

(上接C6版)

极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

十二、基金的收益与分配

(一) 基金利润的构成:

1. 基金利润指投资人信用级别评级为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,在评级报告发布之日起个月内予以全部卖出;

2. 基金收益参与股票发行申购,其所申报的金额不得超过本基金的总资产,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;

3. 本基金投资于股票市场时,基金管理人应以其每个工作日交易结束后计算的当日基金的净资产值予以公布。

4. 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净资产净值的40%,本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

5. 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制;

因证券市场价格波动、上市公司并购、股权设置调整中支付对价等因素使基金投资比例发生变动,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,法律法规另有规定的,从其规定;

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。基金管理人对基金的投资监督与监察自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,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调整后的规定执行。

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 买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

⑤ 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;

⑥ 按照法律、行政法规和中国证监会的规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。上述禁止行为是基于不同情况的法律法规所约定的,若法律法规或监管部门取消上述限制,则本基金投资不再受相关限制;管理人应提前三个交易日公告,该调整无需召开基金份额持有人大会。

5. 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的一年定期存款基准利率(税后)+2%,其中,一年定期存款基准利率随中国人民银行公布的利率调整而调整。

本基金力求为投资人实现稳定的定期回报,选择一年期定期存款基准利率(税后)+2%作为本基金的业绩比较基准,能比较贴切地体现和衡量本基金的投資目标以及投资业绩。

如果中国银行业调整或停止该基准利率的发布,或者法律法规发生变化,或者今后市场中出现具有代表性的业绩比较基准或者更加适用于本基金的业绩比较基准时,本基金将根据实际情况对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致而无需基金份额持有人大会审议,并在报中国证监会备案后在新的招募说明书中列示。

6. 风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,混合型基金,高于货币市场基金。

7. 基金管理人代理基金行使权利的原则及方法

1. 有利于基金财产的安全与增值;

2. 不通过关联交易本身,雇员、授权代理人或任何存在利益关系的第三人牟取任何不当利益。

8. 基金的费用、融资、融券及融资融券

本基金将根据国家有关规定从事融资融券业务,转托管,待基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险管理的前提下,增加投资品种,从而提高投资效率及风险管理能力,届时基金将根据实际情况对投资品种、投资比例、费用收取、信息披露、估值方法及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会。

9. 基金的财产

(一) 基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(三) 基金资产的账户

基金管理人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户,开立的基本账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有财产账户以及其各自基金财产的账户相独立。

(四) 基金资产的保管和处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自身的名义承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运用基金财产所产生的债权,不得与其它固有资产产生的债务相互抵销;基金管理人管理运用不同基金的基金财产产生的债权债务不得相互抵销。

十. 基金资产的估值

(一) 估值原则

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

(二) 指定估值对象

基金所持有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(三) 指定估值方法

其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

1. 证券交易所上市的有价证券的估值

① 对于上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易市的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值;

② 对于在交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

③ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

④ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑤ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑥ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑦ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑧ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑨ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑩ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑪ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑫ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑬ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑭ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑮ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑯ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑰ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑱ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑲ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

⑳ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉑ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉒ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉓ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉔ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉕ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉖ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉗ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉘ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉙ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉚ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉛ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉜ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉝ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉞ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易市价,确定公允价值。

㉟ 对于在证券交易所上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按最近交易市的收盘价估值,如最近交易市后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价或最近交易市价,调整最近交易