



Disclosure 信息披露

2016年3月18日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B24

(上接B23页)

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证,受托出具书面意见的代理人出具的持有基金份额的凭证及委托人的代理授权委托书均符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符。

(5) 会议决议公告前经中国证监会备案。

3. 法律法规或监管机构允许的其他方式,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或者其他方式进行表决,或者采用网络、电话或者其他方式授权他人代为出席会议并表决。

4. 以下内容和程序

1. 议事内容及决策程序
议事内容涉及基金份额持有人的利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改,决定终止《基金合同》,更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并(法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外),法律法规及《基金合同》规定的其他方式项目以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2. 议事程序

(1) 现场开会
在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七项规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的代理人,基金管理人和基金托管人相不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

(2) 通讯开会
在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下召开基金份额持有人大会,在公证机关现场录像全程记录。基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

3. 特别决议、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其授权人所持表决权的2/3以上(含2/3)通过并做出,构成基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金其他基金合同约定的事项通过方式有效。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份有效的表决视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的召集人必须聘请同一项或几项不同的各项议案应当分开审议、逐项表决。

七、 清算

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的持有人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人,如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人不出席大会的,基金份额持有人大会的持有人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒绝在场的,不影响计票的效力。

八、 生效与公告
基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效,并应当在做出决议生效后五个工作日内按照法律法规和中国证监会相关规定的方式指定媒介公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

九、 法律法规或监管机构对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

第二部分 基金收益分配原则、执行方式

一、 基金收益的构成
基金收益指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、 基金可供分配利润
基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、 基金收益分配原则
1. 符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2. 本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者选择不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4. 每一基金份额享有同等分配权;

5. 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

在不违反法律法规的情况下,基金管理人、登记机构将对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

四、 收益分配方案
基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、 收益分配方案的确定、公告与实施
本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距收益分配基准日(即可供分配利润截止日)的时间不得超过15个工作日。

六、 基金收益分配中发生的费用
基金收益分配中发生的银行转账或其他手续费费用由投资者自行承担;当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费时,基金登记机构将投资者的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方式,依照《业务规则》执行。

第四部分 与基金资产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

一、 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费;

2. 基金托管人的托管费;

3. 《基金合同》生效日后与基金相关的信息披露费用;

4. 《基金合同》生效日后与基金相关的会计师事务所、律师事务所、仲裁费和诉讼费费;

5. 基金份额持有人大会费用;

6. 基金的证券、期货交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、证券、期货账户相关费用及其他类属性的费用)等;

7. 基金的银行汇划费用;

8. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用,在中国证监会允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,不需召开持有人大会,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

二、 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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.40%,其中:H为每日应计提的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,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管理费划款指令,基金托管人复核后于次月5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、公休等,支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%,其中: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5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,支付日期顺延。

上述“一、基金费用”的种类中第3—7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,由基金管理人从基金财产中支付。

三、 不列入基金费用的项目

(一) 期间费用列入基金费用:

1. 基金管理人和基金托管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处理和保管基金份额持有人申购或赎回款项发生的费用;

3. 其他根据相关法律法规和中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目;

四、 基金税收
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。

第一部分 基金资产的投向和投资限制

一、 投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、国债期货以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相关规定)。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、国债期货、国债回购、银行存款、大额可转让存单等固定收益类资产,本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可通过可转债转股所形成的股票,因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等,因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。

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

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,应当保持不低于交交易保证金一倍的资金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例做相应调整。

二、 投资限制

1. 组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(2) 本基金投资于国债期货资产的比例不低于基金资产净值的5%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(3) 本基金持有一家机构发行的证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金持有一家机构发行的全部基金资产不超过一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任交易日内买入权证的成本,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8) 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,不得超过基金资产净值的10%;

(9) 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%;

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11) 本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,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12) 本基金应投资于信用评级为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,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

(13) 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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(14) 本基金投资于国债期货,还应遵循如下投资组合限制:

①在任何交易日日终,本基金持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

②本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

③本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(15) 封闭运作期内,本基金基金总资产不得超过基金净资产200%;封闭运作期外,本基金基金总资产不得超过超过基金净资产的140%。

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资组合不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。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9个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间,基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金管理人应对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管机构取消上述限制,如适用不受本基金,基金管理人将在履行适当程序后,则本基金投资不受相关限制。

三、 禁止行为
法律法规或监管机构取消上述限制,如适用不受本基金,基金管理人将在履行适当程序后,则本基金投资不受相关限制。

五、 基金财产的投向和投资限制

一、 基金财产的投向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、国债期货以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相关规定)。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、国债期货、国债回购、银行存款、大额可转让存单等固定收益类资产,本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可通过可转债转股所形成的股票,因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等,因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。

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

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,应当保持不低于交交易保证金一倍的资金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例做相应调整。

二、 投资限制

1. 组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(2) 本基金投资于国债期货资产的比例不低于基金资产净值的5%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(3) 本基金持有一家机构发行的证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金持有一家机构发行的全部基金资产不超过一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任交易日内买入权证的成本,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8) 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,不得超过基金资产净值的10%;

(9) 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%;

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11) 本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,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12) 本基金应投资于信用评级为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,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

(13) 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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(14) 本基金投资于国债期货,还应遵循如下投资组合限制:

①在任何交易日日终,本基金持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

②本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

③本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(15) 封闭运作期内,本基金基金总资产不得超过基金净资产200%;封闭运作期外,本基金基金总资产不得超过超过基金净资产的140%。

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资组合不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。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9个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间,基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金管理人应对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管机构取消上述限制,如适用不受本基金,基金管理人将在履行适当程序后,则本基金投资不受相关限制。

五、 基金财产的投向和投资限制

一、 基金财产的投向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、国债期货以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相关规定)。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、国债期货、国债回购、银行存款、大额可转让存单等固定收益类资产,本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可通过可转债转股所形成的股票,因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等,因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。

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

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,应当保持不低于交交易保证金一倍的资金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例做相应调整。

二、 投资限制

1. 组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(2) 本基金投资于国债期货资产的比例不低于基金资产净值的5%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(3) 本基金持有一家机构发行的证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金持有一家机构发行的全部基金资产不超过一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任交易日内买入权证的成本,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8) 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,不得超过基金资产净值的10%;

(9) 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%;

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11) 本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,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12) 本基金应投资于信用评级为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,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

(13) 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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(14) 本基金投资于国债期货,还应遵循如下投资组合限制:

①在任何交易日日终,本基金持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

②本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

③本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(15) 封闭运作期内,本基金基金总资产不得超过基金净资产200%;封闭运作期外,本基金基金总资产不得超过超过基金净资产的140%。

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资组合不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。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9个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间,基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金管理人应对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管机构取消上述限制,如适用不受本基金,基金管理人将在履行适当程序后,则本基金投资不受相关限制。

五、 基金财产的投向和投资限制

一、 基金财产的投向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、国债期货以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相关规定)。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、国债期货、国债回购、银行存款、大额可转让存单等固定收益类资产,本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可通过可转债转股所形成的股票,因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等,因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。

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

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,应当保持不低于交交易保证金一倍的资金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例做相应调整。

二、 投资限制

1. 组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(2) 本基金投资于国债期货资产的比例不低于基金资产净值的5%(开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制);

(3) 本基金持有一家机构发行的证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金持有一家机构发行的全部基金资产不超过一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任交易日内买入权证的成本,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8) 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,不得超过基金资产净值的10%;

(9) 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%;

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11) 本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,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12) 本基金应投资于信用评级为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,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

(13) 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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(14) 本基金投资于国债期货,还应遵循如下投资组合限制:

①在任何交易日日终,本基金持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

②本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

③本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(15) 封闭运作期内,本基金基金总资产不得超过基金净资产200%;封闭运作期外,本基金基金总资产不得超过超过基金净资产的140%。

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资组合不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。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9个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间,基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金管理人应对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管机构取消上述限制,如适用不受本基金,基金管理人将在履行适当程序后,则本基金投资不受相关限制。

五、 基金财产的投向和投资限制

一、 基金财产的投向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、国债期货以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相关规定)。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、国债期货、国债回购、银行存款、大额可转让存单等固定收益类资产,本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可通过可转债转股所形成的股票,因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等,因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。

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

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;开放运作期开始前一个月至开放运作期结束后三个月内不受此比例限制;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交交易保证金后,应当保持不低于交交易保证金一倍的资金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例做相应调整。