(上接D6版)

网址:www.gzs.com.cn

(11)金元证券股份有限公司
住所:广东省深圳市深南大道4001号时代金融中心3层
办公地址:广东省深圳市深南大道4001号时代金融中心3层
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025695
传真:0755-83025625
联系人:金春
客户服务电话:400-8888-228
网址:www.jyzq.cn

(12)齐鲁证券有限公司
住所:济南市经十路20518号
办公地址:济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
联系人:吴阳
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

(13)山西证券股份有限公司
住所: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
客户服务电话:400-666-1618
网址:www.i618.com.cn

(14)中航证券有限公司
住所: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:杜航
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
联系人:余雅娜
客户服务电话:400-8866-567
网址:www.scstock.com

(15)华安证券有限责任公司
住所:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座
法定代表人:李工
电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
联系人:甘霖
客户服务电话:96518、400-80-96518
网址:www.hazq.com

(16)华宝证券有限责任公司
住所:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
电话:021-50122222
传真:021-50122200
联系人:楼斯佳
客户服务电话:4008209898
网址:www.cnhbstock.com

(17)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
办公地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人:张志刚
电话:010-88656100
传真:010-88656290
联系人:唐静
客户服务电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

(18)中国国际金融有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座6层
法定代表人:李剑阁
电话:010-65053695
传真:010-65058065
联系人:罗春蓉
客户服务电话:010-65051166
网址:www.cicc.com.cn

(19)东兴证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12层
法定代表人:崔海涛
电话:010-66555835
传真:010-66555246
联系人:黄英
客户服务电话:4008-888-993
网址:www.dxzq.net

(20)财通证券有限责任公司
住所:杭州市解放路111号金钱大厦
办公地址:杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人:沈继宁
电话:0571-87925129
传真:0571-87828042
联系人:乔骏
客户服务电话:0571-96336(上海地区962336)
网址:www.ctsec.com

(21)湘财证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12层
办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12层
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:钟康莺
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

(22)中山证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路6009号新世界中山29层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中山29层
法定代表人:吴永良
电话:0755-82570586
传真:0755-82960582
联系人:李珍
客户服务电话:0755-82943750
网址:www.zszq.com.cn

(23)华泰联合证券有限责任公司
住所: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
客户服务电话:400-8888-555,95513
网址:www.lhzq.com

(24)东海证券有限责任公司
住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦11楼
法定代表人:朱科敏
电话:021-50586660
传真:021-50819897
联系人:李涛
客户服务电话:4008888588
网址:www.longone.com.cn

(25)江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
联系人:徐世旺
客户服务电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

(26)德邦证券有限责任公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
电话:021-68761616
传真:021-68767981
联系人:罗芳
客户服务电话:4008888128
网址:www.tebon.com.cn
邮箱:4008888128@tebon.com.cn

(27)国泰君安证券股份有限公司
住所: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
法定代表人:祝幼一
电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com/

(28)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
电话:010-66045566
传真:010-66045500
联系人:潘鸿
客户服务电话:010-66045678
网址:www.txsec.com/
www.txjijin.com/

(29)国联证券股份有限公司
住所:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街168号国联大厦703室
法定代表人:雷建辉
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:徐欣
客户服务热线:400-888-5288,0510-82588168
网址:www.glsc.com.cn

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。

3.场内代销机构:

通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员。具体以上海证券交易所最新公布名单为准。

(二)基金登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金颖
电话:(010)58598839
传真:(010)58598907
联系人:朱立元

(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市天银律师事务所
地址:北京市海淀区高梁桥斜街59号中坤大厦15层
负责人:朱玉栓
电话:(010)62159696
传真:(010)88381869
经办律师:王肖东、朱振武

(四)会计师事务所和经办注册会计师:
名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼
法定代表人:葛明
经办会计师:徐艳、蒋燕华
电话:(021)22288888
传真:(021)22280000
联系人:蒋燕华

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

核准文件:中国证监会证监许可[2010]1635号

核准日期:2010年11月16日

(一)基金类型与存续期间

1.基金类型:股票型基金

2.存续期间:不定期

3.基金的运作方式:契约型开放式

(二)募集方式

本基金将通过场内、场外两种方式向社会公开发售。场外发售渠道为基金管理人的直销机构及场外代销机构的代销网点;场内发售渠道为通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理相关业务的上海证券交易所会员单位。

(三)募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

(四)募集期限

本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。具体时间由基金管理人与代销机构约定(见本基金的基金份额发售公告及代销机构相关公告)。

(五)募集场所

本公司的直销机构和代销机构的代销网点,具体包括:

直销机构:银河基金管理有限公司及其北京分公司、深圳分公司、广州分公司、南京分公司、哈尔滨分公司、银河基金管理有限公司网上交易平台。

场外代销机构:招商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、中航证券有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、东兴证券股份有限公司、财通证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、江海证券有限公司、德邦证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、国联证券股份有限公司。

场内代销机构:通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员。

上述销售机构办理开放式基金业务的具体情况和联系方法,请参见本基金之份额发售公告。

(六)本基金的基金份额初始面值、认购价格及计算公式、认购费用

1.基金份额初始面值:每份基金份额初始面值为人民币1元

2.认购价格:初始面值

3.投资人在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算。本基金场内、场外采用相同的认购费率,具体如下:

认购金额	认购费率
50万元以下	1.20%
50万元(含)-200万元	1.00%
200万元(含)-500万元	0.60%
500万元(含)以上	1000元/笔

4.认购份额的计算公式

本基金将采用外扣法计算认购费用。其中:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额初始面值

场外认购的有效份额保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

场内认购的有效份额保留到整数位,剩余部分按每份基金的认购价格折回金额返还投资人,折回金额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部份四舍五入,由此产生的收益和损失由基金财产承担。

例:某投资人投资10,000元认购本基金,如果认购期内认购资金获得的利息为3元,则其可得到的基金份额计算如下:

净认购金额 = 10,000/(1+1.20%)= 9,881.42元

认购费用 = 10,000-9,881.42 = 118.58元

认购份额 = (9,881.42+3)/1.00 = 9,884.42份

如果投资人是场外认购,则认购份额为9,884.42份;如果投资人是场内认购,认购份额为9,884份,其余0.42份对应的金额返还给投资人。

5.认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记、募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费等各项费用,不列入基金财产。

(七)投资人对基金份额的认购

1.本基金的认购时间安排:具体认购时间安排请见本基金份额发售公告。

2.认购应提交的文件和办理手续:投资人认购本基金应首先办理开户手续,开立基金账户(已开立中国证券登记结算公司的上海开放式基金账户的客户无需重新开户),然后办理基金认购手续。

投资人认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

3.认购方式及确认

本基金认购采取金额认购的方式。T日的申请是否有效应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资人可以自T+2日起,通过其原认购网点柜台或本基金管理有限公司客户服务中心,查询认购申请的受理情况。投资人可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

4.认购限制

(1)投资人在募集期内可以多次认购基金份额,已受理的认购不允许撤销。

(2)本基金场外代销机构首次认购和追加认购的最低金额按照基金管理人和代销机构约定的为准,场内认购须遵守上海证券交易所相关规则;本基金直销网点最低认购金额由基金管理人制定和调整。详见本基金的基金份额发售公告。

本基金对单个基金份额持有人持有基金份额的比例或数量无上限,法律、法规或证监会另有规定的除外。

(八)首次募集期间认购资金的管理和利息的处理方式

基金募集期间募集的资金只能存入专用账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。有效认购资金在募集期所产生的利息折成基金份额,归投资人所有,利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

七、基金合同生效

(一)基金备案的条件

1.本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售,且基金募集达到基金备案条件,基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。

2.基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3.本基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

(二)基金募集失败的处理方式

1.基金募集期届满,未达到基金备案条件,则基金募集失败。

2.如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内返还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

3.如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

(五)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后的存续期内,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

八、基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管

(一)基金份额申购和赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过场内、场外两种方式进行。场外申购赎回场所为基金管理人的直销机构及场外代销机构的销售网点;场内申购赎回场所为通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理相关业务的上海证券交易所会员单位。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构,并另行公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。销售机构名单和联系方式见上述第五章第(一)条。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体办法另行公告。

(二)申购与赎回的开放日及时间

1.开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

在基金开放日,投资者提出的申购、赎回申请时间在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间(目前为下午3:00)之前,其基金份额申购、赎回视为当日的交易申请;如果投资者提出的申购、赎回申请时间在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间之后,其基金份额申购、赎回视为下一开放日的交易申请。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2.申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应最迟于开放日前3个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

(三)申购与赎回的原则

1. "未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

2. "金额申购、份额赎回"原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3.赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

4.当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前3个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告;

5.投资者通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理本基金的申购和赎回的,需遵守上海证券交易所的相关业务规则。

(四)申购与赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效。

2.申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

3.申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

(五)申购与赎回的数额限制

1.场外交易时,投资者通过代销机构首次申购基金份额单笔最低限额为人民币1000元;投资者通过直销中心首次申购基金份额单笔最低限额为人民币50000元,追加申购单笔最低限额为人民币1000元。

场内交易时,投资者通过上海证券交易所会员单位首次申购基金份额单笔最低限额为人民币1000元,且每笔申购金额必须是100元的整数倍,同时单笔申购最高不超过99,999,900元。

2.投资者将当期分配的基金收益转为份额时,不受最低申购金额的限制。

3.场外交易时,赎回的最低份额为50份基金份额;场内交易时,赎回的最低份额为50份基金份额,同时赎回份额必须是整数份额,并且单笔赎回最多不超过99,999,999份基金份额。

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。若某投资者托管的基金份额不足50份或其某笔赎回导致该持有人托管的基金份额不足50份的,投资者在赎回时需一次全部赎回,否则将自动赎回。

4.代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整首次申购的最低金额。

5.投资人可多次申购,对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

6.基金管理人可以根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前3个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

(六)申购和赎回的价格、费用及其用途

1.申购费和赎回费

本基金场内、场外采用相同的申购费率与赎回费率;

(1)本基金对申购设置级差费率,申购费率随申购金额的增加而递减,投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的申购费率表如下:

申购金额	申购费率
50万元以下	1.50%
50万元(含)-200万元	1.20%
200万元(含)-500万元	0.80%
500万元(含)以上	1000元/笔

本基金的申购费用由投资人承担,并应在投资人申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

(2)赎回费随基金持有时间的增加而递减,费率如下:

持有期限	赎回费率
1年以内	0.50%
1年(含)-2年	0.25%
2年(含)以上	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(3)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式,并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2.申购份额与赎回金额的计算方式

(1)申购份额的计算

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。其中,

净申购金额=申购金额/[1+申购费率]

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

场外申购的有效份额计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后2位。由此产生的收益和损失由基金财产承担。

场内申购的有效份额保留到整数位,剩余部分按每份基金份额申购价格折回金额返回投资人,折回金额的计算保留小数点后2位。小数点2位以后的部份四舍五入,由此产生的收益和损失由基金财产承担。

例一:

某投资人投资4万元申购本基金,对应的申购费率为1.50%,假设申购当日基金份额净值为1.040元,则其可得到的申购份额为:

申购金额=40,000元

净申购金额=40,000/(1+1.50%)=39,408.87元

申购费用=40,000-39,408.87=591.13元

申购份额=39,408.87/1.040=37,893.14份

如果投资人是场内申购,申购份额为37,893份,其余0.14份对应的金额返回给投资人。

(2)赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中,

赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额,净赎回金额为赎回金额扣除相应的费用。赎回金额、净赎回金额的计算按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例二:

某投资者赎回本基金1万份基金份额,持有时间为一年两个月,对应的赎回费率为0.25%,假设赎回当日基金份额净值是1.050元,则其可得到的赎回金额为:

赎回金额=10,000×1.050=10,500元

赎回费用=10,500×0.25%=26.25元

净赎回金额=10,500-26.25=10,473.75元

即:投资者赎回本基金1万份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是1.050元,则其可得到的赎回金额为10,473.75元。

3.本基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当日收市后计算,并在T+1日公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

4.基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(七)申购与赎回的注册登记

1.基金投资人提出的申购和赎回申请,在当日交易时间结束之前可以撤销;

2.投资人申购基金成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资人增加权益并办理注册登记手续,投资人自T+2日起有权赎回该部分基金份额;

3.投资人赎回基金成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续;

4.基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施前3个工作日在指定媒体予以公告。

(八)拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

1.发生下列情形时,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

(1)因不可抗力导致基金无法正常运作;

(2)证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况;

(4)基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时;

(5)基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形;

(6)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退划给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2.发生下列情形时,基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

(1)因不可抗力导致基金无法正常运作;

(2)证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3)连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回;

(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况;

(5)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已接受的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过支付时间20个工作日,并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

(九)巨额赎回的认定及处理方式

1.巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2.巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于场外未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于场内赎回部分,当日未获受理的赎回申请将自动视为取消赎回,而不会延至以后的开放日做延期赎回处理。

(3)暂停赎回:连续2日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

3.巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

(十)暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1.发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在至少一种指定媒体上刊登暂停公告。

2.如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近一个开放日的基金份额净值。

3.如发生暂停的时间超过1日但少于2周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近一个开放日的基金份额净值。

4.如发生暂停的时间超过2周,暂停期间,基金管理人应每2周至少刊登暂停公告一次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(十一)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

(十二)基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

1.系统内转托管

(1)系统内转托管是指基金持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为。

(2)基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理场外基金赎回业务的销售机构(网点)时,应依照销售机构(网点)规定办理基金份额系统内转托管。

(3)基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理场内赎回的会员单位(席位)时,应办理已持有基金份额的系统内转托管。在上海证券交易所系统内进行基金份额转托管的,按照《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中的有关规定办理。

2.跨系统转登记

(1)跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

(2)本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

(十三)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

(十四)基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或是基金份额被冻结的,对冻结部分产生的权益一并冻结。

九、与基金管理人管理的其他基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

十、基金的投资

(一)投资目标

本基金投资于具有良好成长性的创新类上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

(二)投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等,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。本基金投资的股票资产占基金资产的60%-95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%-40%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的20%。本基金将不低于80%的股票资产投资于具有创新能力和成长潜力的上市公司。

以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并依法进行投资管理。

(三)投资理念

创新是经济增长的动力,是超额回报的来源。

(四)投资策略

本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的股票选择相结合。在资产配置策略上,本基金根据对经济面、政策面、市场面等多因素分析,在投资比例限制范围内,确定或调整投资组合中股票和债券的比例。在股票选择上,本基金主要投资于具有创新能力和持续增长潜力的上市公司股票,力争为基金份额持有人带来长期、稳定的资本增值。

1.资产配置策略

本基金管理人使用多因素分析模型,从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素,综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势,重点分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系,在此基础上,在投资比例限制范围内,确定或调整投资组合中股票和债券的比例。

本基金考虑的宏观经济因素包括GDP增长率,居民消费价格指数(CPI),生产者价格指数(PPI),货币供应量(M0,M1,M2)的增长率等指标,本基金将以全球化的视野,结合全球经济周期和国内经济周期,综合考虑宏观经济指标。

本基金考虑的政策面因素包括货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势等。

本基金考虑的市场因素包括市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体P/E、P/B等指标相对于长期均值水平的偏离度、新股首发上市涨幅、不同行业的市场轮动情况等。

2.股票投资策略

本基金主要投资于具有良好成长性的创新类上市公司。本基金所指的创新,包括技术创新和商业创新两种类型。技术创新是指企业应用新知识和新技术,或采用新工艺,开发生产新的产品,提供新的服务,或提高产品质量、降低产品成本,占据市场并实现市场价值的活动。商业创新是指企业通过商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等方面的创新,使企业的盈利能力和竞争实力得到持续改善的行为。

(1)企业初选

本基金认为技术创新是创新的核心内容,是企业价值的关键来源,因此本基金资产主要投资于伴随新的科研成果和新兴技术的发明、应用而出现的新的部门和行业。参考《国家中长期科学和技术发展规划纲要(2006-2020)》中提出的引领未来经济发展的前沿技术的确定,本基金现阶段主要投资于伴随新的科研成果和新兴技术的发明、应用而出现的新的部门和行业,主要为微电子与信息技术、生物技术及现代农业、新材料、新能源、环境保护、先进制造、医药与医学工程、航空航天、海洋技术等。由于科学技术的发展日新月异,新技术和新的行业不断涌现,本基金将动态调整新技术、新行业的范围。

本基金将通过行为辨识和定量分析相结合的方法确定商业创新的初选企业。

首先本基金将辨识企业是否在商业模式、营销模式、生产流程、管理结构等商业行为方面有创新活动。其次,本基金认为商业创新活动往往是一种节约人力和资本的活动,即以更少的人力和资本投入取得更大的增长,因此本基金将采用包括但不限于企业当期销售收入变化对固定资产变化的比例以及企业当期销售收入变化对为职工支出的现金变化的比例是否增加等指标,作为企业初选参考指标,本基金还将根据研究结果对使用的指标进行调整。

通过以上的步骤,本基金挑选出符合条件的商业创新的初选企业。

(2)企业创新能力评价

对于纳入本基金初选范围的股票,本基金将区分企业创新的类型,对企业的创新能力进行评价。

1)技术创新类企业的创新能力评价

创新的组织体系分析:创新不是一种随机的行为,而是持续不断的追求,因此本基金将重点分析企业是否建立了规范的研发管理体系、是否有清晰的研究开发规划、是否吸引优秀的人才加入研发队伍、是否建立了合理的激励机制以鼓励创新等。

创新行为的投入保障:企业为开发新技术或保持技术上的领先地位,必须保持持续和一定规模的资金投入,本基金将重点考察研究开发费用占销售收入的比重,近三年研究开发费用的规模以及增长情况等。

创新行为的成效:对技术创新类企业本基金将重点分析企业研究开发活动的成效,本基金从企业专利申请量、发明专利比重、拥有专利数量、专有技术、新产品推出周期等方面对企业的技术创新成效进行分析。对商业创新,将重点分析其商业模式的可复制性、销售收入增长、市场份额增长、成本降低等方面。

本基金将根据具体的研究需要,重点考察但不限于企业的研发费用、市场份额增长、成本降低等各项具体指标对企业的创新能力进行评价.

2)商业创新类企业的创新能力评价

对商业创新型企业,将重点分析商业创新的持续性,分析商业创新在商业模式的可复制性,促进销售收入增长、市场份额增长、成本降低等方面的持续性。

经过企业创新能力评价,本基金将筛选出创新能力居于前1/2的企业。

(3)成长型股票筛选

对按照上述步骤筛选出的创新型企业股票,本基金将进一步对企业的成长性进行评价,分析和预测企业持续的成长性。本基金的成长性评价指标,包括但不限于预期当年的营业收入增长率、营业利润增长率、净利润增长率,最近三年的营业收入增长率、营业利润增长率、净利润增长率等指标。

通过成长性评估,本基金将选择成长性突出的企业股票构成创新成长股票池。

(4)企业基本面及价值评估

本基金对纳入创新成长股票池的股票,通过行业研究、上市公司调研、财务报表分析、国内外同业比较等方法,从中选择出基本面较好的公司。然后,运用合适的股票估值方法,包括自由现金流贴现、股息贴现、PE、PB、PEG、EV/EBITDA等,排除股价被大幅高估的股票,主要投资估值处于合理水平或被低估的优质创新成长股作为投资对象。

3.债券投资策略

本基金将一部分基金资产投资于债券,包括国内依法公开发行和上市的国债、金融债、企业债、可转债、央行票据和资产支持证券等。

(1)债券投资

本基金债券投资以久期管理为核心,采取利率预期、收益率曲线估值、类属配置、单券选择等主要策略。

(2)可转换债券投资

可转换债券是一种介于股票和债券之间的债券衍生投资品种,投资者既可以获得普通债券的固定收益,也可以分享股票价格上涨所带来的投资回报。本基金在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上,利用可转换债券定价模型进行估值,并结合市场流动性,投资具有较高投资价值的可转换债券。

(3)资产支持证券投资

本基金在对资产支持证券进行信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等综合评估的基础上,利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值,通过信用研究和流动性分析,并运用久期管理、类属配置和单券选择等积极策略,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,控制资产支持证券投资的风险,获取长期稳定的投资收益。

4.权证投资策略

本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算,并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果,选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。采用的策略包括但不限于下列策略或策略组合:

(1)本基金采取现金套利策略,兑现部分标的证券的投资收益,并通过购买该证券认购权证的方式,保留未来股票上涨所带来的获利空间。

(2)本基金根据权证与标的证券的内在价值联系,合理配置权证与标的证券的投资比例,构建权证与标的证券的避险组合,控制投资组合的下跌风险。同时,本基金积极发现可能存在的套利机会,构建权证与标的证券的套利组合,获取较高的投资收益。

(五)投资决策依据和投资程序

1.投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;

(2)国内外宏观经济发展状况、宏观经济政策导向、微观经济运行环境和证券市场发展态势;

(3)投资资产的预期收益率及风险水平等。

2.投资程序

(1)研究与分析

本基金管理人内设研究部,通过对宏观、政策、行业、公司、市场等方面的分析,制定投资策略建议和投资建议。

本基金管理人内设绩效与风险评估小组,运用风险模型及监测指标定期或根据需要对基金绩效进行评估,并向基金经理反馈。

(2)构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下,审批确定基金资产配置和行业配置方案,并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下,参考研究部和绩效与风险评估小组的研究分析,制定基金的投资策略,在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。

(3)交易

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(4)组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况。监察部对基金投资进行日常监督。绩效与风险评估小组定期对基金投资进行绩效评估和风险分析,并通过监察部呈报给合规审查与风险控制委员会及督察长办公室、投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和绩效与风险评估小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上,基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行反思,对基金投资组合不断进行调整和优化。

(六)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是:

业绩基准收益率=中证500指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

随着市场环境的变化,或因指数编制及发布等方面的原因,如果上述业绩比较基准不适用本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应履行相关程序,并报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

(七)风险收益特征

本基金是股票型基金,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的品种。

(八)投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(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3%;

(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(6)本基金投资的股票资产占基金资产的60%-95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%-40%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;本基金将不低于80%的股票资产投资于具有创新能力和成长潜力的上市公司;

(7)本基金投资于同一原始权益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全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)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)基金财产参与股票发行申购,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;

(13)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0.5%。

本基金投资流通受限证券,将根据中国证监会相关规定,制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

2.禁止行为

为维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者活动:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7)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;

(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;

(9)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

(九)基金管理人代表基金行使股东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,不参与所投资上市公司的经营管理;

3.有利于基金财产的安全与增值;

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(十)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十一、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、银行存款本息、基金应收申购款以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

本基金财产以基金名义开立银行存款账户,以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四)基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权,不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销,不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

十二、基金资产估值

(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正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

(二)估值方法

1.证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),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,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,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、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3.因持有股票而享有的配股权,以及停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

4.全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

5.同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

6.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7.相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

(三)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产和负债。

(四)估值程序

1.基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(五)估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1.差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人("受损方")的直接损失按下述"差错处理原则"给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2.差错处理原则

(1)差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方对直接损失承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

(2)差错的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3)因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失("受损方"),则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4)差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

3.差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1)查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4)根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告。

(3)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

(六)暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2.因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,已决定延迟估值;

4.中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(七)基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

(八)特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十三、基金收益与分配

(一)基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二)基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1. 本基金的每一基金份额享有同等收益分配权;

2.基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

3. 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%;

4. 基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

5. 本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的单位净值自动转为基金份额进行再投资;如果基金份额持有人未选择收益分配方式,则默认为现金分红方式;

6. 基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日

7. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

8.法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

(四)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

(五)收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订,由基金托管人复核,依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案;

2.在收益分配方案公布后,基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令,基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十四、基金的费用

(一)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.基金财产拨划支付的银行费用;

4.基金合同生效后的基金信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

7.基金的证券交易费用;

8.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下,基金管理费按基金资产净值的1.50%年费率计提。计算方法如下:

$H=E×1.50\%÷当年天数$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

$H=E×0.25\%÷当年天数$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

十五、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十六、基金的会计与审计

(一)基金的会计政策

1.基金管理人为本基金的会计责任方;

2.本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日。如果基金首次募集的会计年度,基金合同生效少于2个月,可以并入下一个会计年度;

3.本基金的会计核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

4.会计制度执行国家有关的会计制度;

5.本基金独立建账、独立核算;

6.基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表;

7.基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

(二)基金的审计

1.基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2.会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人同意。

3.基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所,经基金托管人(或基金管理人)同意,并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所,基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

十七、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称"指定报刊")和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称"网站")等媒介披露。

(下转D8版)