(上接D9版)
联系人:李杰
客户服务电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn
(27)名称:华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址:深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人:马昭明
联系人:盛宗凌、庞晓芸
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
客户服务电话:95513
公司网址:www.lhzq.com
(28)名称:中银国际证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
联系人:张静
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务电话:4006208888
公司网址:www.bocichina.com
(29)名称:长城证券有限责任公司
住所: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
联系人:匡婷
电话:0755-83516289
传真:0755-83516199
客户服务热线:0755-33680000;400-6666-888
公司网址:www.cgws.com
(30)名称: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
联系人:潘锴
电话:0431-85096709
开放式基金咨询电话:4006000686、0431-85096733
开放式基金业务传真:0431-85096795
公司网址:www.nesc.cn
(31)名称:东方证券股份有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务电话:95503
公司网址:www.dfzq.com.cn
(32)名称:平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626391
开放式基金业务传真:0755-82400862
全国统一总机:4008866338
全国免费业务咨询电话:4008816168
网址:www.pingan.com
(33)名称:渤海证券股份有限公司
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:王春峰
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客户服务电话:4006515988
公司网址:www.bhzq.com
(34)名称: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:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021- 23219100
客户服务热线:95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.htsec.com
(35)名称:东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
公司网址:www.dwzq.com.cn
(36)名称:金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼
法定代表人:陆涛
联系人:马贤清
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
客户服务电话:4008-888-228
公司网址:www.jyzq.cn
(37)名称: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:021-22169999
传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788、10108998
公司网址:www.ebscn.com
(38)名称:东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
客服电话:400-888-8588
联系人:李涛
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
公司网址:www.longone.com.cn
(39)名称: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:江西省南昌市北京西路88号江信大厦4楼
法定代表人:曾小普
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
传真:0791-6288690
客户服务电话:0791-6285337、6273972
公司网址:www.gsstock.com
(40)名称:山西证券股份有限公司
办公(注册)地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客户服务电话:400-666-1618
公司网址:www.i618.com.cn
(41)名称: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:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼
法定代表人:林俊波
联系人:钟康莺
电话:021-68634518
传真:021-68865680
开放式基金客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com
(42)名称:国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
联系人:袁丽萍
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客户服务电话:400-888-5288、0510-82588168
公司网址:www.glsc.com.cn
(43)名称:国海证券有限责任公司
住所:中国广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅峰
联系人:武斌
电话:0755-83707413
传真:0755-83700205
客户服务电话:95563
公司网址:www.ghzq.com.cn
(44)名称:广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:吴志明
联系人:林洁茹
电话:020-87322668
传真:020-87325036
客户服务电话:020-961303
公司网址:www.gzs.com.cn
(45)名称: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:姚文平
联系人:罗芳
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客户服务电话:400-8888-128
公司网址:www.tebon.com.cn
(46)名称:国元证券股份有限公司
住所:合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
联系人:陈琳琳
联系电话:0551-2246273
开放式基金咨询电话:安徽地区:95578
开放式基金业务传真:0551-2272100
公司网址:www.gyzq.com.cn
(47)名称:华安证券有限责任公司
注册地址: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
法定代表人:李工
联络人:甘霖
电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
客户服务电话:96518、4008096518
公司网址:www.hazq.com
(48)名称: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室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层(266061)
法定代表人:张智河
联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn
(49)名称:财通证券有限责任公司
注册地址:杭州市解放路111号
法定代表人:沈继宁
联系人:乔骏
电话:0571-87925129
传真:0571-87828042
客户服务电话:0571-96336,(上海地区:962336)
公司网址:www.ctsec.com
(50)名称:中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:石保上
联系人:程月艳、耿铭
电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
客户服务电话:0371-967218或4008139666
公司网址:www.ccnew.com
(51)名称:国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
客户服务电话:400-818-8118
公司网址:www.guodu.com
(52)名称:万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
办公地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
法定代表人:张建军
开放式基金咨询电话:400-8888-133
开放式基金接收传真:020-22373718-1013
联系人:罗创斌
联系电话:020-37865070
网址:www.wlzq.com.cn
(53)名称:世纪证券有限责任公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:卢长才
联系人:张婷
电话:0755-83199511
公司网址:www.csco.com.cn
(54)名称:财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人:周晖
联系人:郭磊
电话:0731-84403319
公司网址:www.cfzq.com
(55)名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.essence.com.cn
(56)名称:中航证券有限公司
住所:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
电话:0791-6768681
公司网址:www.avicsec.com
(57)名称:长江证券股份有限公司
地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务电话:95579或4008-888-999
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
公司客服网址:www.95579.com
公司网址:www.cjsc.com
(58)名称:宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系人:李巍
电话:010-88085858
传真:010-88085195
客户服务电话:4008-000-562
(59)名称:中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人:杨明辉
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
开放式基金咨询电话:4006008008
公司网址:www.cjis.cn
(60)名称:齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客户服务电话:95538
公司网址:www.qlzq.com.cn
(61)名称:方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
电话:0731-85832343
传真:0731-85832214
客服电话:95571
网址:www.foundersc.com
(62)名称:江海证券有限公司
地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:徐世旺
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务电话:4006662288
公司网址:www.jhzq.com.cn
(63)名称:华宝证券有限责任公司
注册地址: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
联系人:陈康菲
电话:021-50122222
传真:021-50122200
客户服务电话:4008209898
公司网站:www.cnhbstock.com
(64)名称:中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人:赵大建
联系人:李微
联系电话:010-59355941
客服电话:40088-95618
公司网址:www.e5618.com
(65)名称:华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-4890100
传真:0931-4890118
客户服务电话:0931-4890100、4890619、4890618
公司网站:www.hlzqgs.com
(66)名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客户服务电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
(67)名称:厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:卢金文
电话:0592-5161642
传真:0592-5161640
客户服务电话:0592-5163588
公司网站:www.xmzq.cn
(68)名称:南京证券有限责任公司
住所:江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人:张华东
联系人:徐翔
电话:025-83367888-4303
传真:022-83320066
客户服务热线:400 828 5888
公司网址:www.njzq.com.cn
(69)名称:华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座三层、五层
法定代表人:丁之锁
联系人:林长华
电话:010-58568181
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
公司网址:www.hrsec.com.cn
(70)名称:浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人:吴承
联系人:谢项辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客户服务电话:0571-967777
公司网址:www.stocke.com.cn
(71)名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:王珠林
联系人:陈诚
电话:023-63786464
传真:023-63786311
客户服务电话:4008-096-096
公司网址:www.swsc.com.cn
(以上排名不分先后)
3、其他代销机构
本基金发售期间,若新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另行公告。
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
二、注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
法定代表人:马庆泉
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话:020-89899129
传真:020-89899175
联系人:李尔华
三、担保人
名称:中国投资担保有限公司
住所:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层
办公地址:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层
法定代表人:刘新来
成立日期:1993年12月4日
组织形式:有限责任公司
注册资本:3,521,459,934元人民币
经营范围:投资担保;投资及担保的评审、策划、咨询服务;投资及投资相关的策划、咨询;资产受托管理;经济信息咨询;人员培训;新技术、新产品的开发、生产和产品销售;仓储服务;组织、主办会议及交流活动;上述范围涉及国家专项规定管理的按有关规定办理。
四、出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师集团(广州)事务所
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人:程秉
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:黄贞、王志宏
联系人:程秉
五、审计基金资产的会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所有限公司
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯卿
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:胡小骏 洪锐明
联系人:胡小骏

第六部分 基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、本基金《基金合同》及其他有关规定募集本基金,并于2011年1月21日经中国证监会证监基金字[2011]131号文核准募集。
一、基金的基本情况
1、基金名称
广发聚祥保本混合型证券投资基金
2、基金的类别
保本混合型证券投资基金
3、基金的运作方式
契约型开放式
4、基金的投资目标
在力争保本周期到期时本金安全的前提下,严格控制风险,谋求基金资产的稳定增值。
5、基金存续期限
不定期
6、基金保本周期
三年。自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日。
7、基金的保本
本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额,即基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。在保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于其认购并持有到期的基金份额的投资金额(低出的部分即为"保本差额"),基金管理人应向基金份额持有人补足该差额,并在保本周期到期日后二十个工作日(含第二十个工作日)内将该差额支付给基金份额持有人,担保人对此提供不可撤销的连带责任保证。但基金份额持有人未持有到期而赎回或转换出的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的,相应基金份额不适用本条款。
8、基金保本的保证
担保人为本基金保本提供不可撤销的连带责任保证,保证范围为:在保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于其认购并持有到期的基金份额的投资金额的差额部分,保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。担保人承担保证责任的最高限额不超过按《基金合同》生效之日确认的基金份额所计算的保本额。
二、募集方式与募集期限
本基金的募集方式为代销与直销。募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。本基金募集对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及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。
三、募集规模
本基金的募集上限为50亿元人民币(不包括认购期利息),规模控制的具体办法参见《发售公告》。本基金最低募集份额总额为2亿份。
四、募集场所
本基金通过基金管理人的直销机构销售网点及基金销售代理人的代销网点向社会公开募集。办理开放式基金业务的城市(网点)的具体情况和联系方法,请参见本基金之发售公告。
五、基金份额发售面值、认购价格和认购费用
1、份额发售面值:人民币1.00元
2、认购价格:人民币1.00元
3、认购费用:
认购费用的计算方法如下:
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;
本基金对认购设置级差费率,认购费率随认购金额的增加而递减,最高认购费率不超过1.0%,投资者同一天可多笔认购,但适用费率按单笔分笔计算。具体费率如下:

认购金额(M)	费率
M<100万元	1.0%
100万元≤M<500万元	0.8%
500万元≤M<1000万元	0.4%
M≥1000万元	每笔1000元

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。
4、认购份额的计算
认购份额的计算方法如下:
(1)净认购金额 = 认购金额/(1+认购费率);
(2)认购费用 = 认购金额-净认购金额;
(3)认购份额 = (净认购金额+认购期利息)/基金份额发售面值。
认购费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位;认购份额计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产。
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5元,则其可得到的基金份额计算如下:
净认购金额=10,000/(1+1.0%)=9,900.99元
认购费用=10,000-9,900.99=99.01元
认购份额=(9,900.99+5)/1.00=9,905.99份
即投资人投资10,000元认购本基金,加上认购资金在认购期内获得的利息,可得到9,905.99份基金份额。
5、投资金额的计算
投资金额的计算方法如下:
投资金额=净认购金额+认购费用+募集期间利息
例:某投资人投资10,000元认购本基金,且该认购申请被全额确认,认购费率为1.0%,假定认购期内认购资金获得的利息为5元,则投资金额为:
净认购金额=10,000/(1+1.0%)=9,900.99元
认购费用=10,000-9,900.99=99.01元
投资金额=9,900.99+99.01+5=10,005.00元
六、投资人对基金份额的认购
1、本基金的认购时间安排、认购者认购应提交的文件和办理的手续详细查阅本基金的基金份额发售公告。
2、认购方式
本基金认购采取金额认购的方式。
(1)投资者认购前,需按销售机构规定的方式备足认购的金额。
(2)基金投资者在募集期内可多次认购,但已申请的认购一旦被注册登记机构确认,就不再接受撤销申请。
3、认购确认
基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。投资者可在基金正式宣告成立后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。若投资者的认购申请被确认为无效,基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。
4、认购限制
(1)投资者在募集期内可以多次认购基金份额,但已申请的认购一旦被注册登记机构确认,就不再接受撤销申请。
(2)在募集期内,投资者通过本公司网上交易系统和代销机构代销网点每个基金账户首次认购的最低限额(含认购费)为1,000元,追加认购最低限额为1,000元(含认购费),直销机构网点(非网上交易系统)每个基金账户首次认购的最低限额为50,000元(含认购费)。已在基金管理人销售网点有认购本基金记录的投资者不受首次认购最低金额的限制,但受追加认购最低金额的限制。
七、首次募集期间认购资金利息的处理方式
《基金合同》生效前,投资者的认购款项只能存入专门账户,不得动用。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。
八、基金募集期间募集的资金应存入专项账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

第七部分 基金合同的生效

一、基金合同生效的条件
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2亿元人民币且基金认购户数达到相关法规要求的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在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,向中国证监会办理基金备案手续。
基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人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。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。
《基金合同》生效时,认购款项在募集期间内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有。
二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式
如果《基金合同》不能生效,基金管理人应当承担下列责任:
1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息。
三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额
《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。
法律法规另有规定时,从其规定。

第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

一、申购与赎回的场所
本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。
基金投资者应当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份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构,并予以公告。
1、本公司直销机构;
2、代销机构:经本公司委托,具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点。
(详见本招募说明书第五部分)
二、申购与赎回的开放日及时间
在本基金的保本周期内,一般不接受申购(包括转换入)申请。特殊情况经基金管理人与基金托管人、担保人协商并报中国证监会备案后可接受申购(包括转换入)申请,对于申购(包括转换入)的基金份额,本基金不提供保本,具体规则由基金管理人在开始办理申购的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
本基金的赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理赎回的具体日期前2日在至少一家指定媒体公告。
申购和赎回的开放日为证券交易所交易日(基金管理人公告暂停申购或赎回时除外),投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。
若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对申购、赎回时间进行调整,但此项调整应在实施日2日前在指定媒体公告。
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、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;
4、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;
5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。
四、赎回的数额限制
1、基金份额持有人赎回本基金的最低份额为100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,但某笔赎回导致该基金份额持有人在一个网点的基金份额余额少于相应的最低赎回限额时,余额部分的基金份额必须一同赎回。
2、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。
五、申购与赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序,在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。
投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时,必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。
2、申购和赎回申请的确认
T日规定时间受理的申请,正常情况下,基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认,在T+2日后(包括该日)投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。
基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。
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,申购款项将退回投资者账户。
投资者T日赎回申请成功后,基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时,款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。
六、申购费率、赎回费率
1、申购费率
本基金的申购费用由基金申购人承担,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。
在本基金的保本周期内,一般不接受申购(包括转换入)申请。特殊情况经基金管理人与基金托管人、担保人协商并报中国证监会备案后可接受申购(包括转换入)申请,对于申购(包括转换入)的基金份额,本基金不提供保本,具体规则由基金管理人在开始办理申购的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。本基金的申购费率最高不超过5%,具体费率以届时公告为准。
若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为转型后的"广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金",申购费率最高不超过5%,具体费率以届时公告为准。
2、赎回费率
本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%。赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减,具体费率如下:

赎回期限(N)	赎回费率
N≤1年	2.0%
1年<N≤2年	1.6%
2年<N<3年	1.2%
认购并持有到保本周期到期日	0.0%

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为转型后的"广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金",赎回费率最高不超过5%,具体费率以届时公告为准。
3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒体公告。
4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者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相关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、申购份额与赎回金额的计算方式
1、本基金申购份额的计算:
基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,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
2、本基金赎回金额的计算:
采用"份额赎回"方式,赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算。
如果投资者在保本周期到期前赎回基金份额,赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用
例:某投资者赎回10万份基金份额,份额持有期限100天,对应赎回费率为2.0%,假设赎回当日基金份额净值是1.213元,则其可得到的赎回金额为:
赎回总金额 =100,000×1.213=121,300.00元
赎回费用 =121,300.00×2.0% =2,426.00元
净赎回金额 =121,300.00-2,426.00=118,874.00元
即:投资者赎回本基金10万份基金份额,份额持有期限100天,假设赎回当日基金份额净值是1.213元,则其可得到的净赎回金额为118,874.00元。
保本周期到期日的赎回安排按本基金到期保本条款执行。
3、本基金基金份额净值的计算:
T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。
4、申购份额、余额的处理方式:
申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算,申购份额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。
5、赎回金额的处理方式:
赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用,赎回金额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。
八、申购与赎回的注册登记
投资者申购基金成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续,投资者自T+2日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。
投资者赎回基金成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。
基金管理人可以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,但不得实质影响投资者的合法权益,并最迟于开始实施前3个工作日在至少一家指定媒体公告。
九、拒绝或暂停申购的情形及处理
在本基金的保本周期内,一般不接受申购(包括转换入)申请。特殊情况经基金管理人与基金托管人、担保人协商并报中国证监会备案后可接受申购(包括转换入)申请,对于申购(包括转换入)的基金份额,基金管理人不提供保本,具体规则由基金管理人在开始办理申购的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理
除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项:
(1)不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项;
(2)证券交易场所依法决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
(3)因市场剧烈波动或其他原因而出现连续2个或2个以上开放日巨额赎回,导致本基金的现金支付出现困难;
(4)发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值的情况;
(5)为保障基金份额持有人利益,基金管理人可在保本周期到期前30个工作日内视情况暂停本基金的日常赎回和转换出业务并提前公告;
(6)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述情形之一的,基金管理人应在当日立即向中国证监会备案,已接受的赎回申请,基金管理人将足额支付;如暂时不能足额支付的,可延期支付部分赎回款项,按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。
同时,在出现上述第(3)款的情形时,对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项,最长不超过20个工作日,并在至少一家指定媒体公告。投资者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。
暂停基金的赎回,基金管理人应及时在至少一家指定媒体刊登暂停赎回公告。
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,并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。
十一、巨额赎回的情形及处理方式
1、巨额赎回的认定
本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的10%时,即认为发生了巨额赎回。
2、巨额赎回的处理方式
当出现巨额赎回时,基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。
(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。
(2)部分顺延赎回:当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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日基金总份额的10%的前提下,对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请,应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例,确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额;投资者未能赎回部分,除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外,延迟至下一个开放日办理,赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权,并以此类推,直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。
(3)巨额赎回的公告:当发生巨额赎回并顺延赎回时,基金管理人应在2日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告,并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人,并说明有关处理方法。
本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;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,并应当在至少一家指定媒体公告。
十二、重新开放申购或赎回的公告
如果发生暂停的时间为一天,基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。
如果发生暂停的时间超过一天但少于两周,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个工作日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。
如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。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个工作日在至少一家指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。
十三、基金的转换
为方便基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的条件、数额限制、转换费率等具体规定可由基金管理人届时另行规定并公告。
十四、转托管
本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。
十五、基金的非交易过户
非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式,将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。
基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中,"继承"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的情形;"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。无论在上述何种情况下,接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。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。
基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户,其他销售机构不得办理该项业务。
对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。
十六、基金的冻结与解冻
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的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关做出决定之前,被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

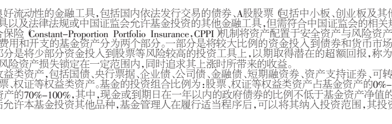
第九部分 基金的保本

一、保本
本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额,即基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。
在保本周期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额高于或等于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额,基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人。
在保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额(低出的部分即为"保本差额"),则基金管理人应补足该保本差额,并在保本周期到期日后4个工作日内将该保本差额支付至本基金在基金托管人处开立的账户。
如果基金管理人未能全额补足保本差额,则基金管理人应在保本周期到期日后5个工作日内,向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内,将需清偿的款项支付至本基金在基金托管人处开立的账户。
基金管理人最迟应在保本周期到期日后20个工作日(含第20个工作日)内将保本差额支付给基金份额持有人,担保人对此提供不可撤销的连带责任保证。
基金份额持有人未持有到期而赎回或转换出的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的,相应基金份额不适用保本条款。
二、保本案例
若某投资者投资10,000元认购本基金(该认购申请被全额确认)并持有到保本周期到期,认购费率为1.0%。假定募集期间产生的利息为5元,持有期间基金累积分红0.06元/基金份额。则,认购份额为:
净认购金额=10,000/(1+1.0%)=9,900.99元
认购费用=10,000-9,900.99=99.01元
认购份额=(10,000-99.01+5)/1.00=9,905.99份
(一)若保本周期到期日,本基金基金份额净值为0.92元。
投资金额=10,000+5=10,005.00元
可赎回金额=0.92×9,905.99=9,113.51元
持有期间累计分红金额=0.06×9,905.99=594.36元
可赎回金额+持有期间累计分红金额=9,707.87元
即:可赎回金额+持有期间累计分红金额<投资金额
若保本周期到期日该投资者赎回基金份额,则基金管理人将按照投资金额(扣除其持有期间的累计分红金额)向该投资者支付9,410.64元。
(二)若保本周期到期日,本基金基金份额资产净值为1.35元。
投资金额=10,000+5=10,005.00元
可赎回金额=1.35×9,905.99=13,373.09元
持有期间累计分红金额=0.06×9,905.99=594.36元
可赎回金额+持有期间累计分红金额=13,967.45元
即:可赎回金额+持有期间累计分红金额>投资金额
若保本周期到期日该投资者赎回基金份额,则基金管理人将按照可赎回金额向该投资者支付13,373.09元。
三、适用保本条款的情形
(一)基金份额持有人认购并持有到期的基金份额;
(二)对于认购并持有到期的份额,基金份额持有人无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为"广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金",都同样适用保本条款。
四、不适用保本条款的情形
(一)在保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额不低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额的;
(二)基金份额持有人认购,但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出本基金的基金份额;
(三)基金份额持有人在本保本周期内申购或转换入的基金份额;
(四)在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形;
(五)在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形,且担保人不同意继续承担保证责任;
(六)在保本周期到期日之后(不包括该日),基金份额发生的任何形式的净值减少;
(七)因不可抗力的原因导致基金投资亏损;或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的,或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的;
(八)未经担保人书面同意修改《基金合同》条款,可能加重担保人保证责任的,根据法律法规要求进行修改的除外。

第十部分 基金保本的保证

一、为确保履行保本条款,保障基金份额持有人利益,本基金的保本由担保人提供不可撤销的连带责任保证。本基金的担保人为中国投资担保有限公司或《基金合同》规定的其他机构。
二、基金管理人和担保人签订《"广发聚祥保本混合型证券投资基金保证合同"》,基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意《保证合同》的约定。本基金保本由担保人提供不可撤销的连带责任保证。保证的范围为:在保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额的差额部分。
担保人保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。
担保人承担保证责任的最高限额不超过按《基金合同》生效之日确认的基金份额所计算的保本额。
三、保本周期内,担保人出现足以影响其履行《保证合同》项下保证责任能力情形的,应在该情形发生之日起三个工作日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人在接到通知之日起三个工作日内应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法,并在指定媒体上公告上述情形。
确定担保人已丧失保证能力的,基金管理人应在15个工作日内召集基金份额持有人大会,就如下事项进行表决:
1、更换担保人;
2、变更基金类别;
3、《基金合同》终止;
4、法律法规或中国证监会规定的其他事项。
四、保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过。担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。
保本周期内更换担保人的程序:
1、提名
新任担保人由基金管理人提名。
基金管理人提名的新任担保人必须符合如下条件:(1)具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件;(2)符合基金份额持有人的利益。
2、决议
基金份额持有人大会对被提名的新任担保人形成决议,该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的1/2以上(含1/2)表决通过。
3、核准
基金份额持有人大会选任新任担保人的决议须经中国证监会核准后方可执行。
4、签订《保证合同》
更换担保人经中国证监会核准后,基金管理人与新任担保人签订《保证合同》。
5、公告
基金管理人在中国证监会核准后2日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。
6、交接
原担保人职责终止的,原担保人应妥善保管保本周期内保证业务资料,及时向基金管理人和新任担保人办理保证业务资料的交接手续,基金管理人和新任担保人应及时接收。
保本周期内更换担保人的,原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前,原担保人应继续承担保证责任。
五、如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额(低出的部分即为"保本差额"),基金管理人应按《基金合同》的约定在保本周期到期日后4个工作日内将保本差额支付至本基金在基金托管人处开立的账户;基金管理人无法全额履行保本义务的,基金管理人在保本周期到期日后5个工作日内,向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内,将需清偿的款项划入本基金在基金托管人处开立的账户中,由基金管理人支付给基金份额持有人。担保人将上述清偿款项全额划入本基金在基金托管人处开立的账户中后即为全部履行了保证责任,担保人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。清偿款项的分配与支付由基金管理人负责,担保人对此不承担责任。
如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于其认购并持有到期的基金份额的投资金额(低出的部分即为"保本差额"),且基金管理人及担保人未能在保本周期到期日后20个工作日(含第20个工作日)内足额将保本差额支付给基金份额持有人的,自保本周期到期日后第21个工作日起,基金份额持有人可以根据《基金合同》第二十五部分"争议的处理和适用的法律"约定,直接向基金管理人或担保人请求解决保本差额支付事宜。
六、除本部分第四款所指的"保本周期内更换担保人的,原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担"以及下列除外责任情形外,担保人不得免除保证责任:
1、在保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额不低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额的;
2、基金份额持有人认购,但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的本基金的基金份额;
3、基金份额持有人在本保本周期内申购或转换入的基金份额;
4、在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形;
5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形,且担保人不同意继续承担保证责任;
6、在保本周期到期日之后(不包括该日)基金份额发生的任何形式的净值减少;
7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损;或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的,或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的;
8、未经担保人书面同意修改《基金合同》条款,可能加重担保人保证责任的,根据法律法规要求进行修改的除外。
七、保本周期届满时,担保人或基金管理人和基金托管人认可的其他机构经监管机构同意后,继续为本基金的保本提供保本保障,并且基金管理人与之签订保证合同或风险买断合同,同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的,本基金将转入下一保本周期;否则,本基金转型为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为"广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金",担保人不再为该混合型基金承担保证责任。
八、保证费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。
本基金保证费逐日累计至每月月末,按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的5个工作日内向担保人支付保证费。担保人收到款项后的10个工作日内向基金管理人出具合法发票。
保证费计算公式:
每日保证费计算公式=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。
九、基金管理人应在指定媒体上公告《"广发聚祥保本混合型证券投资基金保证合同"》。
十、《保证合同》的主要内容
《保证合同》的当事人包括基金管理人、担保人和基金份额持有人。基金投资者自依《基金合同》取得基金份额,即成为基金份额持有人和《保证合同》的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对《保证合同》的承认、接受和同意。
1、保证的范围和最高限额
1.1 本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本额为:基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额,即基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。
1.2 担保人承担保证责任的金额即保证范围为:在保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积(即"认购并持有到期的基金份额的可赎回金额")加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于保本额的部分。
1.3 基金份额持有人申购、转换入的基金份额,以及基金持有人认购的基金份额在保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的部分不在保证范围之内,且担保人承担保证责任的最高限额不超过按《基金合同》生效之日确认的基金份额所计算的保本额。
1.4 保本周期到期日是指本基金保本周期(如无特别指明,保本周期即为本基金第一个保本周期)届满的最后一日。本基金的保本周期为三年,自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日。
2、保证期间
保证期间为基金保本周期到期日起六个月。
3、保证的方式
在保证期间,本担保人在保证范围内承担不可撤销的连带责任保证。
4、适用法律及争议解决方式
本保证合同适用中华人民共和国法律。发生争议时,各方应通过协商解决;协商不成的,任何一方可向北京的中国国际经济贸易仲裁委员会提起仲裁,仲裁裁决为终局的,并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

第十一部分 基金的投资

一、保本周期内的投资
(一)投资目标
在力争保本周期到期时本金安全的前提下,严格控制风险,谋求基金资产的稳定增值。
(二)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,包括国内依法发行交易的债券、A股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、货币市场工具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,但须符合中国证监会的相关规定。
本基金将按照恒定比例组合保险(Constant-Proportion Portfolio Insurance,CPPI)机制将资产配置于安全资产与风险资产。恒定比例组合保险机制的基本思想为:将扣除一般费用和开支的基金资产分为两个部分,一部分是将较大比例的资金投入到债券和货币市场工具上,以期获得稳定的回报,称为安全资产,另一部分是将少部分资金投入到股票等风险较高的投资工具上,以期获得潜在的超额回报,称为风险资产。通过动态的调整资产配置的比例,将可能的风险资产损失锁定在一定范围内,同时追求其上涨时所带来的收益。
本基金的安全资产指固定收益类资产,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、金融债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券等债券,以及货币市场工具等;风险资产指股票、权证等权益类资产。基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产的0%-30%;债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的70%-100%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。
(三)投资理念
本基金遵循保本增值的投资理念,根据恒定比例组合保险机制进行资产配置,并通过严格的风险管理,在保本的前提下追求资本的增值。
(四)投资策略
1、资产配置策略
在资产配置上,本基金主要根据恒定比例组合保险机制来动态调整安全资产和风险资产的配比。
恒定比例组合保险机制的原理可以用下面的模型加以说明:

该策略的具体实施方案如下:
(1)确定初始底线F0:通过预期的无风险收益水平计算期末目标价值(在本基金中该值为认购并持有到期的基金份额的投资金额)的现值,使得这部分资产到期后本利之和等于期末目标价值;此现值即为初始的底线F0;
(2)确定放大乘数M:放大乘数主要通过考察以下几方面因素进行选取并进行定期的重新评估与调整:
a.证券市场的运行情况;
b.基金资产的风险情况;
c.通过对历史行情的蒙特卡洛模拟得到的参考最优放大乘数。
(3)确定初始风险资产投资额度E0:底线与基金初始资产的差为初始安全垫;将初始安全垫放大一定的倍数后投资于风险资产,其余部分投资于安全资产;
(4)期间调整:根据本基金的投资情况计算新的安全垫,重新分配风险资产和安全资产比例。
举一个例子说明该策略:假设基金利用CPPI策略,期初投资100万元于股票和债券,投资期限为三年,放大乘数选为3。债券收益率为2.82%。

因此如果股票上涨,那么投资组合净值上涨,安全垫增大,更多的资金从债券转到股票;如果股票下跌,那么投资组合净值下跌,安全垫缩小,更多的资金从股票转到债券;但投资组合净值最多下跌至底线,即安全垫最多缩小为零,这时投资组合全部转换为债券,投资组合沿着底线增值,到期增至本金100万元,从而实现保本的目的。
基金管理人从两个方面对恒定比例组合保险机制进行了改进:
首先,本基金强调在股票市值上涨的时候,不过度追涨的策略。通过实时跟踪各类资产净值的变化情况计算各类资产的理论配比,当风险资产价值下跌时及时减仓,而当风险资产价值上升时,需要达到一定的幅度才开始增持,这样在保证执行保本策略的情况下,提高了安全性,降低了交易费用。
同时,本基金还将严密关注风险资产的风险敞口暴露情况。通过计算风险资产的VaR等风险指标值,将可能发生的损失控制在现有资产与底线的差值以内,从而能够避免由于风险资产仓位过重可能引起的潜在损失。
2、债券投资策略
本基金的债券投资根据投资策略不同分为两个部分,以免疫策略(Immunization Strategy)为主,通过构造投资组合,尽可能使债券组合避免市场利率波动带来的影响,保持收益的稳定性;以积极投资策略为辅,通过对经济周期和利率长期走势分析主动调整组合获取超额收益率;并且,由于债券仓位因投资组合整体策略而动态调整,本基金将选择流动性相对较好的债券作为投资品种,以期在买入和卖出时尽量降低冲击成本。
(1)免疫策略
所谓免疫策略,是指构造这样一种投资组合,使得投资组合的久期与投资期限相匹配,从而使得任何由利率变化引起的债券市场价格的波动能被再投资的回报(或损失)所弥补。免疫策略主要通过配置于久期与保本周期相匹配的债券来实现的。本基金将根据保本周期的剩余期限动态调整债券组合久期,有效地控制组合的利率风险,从而保证投资组合收益的稳定性。
(2)积极投资策略
在免疫策略的基础上,我们采用积极投资的策略对债券组合进行调整,以获取超额收益,其中的积极投资策略包括:
a.类属配置策略
由于不同类型的债券在经济周期中的表现差异很大,本基金以经济周期理论为基础,重点研究不同类别债券资产在经济周期内的变动规律,并根据对当前经济所在经济周期的判断,动态调整对不同类别债券资产的配置比例,并控制整体的风险水平。
b.利率投资策略
本基金通过对GDP、CPI、固定资产投资、国际收支等国民经济运行指标进行深入研究,分析宏观经济运行的可能情景,并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向,结合债券市场资金供求状况变化趋势及结构,对利率水平和收益率曲线形态在未来的变化趋势做出预测和判断,结合收益率曲线变化的预测,适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合,并动态调整。
c.个券选择策略
1)信用债
本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法,研究信用产品的信用基本面。债券研究员根据对当前国民经济所处的经济周期阶段的判断,分析发债主体的行业地位、发展趋势、财务状况以及债券的增信方式等情况,并参考外部信用评级机构的评级结果,对该债券的信用级别进行综合评价,并以此作为信用债券投资的重要依据。
本基金还将紧密捕捉银行间市场和交易所市场的分割带来的套利机会、一二级债券市场的收益率利差带来的投资机会等,同时密切跟踪国外信用债券的最新发展规律和重要研究成果,深化对国内信用利差变动的认识,通过调整本基金组合内信用产品在信用等级和剩余期限方面的分布,获取最大化的风险加权回报。
2)可转债
可转债兼顾固定收益债券的稳定收益特点,以及标的权益可能的上升空间,在某些市场阶段可以有效的抵御债券市场系统性风险,提高组合收益。
本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性,以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益。本基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等。
3)资产支持证券
资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、支持证券的构成及质量等多种因素的影响。目前资产支持证券的流动性及市场对其认可度还有待提高,本基金将密切关注资产支持证券市场的发展,通过定量与定性相结合的研究方法,确定其投资价值。
3、股票投资策略
(1)新股投资策略
本基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择参与标的、参与规模和退出时机,并通过深入分析新股上市公司的基本面情况,结合新股发行当时的市场环境,根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格,指导新股询价,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高收益。
(2)二级市场股票投资策略
本基金通过GARP投资法选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资,控制流动性风险和非系统性风险,追求股票投资组合的长期稳定增值。
本基金股票投资采用备选库制度,本基金的备选库包括一级库和二级库。
1) 一级库的构建
一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围,入选条件主要是根据广发企业价值评估体系,通过研究,筛选出基本面良好的股票进入一级库。广发企业价值评估体系对企业价值的考察重点包括:企业财务状况、经营管理状况、竞争力优势及所处行业环境。
2)二级库的构建
二级股票库为本基金的风格库。本基金通过GARP投资法从一级股票库中选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资,控制流动性风险和非系统性风险,追求股票投资组合的长期稳定增值。
GARP投资法重视投资价值与成长潜力的平衡,一方面利用价值投资标准筛选低价股票,避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险;另一方面,利用成长性投资可分享高成长的机会。
二级库的股票主要选择标准包括:(1)成长性,通过对宏观经济、产业政策、行业景气和公司经营管理等方面的综合分析,结合净资产收益率、收入和利润的增长速度等指标,筛选出具有预期高成长性的公司;(2)PEG指标,在成长性分析的基础上,采用PEG指标做进一步的筛选分析,并结合PE、PB等其它指标,以及公司和行业等因素进行综合考虑,以准确把握公司的增长潜力;(3)其它因素,包括公司治理、外部环境、竞争优势、创新能力等。
3)构建股票组合
在二级库的基础上,根据投资程序,基金经理小组通过对个股价格趋势和市场时机的判断,进行最终的股票组合构建。
4、权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具,本基金可以主动投资于权证,其投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的;同时,充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会,实现基金资产的增值。在权证投资中,本基金将对权证标的证券的基本面进行研究,综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素,对权证进行定价。
(五)业绩比较基准
本基金业绩比较基准:3年期银行定期存款税后收益率。
采用该业绩比较基准主要基于如下考虑:
本基金是保本混合型基金,保本周期为三年,保本但不保证收益。目前,银行定期存款类似于保本定息产品。根据本基金的投资策略、保本期限和目标客户等特点,以3年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,不仅可以合理的衡量本基金保本的有效性,还能使本基金保本受益人理性判断本基金产品的风险收益特征。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、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业绩基准的指数时,本基金管理人可以与基金托管人协商一致,在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
(六)风险收益特征
本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
二、转型后的"广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金"的投资
(一)投资目标
通过对权益类资产及固定收益类资产的合理配置和积极管理,谋求基金资产的稳健增值。
(二)投资范围
该基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行交易的A股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)、权证、货币市场工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。若法律法规或监管机构以后允许该基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。
该基金为混合型基金,基金的资产配置比例范围为:股票、权证等权益类资产占基金资产的30%-80%;债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的20%-70%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。
(三)投资理念
该基金在把握宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,对各类资产和证券进行深入分析,精选出权益类和固定收益类品种进行组合投资,为投资者追求稳定的资本增值。
(四)投资策略
1、资产配置策略
该基金根据宏观及市场分析结果,并综合考虑基金投资目标、风险控制要求等因素,确定该基金各类资产的比例。
在资产配置方面,该基金关注的主要指标有:

	关注重点
宏观经济环境	季度GDP及其增长速度,月度工业增加值及其增长率,月度居民消费价格指数,工业品价格指数,月度进出口数据,货币供应量(M0,M1,M2)的增长率
政策环境	国家财政政策,货币政策,产业政策等
市场资金环境	资金需求因素:IPO、增发、配售等所需资金量; 资金供给因素:居民储蓄进行证券投资的增量,基金、券商自营、QFII新增投资额等; 市场利率、汇率等反映资金供求变动的相关指标

2、股票投资策略
(1)新股投资策略
该基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择参与标的、参与规模和退出时机,并通过深入分析新股上市公司的基本面情况,结合新股发行当时的市场环境,根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格,指导新股询价,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高收益。
(2)二级市场股票投资策略
该基金通过GARP投资法选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资,控制流动性风险和非系统性风险,追求股票投资组合的长期稳定增值。
该基金股票投资采用备选库制度,该基金的备选库包括一级库和二级库。
1)一级库的构建
一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围,入选条件主要是根据广发企业价值评估体系,通过研究,筛选出基本面良好的股票进入一级库。广发企业价值评估体系对企业价值的考察重点包括:企业财务状况、经营管理状况、竞争力优势及所处行业环境。
2)二级库的构建
二级股票库为该基金的风格库。该基金通过GARP投资法从一级股票库中选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资,控制流动性风险和非系统性风险,追求股票投资组合的长期稳定增值。
GARP投资法重视投资价值与成长潜力的平衡,一方面利用价值投资标准筛选低价股票,避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险;另一方面,利用成长性投资可分享高成长的机会。
二级库的股票主要选择标准包括:①成长性,通过对宏观经济、产业政策、行业景气和公司经营管理等方面的综合分析,结合净资产收益率、收入和利润的增长速度等指标,筛选出具有预期高成长性的公司;②PEG指标,在成长性分析的基础上,采用PEG指标做进一步的筛选分析,并结合PE、PB等其它指标,以及公司和行业等因素进行综合考虑,以准确把握公司的增长潜力;③其它因素,包括公司治理、外部环境、竞争优势、创新能力等。
3)构建股票组合
在二级库的基础上,根据投资程序,基金经理小组通过对个股价格趋势和市场时机的判断,进行最终的股票组合构建。
3、债券投资策略
该基金可投资于国债、央行票据、企业债、公司债、金融债、资产支持证券和可转换债券等债券品种。该基金将采取主动投资的策略,通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现价值低估的品种,把握投资机会;在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下,力争为投资者获得稳定的收益。
在债券投资上,该基金将对中长期利率走势进行深入研究和预测,结合对宏观经济运行周期、国家宏观调控政策变化等的研判,主动调整组合获取超额收益,其中的主动投资策略包括:(1)类属配置策略,该基金以经济周期理论为基础,重点研究不同类别债券资产在经济周期内的变动规律,并根据对当前经济所在经济周期的判断,动态调整对不同类别债券资产的配置比例,并控制整体的风险水平;(2)利率投资策略,根据宏观经济分析、宏观经济政策判断,结合债券市场资金供求状况变化趋势及结构,对利率水平和收益率曲线形态在未来的变化趋势做出预测和判断,具体包括久期控制策略、收益率曲线配置策略和骑乘策略;(3)个券选择策略:在信用债方面,该基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法,对债券的信用级别进行综合评价,并以此作为信用债券投资的重要依据;可转债方面,该基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等;此外,该基金将密切关注资产支持证券市场的发展,通过定量与定性相结合的研究方法,确定其投资价值。
4、权证投资策略
权证为该基金辅助性投资工具,该基金可以主动投资于权证,其投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。该基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的;同时,充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会,实现基金资产的增值。在权证投资中,该基金将对权证标的证券的基本面进行研究,综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素,对权证进行定价。
(五)业绩比较基准
该基金业绩比较基准:55%×沪深300指数+45%×中证全债指数。
沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成分股指数,覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。因此,股票部分的业绩基准采用沪深300指数;固定收益部分的业绩基准则采用了市场上通用的中证全债指数。此外,本基金还按照预期的大类资产平均配置比例设置了业绩基准的权重。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、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该基金业绩基准的指数时,基金管理人可以与基金托管人协商一致,在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
(六)风险收益特征
该基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。
三、投资决策依据和投资程序
(一)决策依据
以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。
(二)决策程序
1、投资决策委员会制定整体投资战略。
2、固定收益部根据自身或者其他研究机构的研究成果,形成宏观经济形势分析、利率走势预测、债种配置建议等,为债券决策提供支持。研究发展部的行业及公司研究员深入分析行业和上市公司的基本面情况,为股票组合构建提供建议。
3、基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,根据投研联席会议的决议,结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、债券投资和个股投资方案。
4、投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。
5、根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由交易部执行。
6、交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理小组。
7、基金绩效评估及风险管理小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险,定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。
四、投资限制
(一)禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:
1、承销证券;
2、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债券;
6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
8、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。
如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。
(二)投资组合限制
本基金的投资组合将遵循以下限制:
1、持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;
2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
3、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%。债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
4、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%,基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;
5、现金和到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%;
6、本基金投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。本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个月内全部卖出;
7、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%;
8、本基金持有的同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%;
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、本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不超过本基金的总资产,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;
12、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;
13、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。
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约定。如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。
由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。
五、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法
1、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;
2、有利于基金资产的安全与增值;
3、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;
4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益。
六、基金的融资融券
本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。
七、基金管理人和基金经理的承诺
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《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。

第十二部分 基金的财产

一、基金资产总值
基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。
其构成主要有:
1、银行存款及其应计利息;
2、结算备付金及其应计利息;
3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息;
4、应收证券交易清算款;
5、应收申购款;
6、股票投资及其估值调整;
7、债券投资及其估值调整和应计利息;
8、权证投资及其估值调整;
9、其他投资及其估值调整;
10、其他资产等。
二、基金资产净值
基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。
三、基金财产的账户
本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户用于基金的资金结算业务,并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并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金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、基金托管人和基金代销机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产;基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或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、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有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。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处分。
基金管理人管理运作基金财产所产生的债权,不得与其固有资产产生的债务相互抵销;基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

第十三部分 基金资产的估值

一、估值目的
基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值,依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值,是计算基金申购与赎回价格的基础。
二、估值日
本基金的估值日为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。
三、估值对象
基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。
四、估值程序
基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后,将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人,基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核,复核无误后,以双方认可的方式发送给基金管理人;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、估值方法
本基金按以下方式进行估值:
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,按最近交易日的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,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。
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。
根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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。
六、基金份额净值的确认和估值错误的处理
基金份额净值的计算保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时,基金管理人应当立即纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应报中国证监会备案;当估值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,并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的,应先由基金管理人承担,基金托管人对不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。
关于差错处理,本合同的当事人按照以下约定处理:
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、或代理销售机构、或投资者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的当事人("受损方")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、无法避免、无法抗拒,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者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,由差错责任方承担;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)差错的责任方对可能导致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经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资产损失时,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资产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿。
(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、行政法规、《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的交易数据的,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;
(5)基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当报告中国证监会;基金管理人及基金托管人基金份额净值计算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并报中国证监会备案。
七、暂停估值的情形
1、与本基金投资有关的证券交易场所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、中国证监会认定的其他情形。
八、特殊情形的处理
1、基金管理人按估值方法的第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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,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,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

第十四部分 基金的收益与分配

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未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。
三、基金收益分配原则
1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;
2、本基金收益分配方式:
(1)保本周期内:仅采取现金分红一种收益分配方式,不进行红利再投资;
(2)基金转型后:基金收益分配方式分为两种,现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;投资者在不同销售机构可以选择不同的收益分配方式,在同一销售机构只能选择一种收益分配方式,基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的收益分配方式为准;
3、基金收益分配后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;
4、每一基金份额享有同等分配权;
5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。
四、收益分配方案
基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。
五、收益分配方案的确定、公告与实施
本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。
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止日)的时间不得超过15个工作日。
六、基金收益分配中发生的费用
基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

第十五部分 基金费用与税收

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。
二、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
在保本周期内,本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2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、公休假等,支付日期顺延。
在保本周期内,本基金的保证费用从基金管理人的管理费收入中列支。
2、基金托管人的托管费
在保本周期内,本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人将所持有本基金份额转为转型后的"广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金"的基金份额,管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。
上述一、基金费用的种类中第3-8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
三、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、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;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
四、费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。
五、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十六部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策
1、基金管理人为本基金的基金会计责任方;
2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果《基金合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度;
3、基金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会计制度;
5、本基金独立建账、独立核算;
6、基金管理人及基金托管人各自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、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。
二、基金的年度审计
1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
2、会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

第十七部分 基金的信息披露

一、本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。
二、信息披露义务人
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。
本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,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应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称"网站")等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。
三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:
1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
2、对证券投资业绩进行预测;
3、违规承诺收益或者承担损失;
4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
6、中国证监会禁止的其他行为。
四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。
本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。
五、公开披露的基金信息
公开披露的基金信息包括:
(一)《基金招募说明书》、《基金合同》、《托管协议》
基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、《托管协议》登载在网站上。
1、《基金招募说明书》应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金管理人在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上;基金管理人将在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。
2、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。
3、《托管协议》是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。
(二)《发售公告》
基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制《发售公告》,并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。
(三)《基金合同》生效公告
基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。
(四)基金资产净值、基金份额净值
《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。
在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。
基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。
(五)基金份额申购、赎回价格
基金管理人应当在《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。
(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告
基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。
基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。
基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体上。
《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。
基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。
(七)临时报告
(下转D12版)