

(上接D26版)

- 本基金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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
- 本基金依法合规运用股指期货的其他限制；
- 若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或调整，致使本招募说明书中的投资指令与投资组合比例限制被修改或调整，基金管理人将在依法履行程序后，对本基金合同相应条款进行修改，并予以公告，但修改后的条款不得与法律法规或监管机构的有关规定相抵触。

九、基金的融资融券

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、债券市场流动性、基金规模变动等本基金管理人无法控制的因素致使本基金不符合基金合同约定的投资比例时，基金管理人应当在下一个交易日内进行调整，法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

七、基金的投资组合情况

1. 报告期末按资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	240,940,000.00	67.23
	其中:债券	240,940,000.00	67.23
	资产支持证券	-	-
3	货币市场工具投资	-	-
4	买入返售金融资产	96,200,464.30	26.84
	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	17,664,819.67	4.76
6	其他资产	4,178,488.54	1.17
7	合计	358,383,473.51	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票投资

3. 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

4. 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	29,904,000.00	8.70
	其中:政策性金融债	29,904,000.00	8.70
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	211,036,000.00	61.42
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	240,940,000.00	70.12

5. 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041261005	12国债(1)	300,000	30,370,000.00	14.66
2	041261007	12国债(3)	300,000	30,345,000.00	14.65
3	041254015	12国债(10)	300,000	30,235,000.00	14.62
4	041252002	12国债(30)	400,000	39,984,000.00	18.60
5	121228	12国债(28)	300,000	29,900,000.00	14.50

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名资产支持证券投资明细

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名权证投资明细

8. 投资组合报告附注

9. 基金管理人及持有本基金资产前五名的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制前一年内受到证监会、证券交易所等监管部门处罚的情况

10. 本基金为债券基金，没有特殊投资限制。

11. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,168,397.11
5	应收申购款	10,492.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,178,889.64

12. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

13. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

14. 报告期末前十名债券中存在流通受限情况的说明

八、基金业绩

本基金业绩截止于2012年9月30日,基金过往业绩并不代表未来表现,本报告中列数据未经审计。

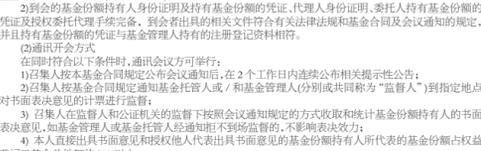
1. 净值增长率与同期比较收益率

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2012年6月12日至2012年9月30日	0.10%	0.03%	-0.09%	0.01%	0.11%	0.02%
2012年12月31日至2013年01月26日	0.89%	0.01%	0.32%	0.01%	0.41%	0.02%

2. 基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

3. 基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



(上接 D25 版)

1. 召开基金份额持有人大会的条件

(1)现场开会方式

在符合以下条件时,现场开会方可举行:

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金份额总数的50%以上(含50%);

2) 到会的基金份额持有人持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理委托书,到会者持有的有效身份证件和基金份额持有人的身份证明文件,均与基金注册登记资料相符合。

(2)通讯开会方式

在符合以下条件时,通讯开会方可举行:

1) 本基金基金份额持有人大会召开前5个工作日向全体基金份额持有人发出会议通知(包括但不限于会议时间、会议地点、会议方式和会议内容)并由基金管理人(以下简称“召集人”)或基金管理人授权的其他机构(以下简称“监票人”)将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

2) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

3) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

4) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

5) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

6) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

7) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

8) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

9) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

10) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

11) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

12) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

13) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

14) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

15) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

16) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

17) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

18) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

19) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

20) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

21) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

22) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

23) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

24) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

25) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

26) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

27) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

28) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

29) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

30) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

31) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

32) 召集人在会议开始前24小时向全体基金份额持有人发出会议通知,并由召集人将指定会议地点书面表决意见的统计进行监督;

注:1. 本基金基金合同生效于2012年6月12日,截止2012年9月30日本基金基金合同生效未满一年。

2. 本基金业绩截止日或为日期6个月内达到基金合同约定的资产组合,截至2012年9月30日,本基金尚处于建仓期。

九、基金费用

(一)申购和赎回的费用

1. 本基金的申购费用由基金申请人和基金管理人委托的代销机构收取,基金管理人可根据情况变更或增减申购费用,并于公告日,投资者可在该销售机构或基金销售业务的营业场所或代销机构提供的其他方式查询。

(二)申购和赎回的开放日及时间

1. 开放日及开放时间

本基金申购和赎回的开放日为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

2. 申购和赎回的开放时间

本基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

(三)申购和赎回的原则

1. 申购和赎回遵循“金额申购、份额赎回”的原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

2. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

3. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

4. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

5. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

6. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

7. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

8. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

9. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

10. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

11. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

12. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

13. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

14. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

15. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

16. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

17. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

18. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

19. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

20. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

21. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

22. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

23. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

24. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

25. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

26. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

27. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

28. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

29. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

30. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

31. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

32. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

33. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

34. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

35. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

36. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

37. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

38. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

39. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

40. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

41. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

42. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

43. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

44. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

45. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

46. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

47. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

48. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

49. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

50. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

51. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

52. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

53. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

54. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

55. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

56. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

57. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

58. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

59. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

60. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

61. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

62. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

63. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

64. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

65. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

66. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

67. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

68. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

69. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

70. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

71. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

72. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

73. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。

74. 基金申购和赎回的开放时间为自基金合同生效之日起,在符合法律法规及基金合同约定的条件下,本基金管理人有权根据情况暂停申购或赎回。