

Table with 2 columns: Company Name and Office Address. Lists various financial institutions and their contact information.

Table with 2 columns: Name and Address. Lists registered branches and their locations.

Table with 2 columns: Name and Address. Lists legal counsel and their firms.

Table with 2 columns: Name and Address. Lists audit firms and their offices.

四、基金名称
五、基金的类型
六、基金的投资目标
七、基金的投资范围
八、基金的投资策略

九、基金的投资策略
A. 资产配置策略
B. 债券投资策略
C. 股票投资策略

十、基金的投资策略
A. 资产配置策略
B. 债券投资策略
C. 股票投资策略

十一、基金的投资策略
A. 资产配置策略
B. 债券投资策略
C. 股票投资策略

在资产违约率差异显著、本基金借助“嘉实信用分析系统”及嘉实中央研究平台,基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究,运用定性定量模型,在自上而下的个债筛选策略基础上,采取适度分散的行业资产配置策略,从组合层面动态优化风险收益。

(3)信用风险控制措施
本基金实施严格的信用评级和市场化分析,个债和衍生品层面的分散化投资策略,当发债企业的基本面情况出现恶化时,运用“尽早出售(first sale, best sale)”策略,控制投资风险。

本基金采用信用级别持仓量、行业分散度、组合持仓分布、各项重要债信指标等指标,实时监控组合信用风险暴露。
(4)债券策略
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。当债券收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的位置,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将缩短,债券的到期收益率水平将会较投资初期有所下降,对应的就是债券价格的走高,而这一期间债券的涨幅将高于其他期间,这样就可以获得丰厚的价差收益即资本利得收入。

5. 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债券投资明细
6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
8. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 投资组合报告附注
(2) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形
(3) 其他资产构成

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

11. 投资组合报告附注
(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形
(2) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

(3) 其他资产构成
(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

Table with 2 columns: Name and Amount. Lists assets and their values.

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

十二、基金费用与税收
(一)与基金运作有关的费用
1. 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)基金的销售服务费;
(4)其他与基金运作有关的费用

2. 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
本基金管理人计提的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.8%/当年天数

(二)与基金销售有关的费用
1. 申购费用
本基金A类基金份额申购费率为0.0%,B类基金份额申购费率为0.35%。
2. 赎回费用
本基金A类基金份额赎回费率为0.0%,B类基金份额赎回费率为0.35%。

十三、基金资产净值
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核

十四、基金资产净值的披露
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核

十五、基金资产净值的披露
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核

十六、基金资产净值的披露
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核

十七、基金资产净值的披露
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核

十八、基金资产净值的披露
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核

十九、基金资产净值的披露
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核

二十、基金资产净值的披露
(一)基金资产净值的披露
(二)基金资产净值的复核