

## 浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书摘要(更新)

重要提示 浦银安盛增利分级债券型证券投资基金经 2011年10月25日中国证券监督管理委员会证监许可 [2011]1704号文核准募集。 储银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》以下简称"基金合同》)于 2011年12月13日生效、根据 罄金合同》的有关规定、浦银安盛增利分级债券型证券投资基金封闭期届满 后、无需召开持有人大会、已转独为上市开放式基金 400°)、基金名称已变更为 铺银安盛稳健增利债券型 证券投资基金 400°/、基金代码为:16640°/、基金简称为 浦银安盛稳健增利债券 400°/、满格 增 B 的基金份额已转换为上市开放式基金 40°P分额 市本区等设置,由于成本区。10°P分额 本名联现明于极大用、组银安废增制分级债券型证券投资基金招募说明书》的定期更新,原招募说明书 与本招募说明书不一致的,以本招募说明书为处。 其金管理从保证本报复说明书的水度。

宏对平整蓝家菜的软件,并不依时其对年盛壶的引值和风缸门山夹加庄产间或保证。这个农的双页了半差。这有风险。 些养投资基金(以下简称 基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券的带来的小别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。 本基金投资于证券市场、基金单值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资人认购(破中购基金进企认真阅读本和幂级用升、全面认识本基金产品的风险设置将证和"品特性、充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对小购基金的意愿。时机、数量等投资行为作出独立决策,投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险。可能包括:证券市场整体水房已发的各类保存。 则证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险投入基金条件有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的 实者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险,基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险,是企业营业保存。 策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者目行负责。 基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的

。 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。 本次更新的招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2014 年 12 月 13 日, 有关财务数据和净值表现截止日 2014 年 9 月 30 日 财务数据未经审计)。 —、基金管理人

海山泉水 (21 )23212888 传真: (021 )23212800 客服电话:400-8828-999; (021 )33079999 网址:www.py-axa.com 联系人:徐莹 二、主要人员情况

2002 中国日上海关业分配有限公司总统主动统主2002 中主 2000 中国日上海关业采出有限公司。2011年 3月建担任公公司建立董事。 按启蒙先生,独立董事。法国岗域大学法学博士。1995 年 4 月加盟基德律师事务所担任第一2001年 起在基德律师事务所且在北台伙人。2004年起担任基德律师事务所上海首席代表。2006年 1 月至 2011 年 9 月,担任基德律师事务所全球合伙人。2011年 11 月起至今,任上海启恒律师事务所合伙人。自 2013 年

○ 公司总经理及其他高级管理人员 郁蓓华女士、复旦大学工商管理硕士。自1994年7月起,在招商银行上海分行工作,历任银行职员,招商银行宝山支行副行长,招商银行上海分行会计都总经理、计财都总经理,招商银行上海分行行长助理、副行长,招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月23日起担任本公司总经理。自2013年3月起,兼任本 1量节。 喻庆先生,中国政法大学经济法专业硕士和法务会计专业研究生学历,中国人民大学应用金融学硕士 8生学历。历任申银万国证券有限公司国际业务总部高级经理;光大证券有限公司 (上海 )投资银行部副 8理;光大保德信基金管理有限公司副督察长、董事会秘书和监察稽核总监。2007 年 8 月起,担任本公司

公。 李宏宇先生,西南财经大学经济学博士。1997年起曾先后就职于中国银行、道勤集团和上海东新国际 交流于元王。[时期创定人子至分子诗上] 59/4 于是自元的规则;于自通约、直到集创和工程求制国际投资管理有限公司分别从事联行结算、产品开发以及基金研究和投资工作。2007 年 3 月起加盟本公司,历任公司产品开发部总监、市场营销部总监、首席市场营销官。自 2012 年 5 月 2 日起,担任本公司副总经理兼首席市场营销官。

大学数量经济学硕士。2006年3月至2009年6月,先后就职于红顶金融研究中心,

上海证券有限公司。2009年7月进入市辖於盤基金管理公司,仍任固定收益时代页、市银安盤优化收益院 举型证券投资基金基金经理。2011年12月起赶 任本基金基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2011年12月起赶 11月起,担任本公司固定收益投资都总监。2013年5月起,兼任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013年5月起,兼任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2014年7月起,兼任浦银安盛代化收益债券型证券投资基金基金经理。2014年12月起,兼任浦银安盛月月盈安心养 艺定期支付债券型证券投资基金基金经理。薛特先生拥有8年证券从业经验。薛特先生从未被监管机构予 以行政处罚或采取行改监管措施。 伍、股资决策委员会成员 都倍华女士、本公司副总经理兼首席市场营销官。 董列华生、本公司副总经理兼首席市场营销官。

李宏宇先生,本公司耐息经理兼首席市场官销官。 黄列先生,本公司财产资配总监。公司旅下浦银安盛红利精选股票股证券投资基金,浦银安盛精致生 法灵活配置混合型证券投资基金,浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金及浦银安盛消费升级灵活包 置混合型证券投资基金基金经理。 解静先生,本公司固定收益投资部总监,公司旅下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金,浦银安盛等福田报定期开放债券型证券投资基金,浦银安盛。6个月定期开放债券型证券投资基金,浦银安盛等率添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金人本基金基金经理。

釋。 除土俊先生、本公司金融工程部总監、公司旗下浦银安盛沪深 300 指數增强型证券投资基金以及浦银安盛中证党联基本面 400 指数证券投资基金基金经理并兼任本公司职工监事。 蒋建伟先生、本公司版下浦银安盛价值成长股票型证券投资基金以及浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

督察长、其他基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。 督察长、其他基金完理及至亚二十二次 (六)上述人员之间均不存在近亲属关系 二、基金托管人

一、基本情况 名称:上海银行股份有限公司(以下简称"上海银行") 住班:上海市浦东新区银坡中路 168号 办公地址:上海市萧东新区银坡中路 168号 法定代表人.范一飞

法应代表人.范一飞 成立时间:1995 年 12 月 29 日 组织形式,股份有限公司 注册资本,人民币 47.04 亿元 存续期间:持续经营 基金任管业务批准文号;中国证监会证监许可[2009]814 号 托管部即联系人.夏虹 电话:021-68475682 传真:021-68475623 二、主要人员情况

上海银行于2009年8月18日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务,批准文

上海银行于2009年8月18日获得中国此监会、中国联监会修理开外证分达从强强。几日至少,他与中国证监会证监许可[2009]814号。 号:中国证监会证监许可[2009]814号。 截至2014年11月30日、上海银行已托管10只证券投资基金,分别为天治成长精选股票型证券投资 基金,浦银安盛增利分级债券型证券投资基金,中证财通中国可持续发展100 €CPI ESG 准数增强型证券 投资基金。鹏年双债增和债券型证券投资基金,排银安盛季季添和定期开放债券型证券投资基金。解华双债 保利债券型证券投资基金。鹏华丰信分级债券型证券投资基金,前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式 证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金,托管 三、相关服务机构

、高速於1985-1995 (一直籍机构 1.浦接安盛基金管理有限公司上海直销中心 住所:上海市浦东新区浦东大道981号3幢316室 办公地址:中国上海市淮海中路381号中环广场38楼 电话: 021 )23212899 传真: 021 )23212890 客服电话:400-8828-999; (021 )33079999 联系人:徐莹 

- 、基金份额发售机构

址:深圳市福田区深南大道 7088 号 定代表人:李建红 客服电话:95555

例址: www.cmbchina.com 4)交通银行股份有限公司: 地址:上海市银城中路 188 号 法定代表人:牛锡明 网址:www.bankcomm.com

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司基金托管人:上海银行股份有限公司

客服电话:95558 网址:bank.ecitic.com 6)申银万国证券股份有限公司 注册地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层 注号企业主: 上海 2012

客服电话:95562

各/ 加力 (1823:1930)3 公司 网址: www.newone.com.cn (1) /信达证券股份有限公司 地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 服条执线 400-800-8899

地址:上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人:薛峰 客服电话:95525

网址:www.ebscn.com 03 中国银河证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 法定代表人:陈有安 客服电话:95551

emuse\_ici-y5551 公司网站: www.chinastock.com.cn 04 渤海证券股份有限公司 注册地址: 天津公济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室 办公地址: 天津市南开区宾水西道 8 号 法定代表人、杜庆平

各版电记:4000513986 公司网址:www.blzq.com 05)齐鲁证券有限公司 办公地址:山东省济南市经七路86号 法定代表人:李玮 客户服务热线:95538

18 开机证分百成公司 :册地址:南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层法定代表人:王宜四

E册地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层 法定代表人:黄金琳 户服务热线: 0591-96326 或 400-88-96326 网址:www.hfzq.com.cn 20)国泰君安证券股份有限公司

20/届李石文证券版7号版公司 进出:上海市浦东新区宿城路 618 号 松公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼 定代表人:万建华

户服务热线:95521 或 400-8888-666

2.场内代銷机构 投资者可通过"证基金通"为理本基金的上海证券交易所场内申购与赎回,可办理"工证基金通"业务 的证券公司的具体名单可在上海证券交易所网站查询。如果上海证券交易所增加或减少具有"工证基金通"业务资格的证券公司,请以上海证券交易所的具体规定为准。 二、注册登记机构 名称、中国证券登记技算有限责任公司 在所、建立新进程处于证券长生、二号

主所:北京市西城区太平桥大街 17号 办公地址:北京市西城区太平桥大街 17号 法定代表人:周明

传真: 010 )50938907 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师 名称:盈科(上海)律师事务所 

联系人, 徐艳 经办注册会计师: 徐艳、蒋燕华 五、其他服务机构及委柱办理业务的有关情况 公司信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统,网络集成系统、这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成、之后日常的维护管理由公司负责,但与第三方服务公司签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统。直销系统、资金清算系统、投资资系统、投资公务统、投资公司条证,但长易系统、原心之易系统。呼叫中心系统外服系统。营销数据中心系统、统金清算系统。也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成、建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统加标组条统加标组、开发自有条线、地均是系统提供商对外配通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责,但与系统提供商签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外、公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护证证

尹·yo。 、本公司可以根据自身发展战略的需要,委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估 四、基金份额的分级 本基金通过基金资产及收益的不同分配安排,将基金份额分成预期收益与预期风险不同的两个类别,

即 A 类份额和 B 类份额。 — 基金份额类别的交易规则 本基金份额类别的交易规则 本基金通过场外,场内认购的全部份额均将按照 7:3 的比例确认为 A 类份额和 B 类份额。场外的 A 类份额和 B 类份额登记在注册登记系统;场内的 A 类份额和

份额登记在证券登记结算系统。 本基金基金合同生效后进入封闭期,封闭期为3年。本基金A类份额与B类份额在本基金的封闭期内 在臺遊產並可同生XA口近入到10期,到10期分3 ++。 本盛並 A 实订制 B 失订制任单卷並的到10期的存集,在封闭期内,如符合上市条件,基金管理人将向深圳证券交易所申请 A 类份额和 B 类份额上 B 类份额 在 交易所市场交易,也可以将其持有的登记在注册登记系统的 A 类份额和 B 类份额跨系统转登记到证券登记结算系统后在交易所

収益率。
2、本基金封闭期的约定日标收益率为年收益率
约定目标收益率-3 年期银行定期存款利率+0.25%
3 年期银行定期存款利率+0.25%
3 年期银行定期存款利率指基金合同生效日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率-3 年期银行定期存款利率按照四舍五人的方法保留到小数点后第 2 位 单位为百分数 )。基金合同生效后,本基金的约定目标收益率之推利。3 约定目标收益率为推利。
四、基金份额净值的计算

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

」。 、在封闭期内基金份额争值计算公式为: 金份额净值→计算日基金资产净值计算日发行在外的 A 类份额和 B 类份额数量的合计 。在基金份额净值→计算日及全的基金份额净值计算公式为。 5金份额净值→计算日基金资产净值计算日折算后发行在外的浦银安盛稳健增利债券型证券投资基 基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五人,由此产生的误差计人基金财

产。 五、封闭期截止日 A 类份额和 B 类份额份额争值的计算 按照本基金合同约定的 A 类份额及 B 类份额权益分配规则,在封闭期截止日分别计算 A 类份额与 B 类份额的份额争值,并按各自的份额争值进行资产分配。

假设: NAV 为本基金在封闭期截止日基金份额净值 NAVa 为封闭期截止日 A 类份额的份额净值 NAVb 为封闭期截止日 B 类份额的份额净值

Ra 券约定目标收益率 则封闭期截止日 A 类份额与 B 类份额的份额争值计算公式如下: 1.当 NAV。Q · Rax3 k0.70 时,则在封闭阴截止日 A 类份额及 B 类份额的份额争值分别为: 

NAVa=NAV 0.70
NAVb=0
PADHO
NAVb=0
PADHO
P

T日为估值日 NAVa 为T日A类份额的份额参考净值 NAVb 为T日B类份额的份额参考净值

额参考净值可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

NAVO 21 LIB 关键/ 76/00/1976 测多分序中国 Ra 为约定目的收益率 Te 为自基金合同生效日至 T目的实际天数 Th 为自基金合同生效之日始至封闭期截止日所包含的实际总天数 则 T日 A 类价额及 B 类价额的份额参考净值的计算公式如下: 1.当 NAV> 4 中 Rax3xTe/Th > 0.70 时,则 T日 A 类价额及 B 类价额的份额参考净值分别为:

NAVI=0 A 类份额及 B 类份额的份额参考净值的计算保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五人。 五、基金的名称 本基金名称:浦银安盛榜健增利债券型证券投资基金 LOF) 本基金由浦银安盛增利分级债券型证券投资基金三年封闭期届满转换而来。 六、基金的类型

七、基金份额的上市交易与份额折算 

二、基金份额的上市交易 基金合同生效后,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,本基金在封闭 期内,基金份额所分成的 A 类份额与 B 类份额两类基金份额同时申请上市交易。 在本基金封闭期届满、A 类份额与 B 类份额分别按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市 开放式基金 (DF) 基金份额,转换后的基金份额继续在深圳证券交易所上市交易。 1、上市交易的地点

本基金份额 射闭期内 A 类份额与 B 类份额 )上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接 在深圳证券交易所上市交易,登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转 至证券登记结算系统后,方可上市交易。

至此所变见它母弄死况后,70月上印义物。 2、上市交易的时间 本基金浦银增 A 与浦银增 B 基金份额于 2012 年 3 月 9 日起在深圳证券交易所上市交易 (二级市场交 表代码分别为:浦银增 A (50062)、浦银增 B(150063),并于 2014 年 12 月 15 日终止上市。本基金完成基金 转型后,浦粮安盛稳健增利债券型证券投资基金 4.09 计 2015 年 1 月 8 日开始在深圳证券交易所上市交

3、上市交易的规则
4 ) A 类份额 B 类份额分别采用不同的交易代码上市交易;
2 ) A 类份额 B 类份额分别采用不同的交易代码上市交易;
2 ) A 类份额 B 类份额上市首日的开盘参考价分别为各目前一工作日的基金份额参考净值;
5 ) A 类份额 B 类份额实人向格涨跌幅限制,涨跌幅比例为 10%, 自上市首日起实行;
4 ) A 类份额 B 类份额申报价格 最小变动单位为 0.001 元人民币;
6 ) A 类份额 B 类份额上市交易遵循深圳证券交易所相关业务规则及规定。
4、上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。
5、上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。
5、上市交易的货用接欠

上市交易的資用按照採外III在分米郊/ITE AAMCEA/VASIC 5、上市交易的行情超示 A 类份额及 B 类价额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同 时揭示基金前一交易目的基金份额参考净值。 6、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 () 斯离本基金封闭期截止日不足 1 个月时,基金管理人可以向深圳证券交易所申请暂停 A 类份额和

位 A 类份额和 B 类份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执 

▽▽ : V. 为折算后基金份额的数量

wi /201月/口基金灯额时效量 Wa 为折算前 A 类份额的数量 NAVa 为份额折算基准日 A 类份额的份额净值

则: W=WaxNAVa/1.000 上述计算结果,场内份额采用截位法保留到整数位,场外份额采用截位法保留到小数点后 2 位,小数点以后的部分舍去,会去部分计入基金财产。 例如某基金投资者折算前持有10000 份 A 类份额,封闭期截止日 A 类份额的份额净值为 1.13500000 元。则扩撑后该基金投资者持有 11350 份浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 1.0F)基金份额,不再持

2 B 类份额折算公式 假设: W<sub>2</sub> 为折算后基金份额的数量 Wb 为折算前 B 类份额的数量 NAVb 为份额折算基准日 B 类份额的份额净值

W:=Wb×NAVb/1.000 上述计算结果,场内份额采用截位法保留到整数位,场外份额采用截位法保留到小数点后两位,小数点 以后的部分舍去,舍去部分计人基金财产。例如某基金投资者折算前持有 10000 份 A 类份额 6场内 1,10000 份 B 份额 6场内 1,10000 份 B 份额 1,10000 份 B 份 1,100000 份 B 份 1,10000

B 实行测。 6、份额折算的变更登记 本基金的注册登记机构将根据份额折算结果于变更登记日完成基金份额的变更登记。 7、份额折算结果的公告 7.份额折算结果的公告 注册登记机构变更登记结束后,基金管理人应在指定媒体对份额折算结果予以公告。 ///、基金的投资目标

定队益央资产的记列个同,25至20人,7.50亿人。

一、基金的投资策略 本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置 人期管理、类属配置进行动态管理,寻找各类资产的潜在良存投资机会,一方面在个类选择上采用目下而上的方法、通过流动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制,运用多种积极的资产管理增值策略,实现投资目标。

(一)院产配置本基金将自上而下地实施整体资产配置策略,通过对宏观经济运行状况、货币政策变化、市场利率走势、市场资金供求情况、经济周期等要素的定性与定量的考察,预测各大类资产未来收益率变化情况,在不同的大类资产之间进行动态调整和优化,以规避市场风险,提高基金收益率。
(二)固定收益类证券投资策略
1人期与期限结构管理策略 1、八射一列於67的每1基末時 利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一,衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基 金通过对宏观经济状况和货币政策的分析。对债券市场走势作出判断,并形成对未来市场利率变动方向的 预期,志志调整债券组合的人期。在久期确定的基础上根据对收益率曲线形状变化情景的分析,分别采用 子弹型策略、赋铃型策略或梯形策略,在长期,中期和短期债券间进行合理配置,以从长、中、短期债券的相

4、吳明和旦東哈 在保证流力性的基础上,本基金将通过国债,央行票据、金融债,企业债、公司债、可转换债券、短期融资券,可分离债券、资产支持证券、回顺和银行存款等资产的合理组合实现稳定的投资收益。 类属配置主要策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易所与银行间的市场利差、企业债与国债的信用利差等。寻找价值相对银估的投资品种。 3、个券选择策略 ① 流动性策略 在封闭期间,本基金对个券的流动性要求不高,在封闭期届满,本基金转换为上市开放式基金 LOF) 后,将通过对各类流动性指标的设置与监控,管理由于基金的申购,赎回或个券的交易难易程度而引致的潜

为了确保本金安全的基础上获得稳定的收益,本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等信用债券进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成:①独立第三方的外隔部较结果。②第三方担保情况。③第三方担保情况。③第三方担保情况。③第三方担保情况。③第三方担保情况。到了基金管理人自有的数量化公司财务研究模型的内部评价。该模型在信用评价方面的主要作用在于通过对部分关键的财务指标分析判断债券发行企业未来出现偿债风险的可能性。从而确定该企业发行债券的信息营运力现金流总负债。其中资产负债率、流力资产流动负债。经营运力现金流总负债。其中资产负债率、流力资产流动负债主要分析企业债务水平与结构,其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持的方。
4.回购策略,这策略在本基金封闭期内是风险较低的投资策略。即在基础组合的基础上,使用基础组合持有的债券进行回购帐户短期资金滚动操作。同时选择适宜期限的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。
5.可转债投资策略。可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的固定收益类投资品种,其理论价值等于作为普通债券的纯债券价值加上可转债内含选择权的价值。
①积极管理策略
可转债内含选择权定价是决定可转债投资价值的关键因素。本基金在对可转换公司债券条款和发行公司基本面进行深入分析研究的基础上,利用可转债的纯债券价值和到期收益率来判断可转债的债性。以增强本会投资的安全性;利用可转债特价值的链价率来判断可转债的债性。以增强全投资的安全性;利用可转债转价值相对于纯债价值的溢价率来判断可转债的债性。以增强全投资的安全性;利用可转债转价值相对于纯债价值的溢价率来判断可转债的债性。以增强会投资的安全性;利用可转债的债性。以增强全投资的安全性;利用可转债的债性。以增强企业设施,在资产设施,是不是不是企业的企业。 了确保本金安全的基础上获得稳定的收益,本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等信用债

[2次时],14元724年8月上5日3月3日 ②一级市场中购策略 目前,可转债均采取定价发行,对于那些发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债,因供 下平衡,会产生较大的一、二级市场价差。因此,为增加组合收益。本基金将在充分研究的基础上,参与可 废债券的一级市场中购,在严格控制风险的前提下获得稳定收益。 这债券的一级市场申购。在"格尼制风险即则是个欢快程。 6、资产支持证券投资策略 本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征、来估计资产进约风险和提前偿付风险。根据资 本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征、来估计资产进约风险和提前偿付风险。根据资 支外资产支持证券进行估值。同时还将充分为感该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,控制资产支 证券投资的风险。以获取较高的投资收益。

行证券投资的风险。以获取较商的投资收益。 它、膨积单购策略 在股票发行市场上,股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价 差、从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次全价(IPO)股票及增发新股的上市 公司基本面、根据股票市场整体定价水平、估计新股上市交易的合理价格、同时参考一级市场资金供求关 系、谨慎参与新股申购。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票,在可上市交易后 90 个交易日内全部

本基金将因为所持股票以及投资可分离债券等原因而被动获得权证。本基金进行权证投资时权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上、结合股价被动率等参数,运用数量化期权定价模型合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合以及持有价值出现较为显著的低估的权证品种。 十一、业绩比较基准 本基金业绩比较基准:中信标普全债指数

本基金业缴比较基准;中信标普全债指数 中信标普全债指数的编制方为中信标普指数信息服务有限公司,由中信证券以及全球富有盛名的指数 职务提供高 S&P 共同编制和纯维护,体现了指数编制的先进性; 中信标普全债指数是一个全面反映整个债券市场(交易所债券市场、银行间债券市场)的综合性权威债 券指数。商盖了在上海证券交易所,深圳证券交易所前银行间市场上市的债券。对于交易所交易债券,剩余 期限在1年以上,票面余额超过1亿人民币,信用评级在投资级以上的债券均包全吃滤材数当中,于银行 间债券,根据债券类型和期限运用分层取样的方法进行了选择,更能够敏锐,直接、全面地反映市场对利率 的预期及市场的走势。该指数具有广泛的市场代表性。能够全面反映债券市场总体走势;该指数基期为 2002年11月29日、于每个交易日收市户以公布,每半年调整一个"该指数编制方法,指数数据等相关指数 信息透明度高,适合作为本基金的业绩比较基准。 如果上选基准指数停止计算编制使更改名称。或者今后法律法规发生变化,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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。 十二、风险收益特征 本基金为债券型证券投资基金。属于证券投资基金中的较低风险品种。一般情形下,其风险收益预期低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。

从本基金所分成的两类基金份额来看,由于本基金资产及收益的分配安排,A 类份额为预期风险低、预期收益相对稳定的基金份额;B 类份额为预期风险较高,预期收益较高的基金份额。

序号	项目	金額 (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	1,775,839,354.06	92.89
	其中:债券	1,775,839,354.06	92.89
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人 返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金 合计	83,992,207.78	4.39
7	其他资产	52,017,895.59	2.72
8	合计	1,911,849,457.43	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转有股票。 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 本基金本报告期末未特有股票。

国家债券 1,366,046,520.70 13.46 1,775,839,354.06 157.24

心价值占基金的 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 110020 848,500 8.45 110023 77,187,000.00 6.83 825,000 740,000 76,271,800.00 500,010

本基金不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

73. 3	4514		TETH ALL	
1	存出保证金		124,916.48	
2	应收证券清算款		-	
3	应收股利		-	
4	应收利息		51,892,979.11	
5	应收申购款		-	
6	其他应收款		-	
7	待摊费用		-	
8	其他		-	
9	合计		52,017,895.59	
11.4 报告期末	联持有的处于转股期的可转换债	券明细	金额单位:人民	
<b>                                       </b>	TT	A A A #>	F-44 A 3/6-2-1/2 (4:11-70) (4:1	

95,464,735.00 3,270,900.00

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最假收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅 (一)基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 净值增长率 ① 净值增长率 业绩比较基 标准差② 准收益率③ 1)-(3) 2-4

十四、基金业绩

0.20% 0.04% 2011/12/13-2011/12/3 11.98% 0.16% 4.03% 2012/01/01-2012/12/31 -1.34% 0.50% 1.78% 24.70% 0.33% 12.09% 全累计份额净值增长率变动及其与

2011年12月13日至2014年9月30日 11.1 ——通行会通知的证据等 --- 工会等等 十五、费用概览

一、与基金运作有关的费用 1、基金管理人的管理费; 3、基金销售服务费; 4、基金上市费用;

9、基金的银行汇划费用:
10.按照国家有关规定和 罄金合同》的定,可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中订除。
二上还基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下,本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=Ex0.7%+当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,接口累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费数据含、基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日公休日等,支付日期顺延。
2.基金托管人为托管费

2.基金托管人的托管费 在通常情况下,本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如

用EAUL206-3十个AN H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划 款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,

3.43並和自成为以 基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。 在通常情况下,本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。基金销售服务

费的计算方法如下: H=E×0.35%÷当年天数

H=EAJSS4、当年天数 H 方每日应计提的基金销售服务费 E 为前一日的基金资产净值 基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费制或指令,基金并管人复核后干次月前2个工作日内从基金财产中划出,由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。 上述一、基金费用的种类中第 4-9 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金产管人从基金财产中支付。 四、不列人基金费用的项目 下列费用不列人基金费用。 1.基金管理人和基金托管人人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失; 2.基金管理人和基金托管人人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失; 2.基金管理人和基金托管人人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失; 3. 截金合同处效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用; 4.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。 五.费用调整

页用调整 含管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销 基並自译人內德並北自人的同 基施自译人內德並北自人的同 其限分數字符刊关數等。 國高基金管理數率或基金化管數率或基金销售服务數率等數率,须召开基金份額持有人大会审议;调 低基金管理數率或基金件管數率或基金销售服务數率等數率,无须召开基金份額持有人大会审议;调 WSET ## 1 大学 | 1 大学 |

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

本基並定下边程中涉及的合为税土体。其类税以多效国家税权还样。法规税行。 本基金管理人依据 仲华人民共和国证券投资基金法》、公开募集证券投资基金运作管理办法》、征券投资基金销售管理办法》、征券投资基金信息披露管理办法及其仓有关法律法规的要求、结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动、对本基金的原招募说明书进行了更新。主要更新的内容如下: 1、更新了 重要提示"的部分内容; 2、在 第二部分 基金管理人"部分,对部分内容进行了更新"。 3、更新了 第四部分 基金托管人"的 基金托管人的基本情况"、主要人员情况"和 基金托管业务经营信况"。

等62"; 4、更新了 第五部分 相关服务机构"中更新了代销机构和注册登记机构的部分信息; 5、在 第九部分 基金份额的上市交易与份额折算"部分,更新了基金上市的相关信息; 6、在 第十部分 基金份额的申购与赎回"部分,补充了申购与赎回的开始时间"部分信息; 7、在 第十一部分 基金的投资"部分,补充了本基金最近一期公开披露的投资组合报告的内容和投

资业绩; 8、在 第二十二部分 对基金份额持有人的服务"部分,对资料寄送和客户服务中心部分内容进行了更

9、在 第二十三部分 其他应披露事项"部分,更新了基金管理人 2014 年 6 月 14 日至 2014 年 12 月 13 日刊登于 仲国证券报》、《止海证券报》、《证券时报》和公司网站的与本基金相关的公告。