# 友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金

## 更新的招募说明书(摘要)

2008年第2号

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由友邦华泰中短期债券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2007年11月28日证监基金字[2007]323号文(《关于核准友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》)核准的友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会决议,友邦华泰中短期债券投资基金调整投资目标、范围和策略、修订基金合同,并更名为“友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金”。自2007年12月3日起,由《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》生效。

### 重要提示

友邦华泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为2008年12月2日,有关财务和业绩表现数据截止日为2008年9月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人招商银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书进行了复核确认。

### 一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:友邦华泰基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦40楼
设立日期:2004年11月18日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]178号
法定代表人:齐亮
办公地址:上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层
电话:400-888-0001,021-38784638,021-38601777
联系人:杨晓华
注册资本:贰亿元人民币
经营范围:基金管理业务;发起设立基金;中国证监会批准的其他业务
组织形式:有限责任公司
存续期间:持续经营
股权结构:AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

齐亮先生:董事长,硕士,1994-1998年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长,1998-2001年任中央财经领导小组办公室副局长,2001年至2004年任华泰证券有限责任公司副总裁。

魏欧林(Olin Wethington)先生:董事,博士,曾在美国商务部和财政部任职多年,2006年3月至今担任美国国际集团(AIG)中国成员公司主席。

吴祖芳先生:董事,硕士,1992年起至今历任华泰证券有限责任公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

陈国杰先生:董事,学士,曾任怡富投资管理有限公司董事,1999年加入美国国际集团(AIG),先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理集团资深副总裁兼区域总监(亚洲),美国国际集团(亚洲)投资有限公司执行董事等职。

徐耀华先生:独立董事,硕士,1994-2000年任香港联合交易所有限公司执行总监、行政总裁,1997年至今担任香港证券专业学会主席,2006年至今任香港华高和昇财务顾问有限公司主席。

林征女士:独立董事,硕士,1983-1992年任全国人大法工委副处长,1999-2001年任华夏证券有限责任公司副总经理,2001年至今任天相投资顾问有限公司副总经理。

王学林先生,独立董事,学士,1987-1988年任上海市对外经济贸易委员会主任科员,1988-1999年任上海市外国投资工作委员会副处级调研员,1999-2003年任上海市国际贸易促进委员会副处级调研员。

2、监事会成员

黄宁宁先生:监事长,硕士,1997-2001年任国浩律师集团(上海)事务所律师,2001-2007年任上海中汇律师事务所律师、合伙人,2007年至今任美国国际集团中国成员公司副总裁、法律顾问。

王桂芳女士:监事,硕士,1993-1995年任上海大陆期货公司交易部、市场部经理,1995-1996年任江苏东华期货公司上海业务部副总经理,1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理,2003-2006年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理,2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生:监事,硕士,2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务,2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员,2004年至今任友邦华泰基金管理有限公司基金事务部总监。

3、总经理及其他高级管理人员

陈国杰先生:总经理,学士,曾任怡富投资管理有限公司董事,1999年加入美国国际集团(AIG),先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理集团资深副总裁兼区域总监(亚洲),美国国际集团(亚洲)投资有限公司执行董事等职,并自友邦华泰基金管理有限公司成立至今任公司董事。

王溯舸先生:副总经理,硕士,1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理,2001-2004年任华泰证券有限责任公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士:督察长,硕士,1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表,1999-2004年任华泰证券有限责任公司北京总部总经理。

房伟力先生:副总经理,硕士,1997-2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理,2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008年5月任友邦华泰基金管理有限公司总经理助理。

刘宏友先生:副总经理,硕士,1992-2004年历任华泰证券有限责任公司部门副总经理、总经理,2004-2006年任华夏基金管理有限公司上海营销总部副总经理。2006-2008年5月任友邦华泰基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

沈涛先生,经济学博士。16年证券投资从业经历。曾任易方达基金管理有限公司月月收益中短期债券投资基金基金经理。2007年11月加入友邦华泰基金管理有限公司。

历任本基金基金经理:

汪晖先生,自本基金成立至2008年3月4日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

主席:总经理陈国杰先生;

成员:副总经理王溯舸先生;研究部总监张净女士;投资部总监梁丰先生;基金经理汪晖先生;基金经理秦岭松先生;基金经理沈涛先生。

列席人员:督察长陈晖女士;投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜;
2、办理基金备案手续;
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6、编制季度、半年度和年度基金报告;
7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9、召集基金份额持有人大会;
10、基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12、中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:
(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:
(1)越权或违规经营;
(2)违反基金合同或托管协议;
(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;
(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6)玩忽职守、滥用职权;
(7)违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(8)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(9)贬损同行,以抬高自己;
(10)以不正当手段谋求业务发展;
(11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
(13)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺
(1)依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2)不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;
(3)不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(4)不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五)基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则
(1)健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位,并渗透到各项业务过程,涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;
(2)有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行;
(3)独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位,各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门;
(4)相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡,消除内部控制中的盲点;
(5)防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离,基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位,应当在物理上和制度上适当隔离,以达到风险防范的目的;
(6)成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的主要内容

(1)控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会,全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控,审查公司的内控制度,并对重大关联交易进行审计;董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会,对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格,制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下,认真执行董事会确定的内部控制战略,为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略,设立了投资决策委员会和风险控制委员会,就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长,对董事会负责,主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查,发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

(2)风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况,范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素,评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性,并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

(3)控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础,是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度,在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任,使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用,建立内部控制的第三道防线。

(4)信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道,保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,并及时送达适当的人员进行处理。

(5)内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部,其中监察稽核人员履行内部稽核职能,检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司内部控制制度的执行情况,揭示公司内部管理及基金运作中的风险,及时提出改进意见,促进公司内部管理制度有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明
(1)基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;
(2)本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;
(3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

### 二、基金托管人

(一)基金托管人概况
1、基本情况
名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:147.03亿元
法定代表人:秦晓
行长:马蔚华
资产托管业务批准文号:中国证监会证监基字【2002】83号
电话:0755—83199084
传真:0755—83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截止2008年9月30日,招商银行总资产1.547万亿元人民币,核心资本净额730.24亿元人民币。

(二)主要人员情况

秦晓先生,英国剑桥大学经济学博士,高级经济师。第十一届全国政协委员,招商局集团有限公司董事长,招商银行董事长、非执行董事,清华大学管理学院和中国人民银行研究生部兼职教授。曾任中国国际信托投资公司总经理、副董事长,中信实业银行董事长,国家外汇管理局外汇政策顾问,国际商会中国国家委员会副主席,亚太经济合作组织工商咨询理事会(ABAC)2001年主席,第九届全国人大代表,第十届全国政协委员。

马蔚华先生,经济学博士,高级经济师。第十一届全国政协委员。招商银行执行董事、行长兼首席执行官。兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招商基金管理有限公司董事长,招商局集团有限公司董事、TOM在线有限公司独立董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会副会长、深圳市国内银行同业公会会长、深圳上市公司协会会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、南京大学、吉林大学、西南财经大学等十多所高校兼职教授等职。曾任中国人民银行办公厅副主任,中国人民银行计划资金司副司长,中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长。曾任第十届全国人大代表。曾经获评"2001-CCTV中国经济年度人物"、"2005-CCTV中国经济年度人物"、英国《银行家》杂志(The Banker)"2004年度银行业希望之星"(Rising Stars of Banking)。

张光华先生,招商银行执行董事、副行长。1957年3月出生,1983年吉林大学经济系本科毕业,1986年获吉林大学经济学硕士学位,2000年获西南财经大学经济学博士学位,高级经济师。同时担任中国金融学会常务理事,广东金融学会副会长,广东商业联合会副会长。1986年7月至1992年10月任国家外汇管理局政研室副主任、计划处处长,1992年10月至1994年6月任中国人民银行海南省分行行长助理,1994年6月至1998年11月任中国人民银行海南省分行副行长兼国家外汇管理局海南分局副局长,1998年11月至2002年9月,任中国人民银行广州分行副行长,2002年9月至2007年4月任广东发展银行行长。2007年7月起兼任招银国际金融有限公司副董事长。

夏博辉先生,男,1963年11月出生,湖南人,管理学博士(厦门大学),教授,注册会计师。现任招商银行资产托管部总经理,财政部会计准则咨询专家、金融会计组负责人,中国会计学会理事、中国金融会计学会专家委员会委员。1992-1999年历任湖南财经学院会计系副主任、科研处副处长、科研研究生处长、科研处长及讲师、副教授、教授,2000-2005年6月历任深圳发展银行会计出纳部总经理、财务会计部总经理、计划财会部总经理、财务执行总监等职;2005年7月,加盟招商银行。1993-1996年,受聘担任世界银行技术援助中国人民银行会计改革体系项目金融会计准则研究组中方工作组组长。曾获“全国优秀教师并授予全国优秀教师奖章”(1993)、湖南省普通高校优秀教学成果一等奖(1993)、湖南省第五届优秀社会科学成果(著作)二等奖(1999)、中国青年科技论坛二等奖(1999)。

胡家伟先生,大学本科学历,现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历,已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长,中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

(三)基金托管业务经营情况

截至2008年11月30日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金),招商现金增值证券投资基金、中信经典配置证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金及其它托管资产,托管资产为1593.83亿元人民币。

(四)托管人的内部控制制度

内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整;建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制,重大事项的决策经行长办公会讨论决定,行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时,必须遵循内控制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下,独立于部门内其他业务室和托管分部,对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

内部控制原则

(1)全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位,并由全部人员参与。

(2)审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险,托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点,应当体现“内控优先”的要求。

(3)独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门,稽核监察室应保持高度的独立性和权威性,负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4)有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章,具有高度的权威性,成为所有员工严格遵守的行动指南;执行内部控制制度不能存在任何例外,部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

(5)适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6)防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门,应当在制度上和人员上适当分离,办公网和业务网分离,部门业务网和全行业务网分离,以达到风险防范的目的。

内部控制措施

(1)完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度,从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作,切实维护托管业务各当事人的利益,避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理,招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》,并建立了灾难备份中心,各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份,确保灾难发生时,托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2)经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程,有效地控制业务运作过程中的风险

(3)业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄漏,有关人员如需调用,须经总经理室审批,并做好调用登记。

(4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料,视同会计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并做好调用登记。

(5)信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护等,保证信息技术系统的安全。

(6)人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源控制。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定,应及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人限期改正,如基金管理人未能在通知期限内纠正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

1、直销机构
友邦华泰基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦40楼
法定代表人:齐亮
办公地址:上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层
电话:400-888-0001,(021)38784638,(021) 38601777
传真:(021)50103016
联系人:沈炜
公司网址:www.aig-huatai.com

2、代销机构
1)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195049
联系人:万丽
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com
2)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
传真:(010)66594853
客服电话:95566
公司网址:www.boc.cn
3)中国工商银行股份有限公司
注册地址:中国北京复兴门内大街55号
办公地址:中国北京复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
传真:(010)66107914
联系人:田耕
客服电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn
4)中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:刘安东
电话:(010)66599805
传真:(010)66415194
联系人:陈春林
客服电话:11185
公司网址:www.psbc.com
5)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市仙霞路18号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹榕
客服电话:95559
公司网址:ww.bankcomm.com
6)深圳发展银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼
电话:(0755)22166316
传真:(0755)82080714
联系人:姜聃
客服电话:95501
公司网址:www.sdb.com.cn
7)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:孔丹
电话:(010)65557062
传真:(010)65550827
客服电话:95558
公司网址:bank.ecitic.com
8)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:(010)58351666
传真:(010)83914283
联系人:李群
客服电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn
9)北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
电话:(010)66223236
传真:(010)66223314
联系人:王光伟
客服电话:(010)96169(北京)、(022)96269(天津)、(021)53599688(上海)、(029)85766888(西安)
公司网址:www.bankofbeijing.com.cn
10)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)84457777
传真:(025)84579763
联系人:樊昊
客服电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn
11)联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马昭明
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
联系人:盛宗凌
客服电话:400-888-8555,(0755)25125666
公司网址:www.lhzq.com
12)信泰证券有限责任公司
注册地址:南京市长江路88号
办公地址:南京市长江路88号
法定代表人:钱凯法
电话:(025)84784782
传真:(025)84784830
联系人:舒萌菲
客服电话:400-888-8918
公司网址:www.thope.com
13)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
办公地址: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:肖时庆
电话:(010)66568587
传真:(010)66568536
联系人:李洋
客服电话:(010)4008-888-888
公司网址:www.chinastock.com.cn
14)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:祝幼一
电话:(021)38676666
传真:(021)38670666
联系人:芮敏祺
客服电话:400-888-8666
公司网址:www.gtja.com
15)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:(021)54033888
传真:(021)54038844
联系人:王序微
客服电话:(021)962505
公司网址:www.sw2000.com.cn
16)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦10楼
法定代表人:王开国
电话:(021)63410340
传真:(021)63410456
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:400-888-8001,(021)95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.htsec.com
17)中信证券股份有限公司
注册地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:王东明
电话:(010)84588888
传真:(010)84865560
联系人:陈忠
客服电话:95558
公司网址:www.cs.ecitic.com
18)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
电话:(010)85130577
传真:(010)65182261
联系人:权唐
客服电话:400-888-8108,(010)65186758
公司网址:www.csc108.com
19)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87555305
联系人:肖中梅
客服电话:(020)961133
公司网址:www.gf.com.cn
20)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国信证券大厦
法定代表人:何如
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133302
联系人:齐晓燕
客服电话:800-810-8868
公司网址:www.guosen.com.cn
21)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943636
联系人:黄健
客服电话:95565、400-888-8111
公司网址:www.newone.com.cn
22)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨
电话:(021)68816000
传真:(021)68815009
客户服务电话:400-888-8788、10108998
公司网址:www.ebscn.com
23)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼21-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21-29层
法定代表人:王益民
电话:(021)63325888
传真:(021)63327888
联系人:吴宇
客服电话:95503
公司网址:www.dfzq.com.cn
24)兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海市浦东陆家嘴东路166号中保大厦19楼
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419867
联系人:杨盛芳
客服电话:400-8888-123
公司网址:www.xyzq.com.cn
25)长江证券股份有限公司
注册地址:湖北武汉新华路特8号
办公地址:湖北武汉新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
电话:(027)65799999
传真:(027)85481900
联系人:李良
客服电话:400-800-8999
公司网址:www.95579.com
26)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
电话:(0431)85096709
传真:(0431)85680032
联系人:潘锴
客服电话:(0431)96688-0、(0431)85096733
公司网址:www.nesc.cn
27)财通证券经纪有限责任公司
注册地址:杭州市解放路111号
办公地址:杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人:沈继宁
联系人:乔骏
电话:(0571) 87925129
传真:(0571) 87925129
客服电话:(0571)96336、上海地区962336
公司网址:www.ctsec.com
28)山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯巍
电话:(0351) 8686703
传真:(0351) 8686619
联系人:张治国
客服电话:400-666-1618
公司网址:www.i618.com.cn
29)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市八卦三路平安大厦三楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼8楼
法定代表人:陈敬达
电话:(0755)22627802
传真:(0755)82433794
联系人:袁月
客服电话:95511
公司网址:www.pa18.com
30)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心20层
法定代表人:牛冠兴
电话:(0755)82825555
传真:(0755)23982898
联系人:余江
客服电话:(020)96210
公司网址:www.essences.com.cn
31)南京证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市大钟亭8号
办公地址:江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人:张华东
电话:(025)83367888-4101
传真:(025)83320066
联系人:胥春阳
客服电话:400-828-5888
公司网址:www.njzq.com.cn
32)上海证券有限责任公司
注册地址:西藏中路336号华旭大厦6楼
办公地址:西藏中路336号华旭大厦6楼
法定代表人:蒋元真
电话:(021)53519888*6024
传真:(021)33303378
联系人:谢秀峰
客服电话:(021)962518
公司网址:www.962518.com
33)中原证券股份有限公司
注册地址:许昌市南关大街38号
办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸大厦10楼
法定代表人:石保上
电话:(0371)65585670
传真:(0371)65585670
联系人:程月艳
客服电话:(0371)967218
公司网址:www.ccnew.com
34)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼
办公地址:上海市浦东区东方路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
电话:(021)50586660-8966
传真:(021)50586660-8880
联系人:李涛
客服电话:(021)52574550、(0519)88166222、(0379)64902266、免费服务热线:400-888-8588
公司网址:www.longone.com.cn
35)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
办公地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
电话:(0531)81283728
传真:(0531)81283735
联系人:吴阳
客服电话:95538
公司网址:www.qlzq.com.cn
36)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层
办公地址:北京市东东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人:王少华
电话:(010) 84183389
传真:(010) 64482090
联系人:黄静
客服电话:800-810-8809
公司网址:www.guodu.com
37)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510)
办公地址:青岛市市南区东海西路28号
法定代表人:史洁民
电话:(0532)85022026
传真:(0532)85022511
联系人:丁韶燕
客服电话:(0532)96577
公司网址:www.zxwt.com.cn
38)中信金通证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:(0571)85783715
传真:(0571)85783771
联系人:王勤
客服电话:(0571)96598
公司网址:www.bigsun.com.cn
39)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法定代表人:李舫金
电话:(020)37865031
传真:(020)37865008
联系人:刘广
客服电话:400-888-8133
公司网址:www.wlzq.com.cn
40)财富证券有限责任公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人:周晖
电话:(0731)4403319
传真:(0731)4403439
联系人:郭磊
客服电话:(0731)4403319
公司网址:www.cfzq.com
41)湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海市陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼
法定代表人:陈学荣
电话:(021)68634518
传真:(021)68865938
联系人:钟康莺
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com
42)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:(0755)83516289
传真:(0755)83516199
联系人:匡婷
客服电话:(0755)33680000、400-6666-888
公司网址:www.cc168.com.cn
43)东吴证券有限责任公司
注册地址:江苏省苏州市石路爱河桥28号
办公地址:江苏省苏州市石路爱河桥26号
法定代表人:吴永敏
电话:(0512) 65581136
传真:(0512) 65588021
联系人:方晓丹
客服电话:(0512)96288
公司网址:www.dwjq.com.cn
44)国联证券股份有限公司:
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
电话:(0510) 82831662
传真:(0510) 82830162
联系人:袁丽萍
客服电话:(0510)82588168
公司网址:www.glsc.com.cn
45)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:方加春
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
联系人:罗芳
客服电话:400-888-8128
公司网址:www.tebon.com.cn
46)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法定代表人:汤世生
电话:(010)62294608
传真:(010)62296854
联系人:李茂俊
客服电话:(010)62294600
公司网址:www.hysec.com
47)江南证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
办公地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:姚江涛
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
联系人:余雅娜
客服电话:(0791)6794724
公司网址:www.scstock.com
48)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:唐新宇
电话:(021)68604866
传真:(021)50372474
联系人:张静
客服电话:(021)68604866
公司网址:www.bocichina.com
49)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:张志军
电话:(022)28451861
传真:(022)28451892
联系人:王兆权
客服电话:400-651-5988
公司网址:www.bhzq.com.cn
50)国元证券股份有限公司
注册地址:合肥市寿春路179号
办公地址:合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
电话:(0551) 2207939
传真:(0551)2645709
联系人:李蔡
客服电话:(0551)96888
公司网址:www.gyzq.com..cn
51)方正证券有限责任公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
电话:(0571)87782047
传真:(0571)87782011
联系人:邢铁英
客服电话:95571
公司网址:www.foundersc.com
52)第一创业证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
电话:(0755)25832848
传真:(0755)25831718
联系人:徐菁
客服电话:(0755)25832583
公司网址:www.firstcapital.com.cn
53)恒泰证券有限责任公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
办公地址:上海市浦东新区松林路357号19楼
法定代表人:刘汝军
电话:(021) 68405273
传真:(021) 68405181
联系人:张同亮
客服电话:(0471)4961259
公司网址:www.cnht.com.cn
54)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:管荣升
电话:(0791)6285337
传真:(0791)6289395
联系人:徐美云
客服电话:(0791)6285337
公司网址:www.gsstock.com
55)华西证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼(深圳总部)
法定代表人:胡关金
电话:(028)86159166
传真:(028)86150165
联系人:王京红
客服电话:400-888-8818
公司网址:www.hx168.com.cn

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构
1、A类基金份额
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:(010)58598835
传真:(010)58598834
联系人:任瑞新
2、B类基金份额
名称:友邦华泰基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦40楼
法定代表人:齐亮
办公地址:上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层
电话:(021)38601777
传真:(021)38601799
联系人:陈培

(三)律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
负责人:韩炯
电话:(021)68818100
传真:(021)68816880
经办律师:秦悦民、傅轶

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:单峰
经办注册会计师:汪棣、单峰

### 四、基金的名称

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金

### 五 基金的历史沿革

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金由友邦华泰中短期债券投资基金转型而成。

友邦华泰中短期债券投资基金经中国证监会2006年3月8日证监基金字[2006]37号文批准,并自2006年3月15日起公开募集。截止到2006年4月7日,基金募集工作顺利结束,募集有效认购总户数为25,981户;募集的净认购金额为5,652,942,702.72元人民币,折合基金份额5,652,942,702.72份;认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计1,358,932.48元人民币,折合基金份额1,358,932.48份归基金份额持有人所有;合计折合基金份额5,654,301,635.20份。友邦华泰基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2006年4月13日获书面确认,友邦华泰中短期债券投资基金基金合同自该日起正式生效。

2007年10月12日,友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会讨论通过了友邦华泰中短期债券投资基金调整投资目标、投资范围和投资策略以及修订基金合同等内容。依据中国证监会2007年11月28日证监基金字[2007]323号文(《关于核准友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》)核准,持有人大会决议生效。依据持有人大会决议,原《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》失效,《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》生效,同时基金更名为“友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金”。

### 六、基金的类型

契约型开放式

### 七、基金的投资目标

在控制本金下跌风险的前提下,充分利用资本市场各种资产定价不准确产生的投资机会,实现基金资产的持续稳定增值。

### 八、基金的投资范围

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、股票、权证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。此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资于固定收益类资产(包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、债券回购、同业存款等)的比例不低于基金资产的80%,投资于风险类资产(固定收益类资产以外的其它资产,包括股票、权证等)的比例不超过基金资产的20%。本基金可以参与一级市场新股申购,并持有因在一级市场申购所获得的股票以及因可转债转股所形成的股票,也可以直接投资于二级市场中的股票、权证等,还可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。

本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券(含政策性金融债、央行票据)不低于基金资产净值的5%,本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%。

### 九、基金的投资策略

本基金总体投资策略包括以下三个方面:

1、本基金将以固定收益类资产投资为基础,以其投资收益为保障,参照固定比例组合保险机制(CPPI)对风险类资产上限进行动态调整,以有效保障投资组合本金的安全。风险类资产的投资比例上限将根据固定比例组合保险机制的原理来进行调整,但在限度范围内风险类资产的投资比例将由基金管理人根据不同类别风险资产的最大可能损失比例来具体确定。

2、固定收益类资产投资策略

(1)在流动性许可情况下,本基金部分固定收益类资产将采取持有到期(与基金业绩基准期限相匹配)的策略,首先考虑该类资产的收益性,同时兼顾流动性。这部分投资可以保证债券组合收益的稳定性,尽可能地控制利率、收益率曲线和再投资等各种风险。

(2)积极投资策略。这部分固定收益类资产综合考虑收益性、流动性,进行主动调整,积极投资。具体策略包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券、把握市场上的无风险套利机会等,以争取获得适当的超额收益,提高组合整体收益率。

(下转封十一版)