

### (上接 D6版)

#### 十一、基金份额的投资

##### 1.投资目标

本基金在严格控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。

##### 2.投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准注册上市的公司股票和存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的短期、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债(含证券公司发行的短期公司债券)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会认可的金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务。

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

本基金的投资比例为:本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例为基金资产的60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过资产净值的0%-50%)。

本基金每个交易日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴存的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。前述现金不包括结存资产,存在保本基金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

##### 3.投资策略

##### (一)资产配置

本基金通过定性及定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票、债券和现金大类资产的配置比例。

本基金通过跟踪预期海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过宏观层面上上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险收益特征进行预判。根据上述定性和定量指标的分析和判断,运用资产配置化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产配置权重,实现资产配置优化配置。

##### (二)股票投资策略

本基金利用基金管理人投研团队的资源,对企业内在价值进行深入细致的分析,并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好的上市公司股票(含存托凭证)进行投资。

##### 1.个股选择

基金管理人的股票研究员将深入上市公司,公司竞争对手以及产业链上下游,挑选出优质的上市公司股票作为投资标的。对于个股是否纳入投资组合,基金管理人会重点关注3个方面:公司质地、公司的成长空间和未来盈利增长、目前估值水平。其次公司素质是基金管理人最看重的因素,包括商业模式、独特的护城河、竞争优势、行业地位、公司治理的严格和规范等方面,同时本基金还会密切关注上市公司可持续发展能力,从环境、社会、公司治理三个方面对上市公司进行评价。对于具有优秀基因的上市公司,如果公司成长和股票估值相匹配,基金管理人将会纳入本基金投资组合,否则将会将其从股票池中剔除。

##### 2.港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金重点关注:

- (1)具有持续领先优势或核心竞争力的企业,这类企业应具有良好成长性或市场龙头;
- (2)符合内地宏观经济和产业发展的个股;
- (3)与股票类资产配置策略相匹配的个股;
- (4)具有估值优势的股票。

本基金投资于存托凭证的策略按照上述与境内交易的投资策略贯彻执行。

(三)可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的投资策略

本基金将主动管理可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券有两种途径:一级市场申购或二级市场参与。一级市场申购,主要考虑发行条款较好、可交换或较高、公司基本素质优秀的个券。二级市场参与可采用多种投资策略,本基金将运用企业基本面分析和相对估值分析策略,精选个股,力争实现投资的高收益;同时,本基金也可以采用相对价值分析策略,通过定价不同市场环境下可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券转股性估值进行估值,把握其交易价差,选择相应标的,力争获取超额投资收益。另外,本基金将密切关注可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的转权利机会和余款券机会。

(四)其他固定收益类证券投资品种

本基金的其他固定收益类证券投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的,具有良好流动性的金融工具。固定收益类资产主要用于提高非股票资产的收益率,基金管理人将坚持价值投资的理念,严格控制风险,追求合理的预期收益。

在债券投资方面,基金管理人将以宏观形势和利率分析为基础,依据国家经济发展规划优化核心券券种跟踪指标和辅助参考指标,结合宏观经济、财政政策的实施情况,以及国际金融市场基准利率水平及变化情况,预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,进行定价操作。

##### (五)资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率等方面考虑,采用自下而上的逐项精选策略,以资产支持证券的资产高级次级为投资标的,精选违约风险可控、收益匹配风险等级资产支持证券项目。对不同资产支持证券的基础资产采取逐笔分级的地配置策略和行权配置策略,在有效分散风险的前提下为投资者谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法,以基金管理人内部信用评级为参考,并结合外部信用评级机构的分析报告,最终得出资产支持证券的信用评级。另外,鉴于资产支持证券流动性较差,本基金更倾向于购入期限较短的品种。

##### (六)股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理原则,以套期保值为目的,以规避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的近期货合约,并与股票资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作。

##### (七)国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理原则,以套期保值为目的,以规避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的近期货合约,并与债券资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作。

##### (八)股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要的,参与股票期权的投资。本基金将在有效分散风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的近期货合约进行投资。

##### (九)衍生品投资品种策略

本基金将根据风险管理的原则,以风险对冲为目的与进行衍生品交易。本基金将根据所持标的券种等不同基金品种的投资策略,审慎开展衍生品交易,谨慎使用衍生品种的投资金额、期限等。同时,本基金增加衍生品投资使用衍生品交易手段,确立衍生品投资的投资策略,合理分散交易对手、创设标的中管理,对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。

##### (十)参与融资融券业务策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资融券交易。本基金将基于对市场行情和个股风险和收益的充分分析,通过证券经纪,标的证券及投资比例。若相关融资融券法律法规和监管要求发生变化,本基金将从其最新规定,以符合法律法规和监管要求的变化。

##### 四、风险控制

##### (一)投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例为基金资产的60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过资产净值的0%-50%)；

(2)本基金每个交易日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;前述现金不包括结存资产、存托凭证、应收申购款等；

(3)本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不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；

(4)本基金持有一家公司发行的证券,其市值(含同一公司在内地和香港同时上市的A+H股)合计不得超过本基金资产净值的10%；

(5)本基金管理人管理的本基金组合持有一家公司发行的证券(含同一公司在内地和香港同时上市的A+H股)合计,不得超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的本基金组合可不受此条规定的比例限制；

(6)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括旗下基金)投资于开放式的同一开放基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%。完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(7)本基金投资于同一原权利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%；

(8)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%；

(9)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%；

(10)本基金管理人管理的每一投资组合投资于同一原权利人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券市值净值的10%；

(11)本基金投资于信用评级为BBB(以中债评级)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；

(12)本基金参与股指期货,不得超过基金净值的140%；

(13)本基金参与股指期货和国债期货交易的,应当遵守下列规定:

1)基金在任一交易日终,持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%,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)基金在任一交易日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%,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)基金在任一交易日终,持有的买入(不包括平仓)的股指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20%,持有的买入(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15%；

4)基金在任一交易日终,持有的买入国债期货合约价值与有价证券市值之和,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政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。

(14)基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(含轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(15)基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(含轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(16)本基金参与股指期货交易的,应当遵守下列规定:

1)基金在任何交易日终,股指期货合约和国债期货合约价值不得超过基金资产净值的10%；

2)基金在任何交易日终,持有的买入股指期货合约和国债期货合约价值,应当符合有关法律、法规和证券交易所规定的比例限制；

3)持仓合约的履约保证金不得超过基金资产净值的20%,其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(17)本基金不得持有信用保护卖方的信用衍生品,基金持有合约类信用衍生品,持有的信用衍生品的名义本金不得超过基金为应对该衍生品合约而准备现金的100%；

(18)本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的10%；

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之外的因素致使基金不符合前述(15)、(16)所规定比例限制的,基金管理人应当在3个月之内进行调整；

(19)本基金参与融资融券业务应符合中国证监会认定的其他证券交易所开展融资融券的条件,可不受融资融券比例限制的约束,但不得超过中国证监会认定的比例限制；

(20)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%,因证券市场波动、上市公司停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(21)参与融资融券业务后,在任何交易日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%；

(22)本基金投资于存托凭证的比例限制按照境内上市交易的股票执行；

(23)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。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则在履行适当程序后,本基金投资不受相关限制或按照调整后的规定执行。基金管理人及时根据中国证监会规定在定期报告公布。

除(2)、(11)、(15)、(16)、(17)、(18)条外,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之外的因素致使基金不符合下列各投资组合比例限制的,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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督核查自基金合同生效之日起开始。

##### (二)禁止行为

为保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活动:

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5、向其他基金管理人、基金托管人出借；

- 6、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；
- 7、法律、行政法规及中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,本基金可不受上述限制的限制或予以调整后的规定为准。

##### (三)关联交易原则

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易事项,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和授权机制,按照市场公平合理价格执行。重大关联交易必须事先得到基金托管人同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易必须提交基金管理人董事会审议,并应当经三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会至少应有半数非关联董事出席审议通过。

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按照调整后的规定执行。

##### 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*90%+恒生指数收益率(经汇率净值调整)\*20%+中国债券综合指数收益率\*20%。

其中,沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所编制,由中国证监会认可的沪深两市沪深300指数,它的基本样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场整体发展趋势。

恒生指数是恒生指数有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,旨在反映股市的综合走势。恒生指数也是反映香港股票市场趋势最有影响的一股价格指数。

中国债券指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数,它是中国债券市场走势的表征,也是债券组合投资管理业绩评价的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场总体动态、波动幅度和变动趋势,测算债券投资回报率水平,判断债券供求动向提供了好帮手。

综上所述,本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*90%+恒生指数收益率(经汇率净值调整)\*20%+中国债券综合指数收益率\*20%。前两项指标能较好地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、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投资品种的权威指数,基金管理人将根据与托管人协商一致原则,与基金托管人协商一致,在履行适当程序后,本基金业绩比较基准将在履行适当程序后予以变更,无需召开基金份额持有人大会。

##### 六、风险收益特征

本基金是一只混合基金,其预期风险与预期收益高于纯债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

本基金除了投资A股外,还可能根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需承担境内市场投资权益类品种的波动风险外,本基金还面临跨境投资机制下因投资环境、投资标的、市场制度及与交易规则等差异带来的特有风险。

本基金管理人代表基金份额持有人权利的处理原则及方法

1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益；

##### 2.不谋求对上市公司的控股；

3.持有基金份额的股东之间,除非法律、法规另有规定,基金份额持有人之间不享有相互关联关系；

4.受托机构为基金份额持有人聘请、授权代理人或任何存在利害关系的人单独行使任何不利益。

八、侧袋机制的实施规则和运作安排

当本基金特定资产占净值或存在大额赎回申请时,综合考虑资产变现的流动性、特定资产的估值公允性、资产的风险溢价等因素,根据最大限度减少基金份额持有人利益的原则,基金管理人将与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间,本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合指标、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的资产事项,实施程序、运作安排、投资安排、特定资产处置进展和支付等对投资者权益产生重大影响的事项将详见招募说明书的规定。

##### 第七部分 基金财产

##### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息和基金应收申购款及其他资产的价值总和。

##### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

##### 三、基金财产的账户

本基金财产由基金管理人按照相关法律法规、规范性文件开立基金财产账户,证券账户及投资所需的其他专用账户。开立的基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自身的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

##### 四、基金资产的保管和处分

本基金财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各自的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和基金合同约定的处分外,基金财产不得被查封。

基金管理人、基金托管人、基金登记机构、被冻结或被依法宣告破产等原因进行清算,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,不得与其自有资产产生的债务相互抵消。基金管理人管理运用基金财产所产生的债权债务不得与其固有资产,非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

##### 第十四部分 基金费用

##### 一、估值日

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日子。

##### 二、估值对象

本基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、股指期货合约、股指期货合约、国债期货合约、信用衍生品和银行理财产品、应收款项、其它投资等资产和负债。

##### 三、估值原则

基金管理人 在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

(1)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债的市场价格的,在估值日有报价的,除会计准则规定的不适用公允价值外,应采用公允价值或报价确定的公允价值;估值日无报价且最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值,有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中选择不同特征的因素,特定估值技术处理或估值模型的应用,如果该情形是针对资产持有者,那么应同时考虑市场参与者对该资产或负债估值时可能存在的重大变化,不应忽视其重大变化对资产或负债公允价值的影响。

(2)已上市但未挂牌转让的,应采用在估值前下适用并且与足够可利可和和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得可靠公允价值或可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应对估值进行调整确定公允价值。

##### 四、估值方法

1、上市或挂牌转让的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票等),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,证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;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及重大变化因素,调整最近交易日的市价,确定公允价值;

(2)已上市或未挂牌转让的,且不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值;有足够可利可和和其他信息支持的,应采用估值技术确定其公允价值。

(3)已上市交易但未挂牌转让的含权固定收益品种(另有规定的除外),选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种的当日公允价值进行估值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

(4)对交易所上市交易的公开发行的可转债或可分离交易的可转债,实行交易交易的,按照公允价值估值;收盘价为空时,按照公允价值估值;收盘价为空时,按照公允价值估值;收盘价为空时,按照公允价值估值。

(5)对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值;有足够可利可和和其他信息支持的,应采用估值技术确定其公允价值。

(6)对于发行未上市或未挂牌转让的有价证券,按照公允价值估值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

2、处于上市或未挂牌转让期间的有价证券按以下情况进行处理:

(1)逆回购,按照成本和开账日的最新价格,按照公允价值估值;非交易所的同一股票,按照公允价值估值;该无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值;

(3)对在发行期间,但前期限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票认购未交割股份,通过大宗交易取得的前限售期的股票等,不包括停牌、新发行上市、回购交易的尚未上市前限售期股票,按照监管机构或行业协会有关规定确定公允价值;

(4)对未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值;有足够可利可和和其他信息支持的,应采用估值技术确定其公允价值。

3、对于发行未上市或未挂牌转让的有价证券,按照公允价值估值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

(1)逆回购,按照成本和开账日的最新价格,按照公允价值估值;非交易所的同一股票,按照公允价值估值;该无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值;

(3)对在发行期间,但前期限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票认购未交割股份,通过大宗交易取得的前限售期的股票等,不包括停牌、新发行上市、回购交易的尚未上市前限售期股票,按照监管机构或行业协会有关规定确定公允价值;

(4)对未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值;有足够可利可和和其他信息支持的,应采用估值技术确定其公允价值。

4、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

5、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

6、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

7、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

8、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

9、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

10、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

11、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

12、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

13、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

14、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

15、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

16、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

17、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

18、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

19、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

20、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

21、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

22、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

23、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

24、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

25、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

26、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

27、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

28、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

29、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

30、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

31、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

32、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

33、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

34、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

35、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。

36、股指期货合约,按照估值技术确定公允价值;未挂牌转让的固定收益品种,按照公允价值估值。