

(上接B38版)

(八) 接受托管的资产及策略
本基金将在充分风控的前提下,以套期保值为目的,遵循有效管理原则充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货价格和股指期货价格的研究,结合指数定价模型、采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约,对本基金投资组合进行适时、有效地调整优化,提高投资组合的运作效率。

(九) 基金的支取与券商资金账户
本基金将部分资产支持券的资产特征,估计违约率和前偿付比率,并利用收益曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

四、投资限制

1. 组织架构
基金的投资组合遵循以下限制:

(1) 本基金股票投资占基金总资产的比例为0%~95%,投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许的其他品种的比例合计不超过5%~100%;

(2) 本基金每个交易日总金额在扣除股指期货合约的交易保证金后,应当保持不低于基金净资产净值5%的现金或者到期日在一年以上的国债;

(3) 本基金持有的同一公司发行的证券,其市值不超过基金净资产的10%;

(4) 本基金基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该公司的10%;

(5) 本基金持有的所有股票,其市值不得超过基金净资产的3%;

(6) 本基金基金管理人管理的所有基金持有一家证券公司的同一权证,不超过该权证的10%;

(7) 本基金持有的交易性金融资产(包括但不限于股票、债券、基金等)的公允价值,不得超过基金净资产的0.5%;

(8) 本基金现金头寸(即一揽子投资品种中现金及现金等价物的余额)比例,不得超过基金净资产的10%;

(9) 本基金持有的所有资产支持证券,其市值不得超过基金净资产的20%;

(10) 本基金持有的同一债券品种的比例,不得超过该债券品种资产支持证券规模的10%;

(11) 本基金基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过该类资产支持证券合计规模的10%;

(12) 本基金投资于货币市场基金的比例不得超过BBB+级(含BBB+)货币市场的资产支持证券。本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,应在定期报告公告之日起3个月内予以卖出;

(13) 基金所持股票、债券及衍生品头寸当日买入金额不得超过基金的总资产,本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票的金额,且不得超过其金额的50%;

(14) 本基金持有的股票头寸比例,不得超过基金资产净值的40%。债券回购的最长期限为1年,债券回购到期日不得早于次日,本基金的总份额不得低于买入时基金资产净值的95%;

(15) 本基金在任何交易日买入、持有的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的95%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的短期债券)、权证、货币市场基金、买断式回购(不含质押式回购)等;

(16) 本基金在任何交易日持有的单只股票期货行权比例,不得超过基金持有的股票的20%;

(17) 本基金在任何交易日买入、持有的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的40%。债券回购的最长期限为1年,债券回购到期日不得早于次日,本基金的总份额不得低于买入时基金资产净值的95%;

(18) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(19) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(20) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(21) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(22) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(23) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(24) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(25) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(26) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(27) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(28) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(29) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(30) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(31) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(32) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(33) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(34) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(35) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(36) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(37) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(38) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(39) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(40) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(41) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(42) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(43) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(44) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(45) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(46) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(47) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(48) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(49) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(50) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(51) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(52) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(53) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(54) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(55) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(56) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(57) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(58) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(59) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(60) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(61) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(62) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(63) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(64) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(65) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(66) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(67) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(68) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(69) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(70) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(71) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(72) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(73) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(74) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(75) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(76) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(77) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(78) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(79) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(80) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(81) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(82) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(83) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(84) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(85) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(86) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(87) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(88) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(89) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(90) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(91) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(92) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(93) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(94) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(95) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(96) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(97) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(98) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(99) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(100) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(101) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(102) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(103) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(104) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(105) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(106) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(107) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(108) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(109) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(110) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(111) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(112) 本基金在任何交易日买入、卖出的单只股票期货行权比例,不得超过基金资产净值的10%;

(113) 本基金在任何交易日买入、