

关于第一创业债券灵活配置 FOF1 号集合资产管理计划 投资比例的说明

上海天天基金销售有限公司：

《第一创业债券灵活配置 FOF1 号集合资产管理计划》合同约定主要投资方向为资产管理产品和现金类资产，并通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 30-80%；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-70%；商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。在实际运作中，本计划将主要采用风险预算进行资产配置，净权益风险敞口^{注1}争取不超过 20%，回撤争取控制在 3%以内，适合追求稳健收益，不愿承受高波动的投资者。

上述投资策略及控制阀值如遇市场发生重大波动，管理人有权进行相应调整。上述投资策略并不构成管理人对产品损益的承诺。



注 1：净权益风险敞口比例 = (股票多头持仓市值-股指期货空头市值-期权对应持仓合约空头市值) / 基金资产净值