

## 【上海A38】

### (二) 申购赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

基金管理人可在开放日办理基金份额的申购,在每个运作期到期日办理基金份额赎回。每个运作期到期日前,基金份额持有人不能提出赎回申请,每个运作期到期日,基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人未在运作期到期日之前申请赎回,则该基金份额到期日下一工作日将该基金份额转入下一个运作期。基金份额申购、赎回业务的具体办理时间以上海证券交易所、深圳证券交易所的证券交易日的交易时间为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同中的规定可暂停申购、赎回除外。

基金合同生效后,在出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人视情况对上述开放日及开放时间进行相应的调整,但应事先在指定媒介(信息披露办法)的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2. 申购赎回的开放日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过1个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金合同每个运作期到期日,基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。基金管理人自基金合同生效日后的首个运作期到期日开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或转换申请。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购或转入申请、赎回或转换申请,基金份额持有人的该申请或转换申请视为下一个开放日提出的有效申购或转换申请。基金份额持有人可在基金合同约定之外的日期和时间提出赎回或转换申请,基金管理人有权拒绝或确认失败,法律法规另有规定或销售机构支持特殊申购的情况下,本基金可以根据实际情况对上述业务办理时间进行适当调整。

#### (三) 申购赎回的价格

- “确定价”原则,即本基金的申购、赎回的价格为每份基金份额人民币1.00元;
- “金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申购,赎回以份额申购;
- 当日的申购与赎回申请以基金管理人规定的时间以内截割;
- 基金份额持有人申购和赎回基金份额,如该基金份额持有人的持有多个赎回份额的,登记机构按“先进先出”的原则,对该基金基金份额持有人在该销售机构持有的基金份额进行处理;
- 基金份额持有人赎回其持有的本基金基金份额,基金管理人应在计算该基金份额的赎回待支付款项时,向该基金份额持有人支付赎回款项。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述申购赎回调整。基金管理人必须在开始调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (四) 申购赎回的费用

- 申购赎回的费用方式
- 投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人申购基金份额时,必须全额支付申购款项,投资人支付申购款项,申购申请即为成立。登记机构确认基金份额时,申购生效。基金份额持有人支付赎回申请,赎回成立。登记机构确认赎回时,赎回生效。投资人赎回成功后,基金管理人将在T+7(指该工作日)支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合同中的相关条款处理。

#### 3. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束当日受理有效申购和赎回申请当天为申购或赎回申请日(登记日),在该工作日内,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)及时到成功网点柜台或销售机构网点以其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请,申购与赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购的确认情况,投资者应及时查询。

#### (五) 申购与赎回的限制

1.投资人通过其销售机构或基金管理人电子直销平台申购本基金A类份额时,单笔申购最低金额为人民币1000元,通过基金管理人直销中心柜台申购本基金A类份额时,首次申购最低金额为人民币10000元,追加申购最低金额为人民币1000元。通过其他销售机构、基金管理人电子直销平台或基金管理人直销中心柜台申购本基金A类份额时,首次申购最低金额为人民币10000元,追加申购最低金额为人民币1000元。投资人申购基金份额,单笔申购最低金额为人民币100元。投资人申购当日的基金份额为基金份额,申购最低金额的限制,中国证监会另有规定的除外,单个投资人累计持有基金份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

对于到期日的基金份额,投资人可将其全部或部分基金份额赎回,如遇巨额赎回等情况导致延期赎回时,赎回申请和赎回款项支付办法按基金合同有关巨额赎回或连续巨额赎回的条款处理。

3.基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### (六) 申购费用和赎回费用

本基金不收取申购费用和赎回费用。

#### (七) 申购赎回的价格和计算

本基金的申购、赎回价格为每份基金份额净值1.00元。

#### 1. 申购份额的计算

申购份额=申购金额/1.00元

申购的份额计算结果四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者投资50,000元申购本基金,则可得到的申购份额为:

申购:50,000/1.00=50,000

即:投资者投资50,000元申购本基金,则可得到50,000份基金份额的基金份额。

#### 2. 赎回金额的计算

赎回金额=赎回份额×基金份额净值,对应的待支付权益

投资者可通过在基金份额赎回申请日赎回基金份额获得当期运作期的基金份额,本基金投资在运作期到期日申请赎回50000份本基金A类份额,对应的待支付权益为300元,则可得到的赎回金额为:

赎回金额=50000×1.00+300=50300元

即:投资者申请赎回30000份本基金A类份额,则可得到50300元赎回金额。赎回金额单位为元。

赎回金额计算结果均按四舍五入,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### (八) 巨额赎回的认定及处理程序

1.发生下列情况时,基金管理人可暂停或暂停接受投资人的申购申请:

- 因不可抗力导致基金无法支付赎回款项;
- 发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请或暂停支付赎回款项;
- 证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4.接受资产或某些事项可能会影响赎回款项的基金份额持有人利益时,本基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或可能对基金业绩产生负面影响,或根据其现有基金份额持有人的情形。

6.基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术保障等常情情况下导致基金销售系统或基金登记系统或基金支付系统无法正常运行。

7.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述1、2、3、5、6、7项情形时,基金管理人应当立即暂停受理投资人的申购申请,并及时公告,同时基金管理人有权按照有关规定在指定媒介上发布暂停申购公告。如投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 9. 巨额赎回或连续巨额赎回的认定及处理程序

发生下列情况时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

- 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项;
- 发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项;
- 证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4.连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,导致基金管理人无法支付现金款项。

5.基金管理人继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,可暂停接受投资人的赎回申请。

6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,一旦基金管理人认为接受或暂停接受基金份额持有人的赎回申请或暂停接受基金份额持有人的赎回申请符合基金合同约定,已确认赎回申请,基金管理人应在当日做出书面公告,已确认赎回申请,基金管理人应足额支付,如暂时不能足额支付,应由未支付部分赎回申请单个账户赎回申请占总的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并在后续开放日予以支付。若出现上述三种情形时,按基金合同的相关条款处理。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### (十) 巨额赎回的认定及处理方式

1.巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换转出中赎回份额总数扣除申购申请份额总数及基金转换转入中申购份额总数)的余额超过前一开放日基金总份额的10%,即认为发生了巨额赎回。

#### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

#### (1) 全额赎回:当基金管理人有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回:当基金管理人支付投资人的赎回申请有困难或因为投资人的赎回申请而进行的资产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人可在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下,可对其余赎回申请进行延期办理。对于当日未赎回部分,应当按单个赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日,而无需重新提交基金份额的下一运作期到期日,上下两期连续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分自动选择延期赎回。

(3) 暂停赎回:连续2日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

#### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者销售机构书面通知的其他方式在3个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登公告。

#### (十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1.发生上述暂停申购或赎回情形时,基金管理人应当立即向中国证监会备案,并在规定期限内刊登暂停申购或赎回的公告,基金管理人应当立即向中国证监会备案,并在规定期限内刊登暂停申购或赎回的公告,基金管理人应当立即向中国证监会备案,并在规定期限内刊登暂停申购或赎回的公告,基金管理人应当立即向中国证监会备案,并在规定期限内刊登暂停申购或赎回的公告。

2.基金管理人可以根据暂停申购或赎回的公告,依照《信息披露办法》的有关规定,自即日起在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。

#### (十二) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金份额持有人依法继承、捐赠或强制执行等行为而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承,捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给合法的基金会或社会团体,司法强制执行是指司法机构依据生效法律文书强制持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。非交易过户行为必须具备基金份额领取划转的相关资料,对于符合基金的非交易过户申请,基金登记机构经审核后,有权根据基金合同规定的标准收取转托管费。

#### (十三) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以固定开办一次转换,转换规则则基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十四) 基金资产的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易所或其他方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### (十五) 基金的转托管

基金份额持有人可以将其持有的基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### (十六) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### (十七) 基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及司法机关和司法机关依法冻结或解冻基金份额的操作。

#### (十八) 基金上市交易

在未来系统条件允许的情况下,本基金管理人可与相关证券交易所上市交易规则相符合的基础上上市交易事宜。具体上市交易安排由基金管理人届时提前发布公告,并告知基金托管人与相关机构。

#### (一) 投资目标

本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。

#### (二) 投资范围

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,中期票据,期限在一年以内(含一年)的债券回购,国债、证券公司支持证券、中期票据,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中长期银行间债,短期融资券,及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

(三) 投资策略

本基金将采用积极管理的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在180天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。

#### 1. 类属资产配置策略

本基金在定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力的基础上,通过比较合理预期不同类属债券类资产的风险与收益率变化,确定动态地调整资产配置的比例,并综合考虑债券资产的市场容量,确定资产配置。

(四) 银行定期存款及大额存单投资策略

运作初期,本基金在向交易对手银行进行询价的基础上,选取利率报价较高的几家银行进行存款投资,分散投放存款,降低交易对手风险。

(五) 短期融资券投资策略

本基金对于市场公开发行的所有短期融资券,中期票据等信用债券采取自上而下与自上而下相结合的投资策略。根据内外部市场环境对可选债券品种进行筛选过滤,通过自上而下的利率观察及宏观经济、国家产业政策及行业发展状况和趋势、监管环境、公司资质、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同评级为投资标的,采用数量化方法对主体发行债券进行打打和筛选,只有内部评级为投资级的信用类债券方可纳入备选品种池,优选投资选择。根据各短期信用债的短期收益率、剩余期限与运作周期的匹配程度,挑选适当的短期债券进行配置。

信用债收益率是在基准利率基础上加上反映信用风险溢价后的信用利差。基准利率主要受宏观经济政策环境的影响,信用利差收益率主要受该信用债信用水平的影响。本基金采用信用评级体系以及该信用债信用评级变化的影响。因此,信用债的投资策略可分为基于信用评级曲线变化的投资策略、基于信用评级债券信用变化的策略。

#### (六) 债券回购投资策略

首先,基于对宏观经济走势的判断,确定回购期限的选择。在符合进行杠杆操作时,若判断资金面趋于宽松,则在运作初期进行短期回购利率操作;反之,则进行长期回购操作,锁定资金成本。若判断回购配置有反向回购时,则在判断资金面趋于宽松的情况下,优先进行长期回购操作;反之,则进行短期回购操作。其次,本基金在运作期间,根据资金头寸,安排非预期回购的期限操作。

#### (七) 资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对证券平均久期和收益率曲线移动的影响,同时密切跟踪资产池质量,充分评估主观能动性,参与结构化设计,在严格控制风险和合理预期收益的前提下,优先进行市场化流通性投资,选择风险调整后收益较高的品种进行配置。

#### (四) 投资决策流程、机制和程序

##### 1. 投资决策依据

- 国家有关法律、法规和基金合同有关规定;
- 国内外宏观经济形势及对中国经济发展的影响;
- 企业信用评级;
- 国家货币政策及证券市场政策;
- 商业银行的信贷政策。

##### 2. 投资决策机制

本基金实行投资决策委员会制,强调团队合作,充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资研究决策团队,设立了投资研究部,策略分析师,固定收益分析师,数量分析师和基金运营,充分发挥主观能动性,参与投资研究团队的整体工作,群策群力,为基金份额持有人争取中长期稳定的较高投资回报。

##### 3. 投资决策程序

本基金具体的投资决策机制和流程为:

- 本基金分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向,提交投资策略;
- 固定收益策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告;
- 信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级调整;
- 数量分析师对衍生品金融创新产品进行分析并研;
- 在分析研究报告的基础上,基金经理提出月度投资组合计划并提交投资决策委员会审议。

(8) 如审议通过,基金经理在考虑资产配置的情况下,挑选合适的债券品种,灵活采取多种策略,构建投资组合。

##### (五) 投资限制

- 本基金不得投资于以下金融工具:

- 股票;
- 可转换债券;
- 剩余期限(或回售期限)超过397天的债券;
- 信用等级在AA+级以下的长期债券;
- 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券,但市场条件发生变化后从其规定;

本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产支持证券;

法律法规及监管部门取消上述限制后,本基金不受上述规定的限制。

##### 2. 组合限制

本基金投资组合应遵守以下限制:

- 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天;
- 本基金持有一家公司的债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
- 本基金持有的基金总资产不得超过基金净资产的140%;
- 投资于同一公司发行的短期企业债券及中期票据的资产,合计不得超过基金资产净值的10%;
- 本基金管理人管理的且全部资产投资于同一公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(9) 中国证监会、中国人民银行对银行间债券市场的基金资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(10) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(11) 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10%;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%;

(12) 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,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(13) 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%;

(14) 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%;

(15) 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,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(16) 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%;

(17) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(18) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(19) 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10%;

(20) 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%;

(21) 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,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(22) 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%;

(23) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(24) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(25) 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10%;

(26) 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%;

(27) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(28) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(29) 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10%;

(30) 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%;

(31) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(32) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(33) 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10%;

(34) 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%;

(35) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(36) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(37) 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10%;

(38) 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%;

(39) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(40) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(41) 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10%;

(42) 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%;

(43) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(44) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(45) 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10%;

(46) 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%;

(47) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(48) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(49) 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10%;

(50) 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%;

(51) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(52) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(53) 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10%;

(54) 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%;

(55) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(56) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(57) 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10%;

(58) 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%;

(59) 本基金在全国银行间同业拆借市场和债券交易所交易的资产净值不得超过基金资产净值的40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(60) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售业务资格及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(61) 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10%;

#### 2. 各类资产和负债余额占资产总额的比例

(1) 银行存款、清算备付金、交易保证金的余额上限为:证券清算款的余额上限以清算日至交收日的实际剩余天数计算;买断式回购购约金的余额上限以清算日至到期日的实际剩余天数计算;