前提下,主要通过深入分析固定收益类金融工具的公允价值并进行投资,追求基金资产的长期稳定收益。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合的方法,对债券的公允价值进行深入分析,精选价值被低估的债券,在动态调整组合久期和债券品种配置的基础上,有效构建投资组合,优化组合收益。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金(LOF)

投资目标	在严格控制风险的前提下,主要通过深入分析固定收益类金融工具的公允价值并进行投资,追求基金资产的长期稳定收益。	
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合的方法,对债券的公允价值进行深入分析,精选价值被低估的债券,在动态调整组合久期和债券品种配置的基础上,有效构建投资组合,优化组合收益。	
业绩比较基准	中国债券总指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	本基金基金合同生效之日起3年内,信达利A为低风险、较高收益的基金品种。	本基金基金合同生效之日起3年内,信达利B为较高风险、较高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	魏晓	田青
	联系电话	0755-83176660	010-67595096
	电子邮箱	dacis@xinyinbank.com	tianqing@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	010-67595096
传真		0755-83196151	010-66275853
法定代表人		于建伟	王洪章

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦24层

2.5 其他有关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要财务数据和财务指标

3.1.1 期间收益和指标	报告期(2015年1月1日-2015年6月30日)		
	原信达澳银稳定增利分级债券(2015年1月1日-2015年5月6日)	信达澳银稳定增利债券(LOF)(2015年6月7日-2015年6月30日)	
本期已实现收益	-738,134.01	1,937,590.87	
本期利润	-1,081,596.45	1,862,998.39	
加权平均基金份额本期利润	-0.0100	0.0624	
本期基金份额净值增长率	-0.88%	-0.30%	
3.1.2 期末数据和指标	期末(2015年5月6日)	报告期末(2015年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0035	0.0246	
期末基金资产净值	118,591,447.78	50,800,621.58	
期末基金份额净值	1.004	0.997	

注:1.本基金分级稳定增利分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")分为稳定增利债券(以下简称"稳定增利")、信达澳银稳定增利B(以下简称"信达利B")和信达澳银稳定增利A(以下简称"信达利A")三个子基金。稳定增利、信达利B和信达利A三个子基金的份额比例为1:1:1。

2.本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上期末公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润期末资产净值扣除期末份额面值和期末可供分配已实现收益加上期末公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月(2015.4.7-2015.5.6)	1.51%	0.31%	1.03%	0.17%	0.48%	0.14%
过去三个月(2015.2.7-2015.5.6)	3.71%	0.45%	0.32%	0.15%	3.39%	0.30%
过去六个月(2014.11.7-2015.5.6)	9.94%	0.88%	2.16%	0.18%	7.68%	0.70%
过去一年(2014.5.7-2015.5.6)	15.95%	0.62%	9.03%	0.16%	6.92%	0.46%
过去三年(2012.5.7-2015.5.6)	14.62%	0.44%	13.06%	0.12%	1.56%	0.32%
自基金合同生效起至转型前一日(2012.5.7-2015.5.6)	14.62%	0.44%	13.06%	0.12%	1.56%	0.32%

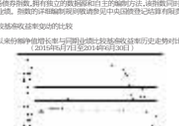
注:本基金的业绩比较基准=中国债券总指数

"信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金"自2012年6月7日成立以来,本基金的投资组合主要投向国内证券市场的债券资产,并有效控制组合久期,以期获取稳定的收益。本期内,本基金的投资组合主要投向国内证券市场的债券资产,并有效控制组合久期,以期获取稳定的收益。

http://www.chinabondcn.com

3.2.2 基金转型以来基金净值累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金(LOF)



注:1.本基金基金合同于2012年6月7日生效。

2.本基金的投资组合比例为:固定收益类资产占可转债券资产的80%,持有股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资于在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

3.2.3 信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.68%	1.45%	0.30%	0.08%	-4.98%	1.37%
自转型日起至本报告期末(2015.5.7-2015.6.30)	-0.30%	1.15%	0.79%	0.10%	-1.09%	1.05%

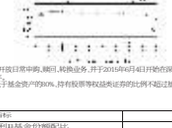
注:本基金的业绩比较基准=中国债券总指数

"信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金"自2015年5月7日成立以来,本基金的投资组合主要投向国内证券市场的债券资产,并有效控制组合久期,以期获取稳定的收益。本期内,本基金的投资组合主要投向国内证券市场的债券资产,并有效控制组合久期,以期获取稳定的收益。

http://www.chinabondcn.com

3.2.3 基金转型以来基金净值累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金(LOF)



注:1.本基金基金合同于2012年6月7日生效。

2.本基金的投资组合比例为:固定收益类资产占可转债券资产的80%,持有股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资于在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

3.4 管理人报告

3.4.1 基金管理人及基金经理情况

3.4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

基金管理人信达澳银基金管理有限公司(以下简称"公司")成立于2006年8月8日,由中国信达资产管理股份有限公司(原中国信达资产管理公司)和德国联合投资有限责任公司德意志银行集团(Deutsche Asset & Wealth Management)共同发起,股权结构为:中国信达资产管理股份有限公司持股70%,德意志银行集团持股30%。公司注册资本为人民币1亿元,公司管理资产规模位于国内基金管理公司第一梯队。截至2015年6月30日,公司管理的开放式基金共计20只,其中:股票型基金2只,债券型基金18只,货币市场基金1只,QDII基金1只,管理资产规模位于国内基金管理公司第一梯队。

公司建立了独立的投资决策委员会,由公司董事、总经理组成,负责公司投资政策的制定,并对公司投资决策的执行情况进行监督。董事会以投资决策委员会的决议为依据,对总经理的投资决策执行情况进行监督。公司设立了投资管理部、固定收益部、权益投资部、财务分析部、投资管理部等部门,内部分工明确,职责明确。

公司建立了完善的投资决策、风控管理、市场研究等一系列制度,并在内部设立独立的风控部门,对公司的投资决策、风控管理、基金运作、产品设计、营销等业务进行全面的监控和管理。公司设立了产品设计委员会,对新产品的设计、开发、营销等进行全面的决策和管理。

截至2014年12月31日,公司共管理一个开放式基金,信达澳银现代优势股票基金;信达澳银稳定增利债券型证券投资基金;信达澳银行业优势股票基金;信达澳银新经济股票型证券投资基金;信达澳银中证100指数证券投资基金;信达澳银中证500指数证券投资基金;信达澳银新兴产业股票型证券投资基金;信达澳银领先增长股票型证券投资基金;信达澳银环保主题股票型证券投资基金;信达澳银精选平衡混合型证券投资基金;信达澳银产业升级股票型证券投资基金;信达澳银中小盘股票型证券投资基金;信达澳银内需增长股票型证券投资基金;信达澳银新能源股票型证券投资基金;信达澳银消费主题股票型证券投资基金;信达澳银中证内地低碳经济指数证券投资基金(LOF)。

3.4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学峰	本基金的基金经理,稳定价值债券基金和慧银家投市场基金基金经理,固定收益总监	2012-5-7	-	11年	中央财经大学金融学硕士。历任金元证券股份有限公司研究员,国泰君安证券股份有限公司固定收益总部总经理,国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部总经理,信达证券股份有限公司,历任投资研究部下属证收益部总经理,固定收益部总经理,现任公司固定收益部总监。2012年5月29日起至今,信达澳银稳定增利债券基金;2012年6月7日起至今,信达澳银稳定增利分级债券基金;2012年6月14日起至今,信达澳银慧银家投市场基金基金经理;2013年6月14日起至今,信达澳银慧银家投市场基金基金经理(2014年6月26日起至今)。

注:1.基金经理的任职日期、离任日期为根据公司内定决策委员会决议日期做出的决定日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的规定。

3.3.1 信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

4.管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规,监管部门的有关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.3 管理人投资决策执行情况

本报告期内,公司基于"投资决策及交易执行相分离"的原则,建立投资决策委员会、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门共同参与的投资决策体系,在投资决策委员会的指导下,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门分别为投资决策委员会主席、基金经理提供投资决策建议、投资决策委员会主席、基金经理根据各部门的建议,结合宏观经济、证券市场、行业、公司、个股等多方面因素,对公司投资组合的久期、资产配置、个券选择、组合风险控制等方面进行决策,并形成投资决策委员会决议,由基金经理执行决策委员会决议,并对投资决策委员会决议的执行情况进行监督。交易部根据投资决策委员会决议、基金经理的投资指令,在公司内部交易系统中,对投资组合的证券品种、交易时机、交易数量、交易价格等要素进行管理,并对交易执行情况进行监督。研究部、风控部、监察稽核部等部门分别从宏观经济、证券市场、行业、公司、个股等方面进行研究,并对投资决策委员会决议的执行情况进行监督。

3.4.1.4 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况

公司建立了"投资决策委员会决议执行监控系统"、"投资组合风险监控系统"、"投资组合日常监控系统"、"投资决策委员会决议执行情况监督表"、"投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门监督情况表"等一系列内部控制系统,对投资决策委员会决议的执行情况、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况进行全面、及时、有效的监控。

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.5 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对公司投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.6 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.7 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.8 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.9 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.10 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.11 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.12 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.13 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.14 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.15 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.16 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.17 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.18 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.19 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.20 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.21 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.22 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.23 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.24 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.25 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.26 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.27 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告期内,公司投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门对投资决策委员会决议的执行、投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况表明:公司投资决策委员会决议的执行情况良好,投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况良好,未发现有违反法律法规、监管部门的有关规定、损害基金持有人利益的行为。

3.4.1.28 管理人对报告期内基金投资组合的日常监控、投资比例限制、投资禁止行为的监控、投资决策委员会决议的执行情况、投资决策委员会主席、基金经理、交易部、研究部、风控部、监察稽核部等部门的监督情况的说明

报告