

建信基金管理有限责任公司

关于建信优化配置混合型证券投资基金投资股权分置改革中权证方案的公告

根据中国证监会《关于股权分置改革中证券投资基金投资权证有关问题的通知》（证监基金字[2005]138号）以及证券交易所权证管理的相关办法，建信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）就旗下的建信优化配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）投资权证方案，公告如下：

一、投资比例限制

1、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五；

2、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

3、本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十。

中国证监会另有规定的，不受上述1、2、3项规定的比例限制。

因证券市场波动、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第2、3项及《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）或基金权证投资方案约定的投资比例的，本公司将在十个交易日内调整完毕并使之符合约定的比例。

二、投资策略

通过对权证标的证券的基本面研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

本公司将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求基金资产稳定的当期收益。

三、信息披露

本基金投资权证的信息披露遵照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同及其他有关规定进行。

在本基金季度报告、半年度报告和年度报告等定期报告中以及其招募说明书(更新)中予以公开披露本基金投资权证的有关信息。

四、风险控制

本公司依照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及中国证监会、交易所有关权证投资的规定和基金合同，建立健全包括投资决策、交易执行、风险绩效评估、监察稽核等权证投资的风险控制措施，主要包括：

1、投资授权控制。根据公司的投资决策体系，基金经理必须在授权范围内操作，超出其权限范围的须经投资决策委员会批准后才能执行。

2、研究决策支持。权证投资应采用定性与定量相结合的研究方法，比照公司关于股票的研究方法和制度流程，以深入准确的研究为权证投资决策提供支持。

3、交易风险控制。集中交易室对基金经理下达的投资指令进行复核，若遇和有关法律法規及公司投资管理制度相违背情况时，立即向公司有关领导和监察稽核部报告。

4、风险和绩效评估控制。风险管理部定期对权证投资绩效和风险情况进行分析、评估，对发现的问题和风险点及时进行报告反馈。

5、监察稽核与合规风险控制。公司监察稽核部对权证投资管理过程的合规性进行检查、监督。

五、风险提示

权证属于金融衍生品，具有高风险、高收益、高杠杆的特点，风险相对较大，本基金管理人

将本着谨慎和控制风险的原则进行权证投资，但基金份额持有人仍应特别关注本基金由于投资权证可能导致的净值波动风险。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司

二〇〇七年三月十三日