(上接D13版)

建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门,不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险。

(3)建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险。

(4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决策。

(5)建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

(6)使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失。

(7)提供足够的培训

制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:胡怀邦
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200336
注册时间:1987年3月30日
注册资本:562.59亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:张咏东
电话:021-32169999

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市,是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。根据英国《银行家》杂志公布的2009年全球1000家银行排名,交通银行总资产排名位列第56位,一级资本排名位列第49位。截止2010年12月末,交通银行资产总额超过人民币3.95万亿元,2010年实现净利润人民币390.42亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

牛锡明先生,交通银行行长,哈尔滨工业大学经济学硕士,高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生,交通银行副行长,主管交通银行资产托管业务,南开大学经济学博士,高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长,交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士,交通银行资产托管部总经理。大学学历,经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长;2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理,2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理,2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止2011年3月末,交通银行共托管证券投资基金52只,包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票。此外,还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品,托管资产规模超过七千亿元。

二、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定,加强内部管理,保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行,通过对各种风险的梳理、评估、监控,有效地实现对各项业务风险的监控和管理,确保业务稳健运行,保护基金持有人的合法权益。

2、内部控制原则

(1)全面性原则:通过各个处室自我监控和专门内控处室的风险监控的内部控制机制覆盖各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节,建立全面的风险管理监督机制。

(2)独立性原则:交通银行资产托管部独立负责受托基金资产的保管,保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立,对不同的受托基金分别设置账户,独立核算,分账管理。

(3)制衡性原则:贯彻适当授权、相互制约的原则,从组织结构的设置上确保各处室和各岗位权责分明、相互牵制,并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

(4)有效性原则:在岗位、处室和内控处室三级内控管理模式的基础上,形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制,通过行之有效的控制流程、控制措施,建立合理的内控程序,保障内控管理的有效执行。

(5)效益性原则:内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应,尽量降低经营运作成本,以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规,基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度,确保基金托管业务运行的规范、安全、高效,包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部内部风险控制制度》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》、《交通银行资产托管部监察守则》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理,技术系统完整独立,业务管理制度化,核心作业区实行封闭管理,有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制,为了保障内控管理的有效执行,聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行内部控制评审。

三、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《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定,基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为,应当及时通知基金管理人予以纠正,基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权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及时纠正的,基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,须立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构
名称:博时基金管理有限公司
住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
办公地址:北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层
电话:010-65187055
传真:010-65187032
联系人:尚继源
全国统一客服热线:95105568(免长途费)

2、网下现金发售代理机构
详见基金份额发售公告。

3、网下股票发售代理机构
详见基金份额发售公告。

4、网上现金发售代理机构
详见基金份额发售公告。

5、基金管理人可根据有关法律法规,变更、增减发售本基金的代理机构,并及时公告。

二、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:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电 话:0755-25946013
传 真:0755-25987122
联系人:严峰

三、律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
电话:021- 31358666
传真:021- 31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬

四、会计师事务所和经办注册会计师
机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址: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:上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法人代表:杨绍信
电话:021-61238888
传真:021-61238800
联系人:张鸿
经办注册会计师:汪棣、张鸿

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》、基金合同及其他有关规定募集本基金,并于2011年4月6日经中国证监会证监许可[2011]498号文核准募集。

一、基金名称

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

二、基金类型

股票型证券投资基金

三、基金存续期限

不定期

四、募集方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式:

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购;

网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购;网下股票认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行的认购。

五、募集期限

本基金的募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。具体募集时间详见本基金份额发售公告。

如果在募集期间未达到本招募说明书第七部分第(一)款规定的基金备案条件,基金可在募集期限内继续销售,直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

六、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和机构投资者以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。

七、募集场所

投资人应当在基金管理人及其指定的发售代理机构办理基金发售业务的营业场所或按基金管理人、发售代理机构提供的其他方式办理基金的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的地区、网点的具体情况和联系方法,请参见本基金发售公告以及当地发售代理机构的公告。

基金管理人可以根据情况增减或变更发售代理机构,并另行公告。

八、基金份额面值、认购价格

本基金每份基金份额的初始面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

九、认购开户

投资人认购本基金时需具有深圳证券账户,深圳证券账户是指深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户。

如投资人需新开立深圳证券账户,则应注意:

1、基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资人需要参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立深圳A股账户;

2、投资者开立深圳A股账户,需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳证券交易所A股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法,请到各开户网点详细咨询有关规定。

如投资人已开立深圳证券账户,则不必再办理开户手续。

十、认购费用

认购费用由投资者承担,不高于1.00%,认购费率如下表所示:

认购份额	认购费率
50万份以下	0.80%
50万份以上(含)—100万份以下	0.50%
100万份以上(含)	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

十一、网上现金认购

1、认购时间详见本基金份额发售公告。

2、认购限额:网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为1000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资人可多次认购,累计认购份额不设上限。

3、认购手续:投资人在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。

4、认购金额和利息折算的份额的计算:

本基金认购金额的计算如下:

认购金额=认购价格×认购份额×(1+佣金比率)

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

净认购金额=认购价格×认购份额

现金认购款项在基金募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额=利息/认购价格

其中,认购价格为基金份额的初始面值。

5、清算交收:T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请,由该发售代理机构于T+1日与登记结算机构进行清算交收,登记结算机构于网上现金认购结束后的第4个工作日将实际到位的认购资金划往托管人的结算备付金账户。

6、认购确认:在募集期结束后4个工作日之后,投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十二、网下现金认购

1、认购时间详见本基金份额发售公告。

2、认购金额和利息折算的份额的计算:

通过基金管理人进行网下现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购费用、认购金额的计算公式为:

认购费用=认购份额×基金份额面值×认购费率

认购金额=认购份额×基金份额面值×(1+认购费率)

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/基金份额面值

其中:认购费用由基金管理人在投资人认购确认时收取,投资人须以现金方式交纳认购费用。

通过发售代理机构进行网下现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购佣金和认购金额的计算公式为:

认购金额=认购份额×基金份额面值×(1+佣金比率)

认购佣金=认购份额×基金份额面值×佣金比率

3、认购限额:网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额须为1000份或其整数倍;投资人通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份),超过部分须为1万份的整数倍,投资人可多次认购,累计认购份额不设上限。

4、认购手续:投资人在认购本基金时,需按销售机构的规定,到销售网点办理相关认购手续,并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5、清算交收:通过基金管理人提交的网下现金认购申请,由基金管理人负责清算交收。现金认购款项在发行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,认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请,由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日,各发售代理机构将每一个投资人账户提交的网下现金认购申请汇总后,通过深圳证券交易所上网定价发行系统代该投资人提交网上现金认购申请。之后,登记结算机构进行清算交收,并将实际到位的认购资金划往托管人的结算备付金账户。

6、认购确认:在募集期结束后4个工作日之后,投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十三、网下股票认购

1、认购时间详见本基金份额发售公告。

2、认购限额:网下股票认购以单只股票股数申报,用于认购的股票必须是深证基本面200指数的成份股和已经公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1000股,超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资人可多次提交认购申请,累计申报股数不设上限。

3、认购手续:投资人在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,到代售网点办理认购手续,并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤消。

4、特殊情形

特殊情形包括但不限于以下几种情况:

(1)已经公告的即将被调出深证基本面200指数的成份股不得用于认购本基金;

(2)限制个股认购规模:基金管理人可根据网下股票认购日前3个月的个股的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个股认购规模进行限制,并在网下股票认购日前至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单;

(3)临时拒绝个股认购:对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股,基金管理人可不经公告,全部或部分拒绝该股票的认购申报。

5、清算交收

认购期内每日日终,发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人。网下股票认购最后一日日终,基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据将投资人账户内相应的股票进行冻结。基金募集期结束后,基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的认购佣金,并从投资人的认购份额中扣除,然后将扣除的认购佣金以基金份额的形式返还给发售代理机构。登记结算机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记,并根据基金管理人报深圳证券交易所确认的有效认购申请股票数据,将投资人申请认购的股票过户到基金的证券账户。

6、网下股票认购份额的计算公式

$$认购份额=\sum_{i=1}^{n}(第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量)/基金份额面值$$

其中:

(1)i代表投资人提交认购申请的第i只股票,如投资人仅提交了1只股票的申请,则i=1;i≤200。

(2)"第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价"由本基金管理人根据深圳证券交易所的当日行情数据,以该股票的总成交金额除以总成交股数计算,以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交,则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某只股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日期间发生了除息、送股(转增)、配股等权益变动,由于投资人获得了相应的权益,基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整:

1)除息:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

2)送股:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/(1+每股送股比例)

3)配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股配股比例)

4)送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

5)除息、送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

(3)"有效认购数量"是指由基金管理人确认的并由登记结算机构完成清算交收的股票股数。其中:

1)对于经公告限制认购规模的个股,基金管理人可确认的认购数量上限为:

$$q_i^{max}=(Cash+\sum_{j=1}^{n}p_j q_j)\times 10.5\%\times w_i/p_i$$

[illegible]

[illegible]

[illegible]

[illegible]

[illegible]

[illegible]

2)若某只股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生了司法执行,基金管理人将根据登记结算机构发送的解冻数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

十四、募集资金利息与募集股票权益的处理方式

募集期间现金认购的利息折成份额后归投资人所有。募集股票在冻结期间的权益归投资者所有。

十五、募集期间的资金、股票与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用;募集的股票由发售代理机构予以冻结,于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

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。

第七部分 基金的备案

一、基金备案的条件

基金募集期届满,本基金具备下列条件的,基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续:

1、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;

2、基金份额持有人的人数不少于200人。

基金募集期内,本基金具备上述条件的,基金管理人可以决定停止基金发售,并按照规定办理验资和基金备案手续。

二、基金的备案

基金管理人应当自基金募集期届满之日或停止基金发售之日起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。

三、基金合同的生效

1、自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕且基金合同生效;

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告;

3、本基金募集期届满之日前,投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户,任何人不得动用。募集的股票由发售代理机构予以冻结,于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

四、基金募集失败的处理方式

基金募集期届满,未达到基金的备案条件,或因不可抗力使基金合同无法生效,则基金募集失败。基金管理人应当:

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日内返还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息,同时将已冻结的股票解冻。

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,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和报送解决方案。

法律法规另有规定的,按其规定办理。

第八部分 基金份额的交易

一、基金上市

基金合同生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》,向深圳证券交易所申请基金份额上市:

1、基金募集金额(含募集股票市值)不低于2亿元;

2、基金份额持有人不少于1000人;

3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前,基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的,基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

本基金的基金份额在深圳证券交易所的上市交易须遵照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》,以及《深圳证券交易所交易规则》等有关规定。

三、暂停上市交易

基金份额上市交易期间出现下列情形之一的,深圳证券交易所可暂停基金的上市交易,并报中国证监会备案:

1、不再具备本章第一款规定的上市条件;

2、违反法律、行政法规,中国证监会决定暂停其上市;

3、严重违反深圳证券交易所有关规则的;

4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

四、终止上市交易

基金份额上市交易后,有下列情形之一的,深圳证券交易所可终止基金的上市交易,并报中国证监会备案:

1、暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;

2、基金合同终止;

3、基金份额持有人大会决定终止上市;

4、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内发布基金终止上市公告。

若因上述1、4项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的,本基金将由交易型开放式基金变更为以深证基本面200指数为标的的非上市的开放式指数基金。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金,则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

五、基金份额参考净值(IOPV)的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向深圳证券交易所提供当日的申购赎回清单,深圳证券交易所在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据,计算并发布基金份额参考净值(IOPV),供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

(1)基金份额参考净值的计算公式:

基金份额参考净值=(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额+申购赎回清单中可以用现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和+申购赎回清单中的预估现金部分)/最小申购赎回单位所对应的基金份额

(2)基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。

(3)基金管理人可以调整基金份额参考净值的计算公式,并予以公告。

第九部分 基金份额的申购与赎回

一、申购与赎回的场所

投资人应当在申购赎回代理券商的营业场所按申购赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。

本基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单,并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

二、申购与赎回办理的开放日及时间

1、申购、赎回的开始时间

本基金在基金上市交易之前可开始办理申购。但在基金申请上市期间,基金可暂停办理申购。

本基金自基金合同生效日后不超过3个月的时间起开始办理赎回。

具体申购、赎回的开始时间由基金管理人确定后,于申购开始日、赎回开始日的3个工作日前在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

2、开放日及开放时间

投资人可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日,开放时间为上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。

若深圳证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况,基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。

三、申购与赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式,即申购、赎回均以份额申请。

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

投资人须按申购赎回代理券商规定的手续,在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。

投资人申购本基金时,须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资人提交赎回申请时,必须持有足够的基金份额余额和现金。

2、申购与赎回申请的确认

基金投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价,则赎回申请失败。

3、申购和赎回的清算交收与登记

投资人T日申购、赎回成功后,登记结算机构在T日收市后为投资人办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算,在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算,在T+2日办理现金差额的交收,并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形,则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内,对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整,并最迟于开始实施日的3个工作日前在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

五、申购与赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金的最小申购赎回单位为150万份,基金管理人有权对其进行调整,并在调整实施前3个工作日于中国证监会指定的信息披露媒体公告。

六、申购与赎回的对价和费用

1、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时,基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。

申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。申购、赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

3、投资人在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

4、T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告,计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。

七、申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日的现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中,投资者按基金合同和招募说明书规定的原则,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

(1)现金替代分为3种类型:禁止现金替代(标志为"禁止")、可以现金替代(标志为"允许")和必须现金替代(标志为"必须")。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时,允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代,但在赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时,该成份证券必须使用现金作为替代。

(2)可以现金替代

1)适用情形:出于证券停牌等原因导致投资人无法在申购时买入证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

2)替代金额:对于可以现金替代的证券,替代金额的计算公式为:

替代金额=替代证券数量×该证券最新价格×(1+现金替代溢价比例)

其中,"最新价格"的确定原则包括但不限于:

①该证券正常交易时,采用最新成交价;

②该证券正常交易中出现涨停时,采用涨停价格;

③该证券停牌且当日有成交时,采用最新成交价;

④该证券停牌且当日无成交时,采用前一交易日收盘价(考虑当日的除权除息等因素),或采用公允价值。

收取现金替代溢价的原因是,对于使用现金替代的证券,基金管理人需在该部分证券恢复交易后买入,而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作,基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例,并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金买入该部分证券的实际成本,则基金管理人将退还多收取的差额;如果预先收取的金额低于基金买入该部分证券的实际成本,则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

3)替代金额的处理程序如下:

T日,基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例,并据此收取替代金额。

在T日后被替代的部分证券有正常交易的2个交易日(即T+2日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2日日终,若基金管理人已购入全部被替代的证券,则以替代金额与被替代证券的实际买入成本(包括买入价格和交易费用)的差额,确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项;若基金管理人未能购入全部被替代的证券,则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

特殊情况:若自T日起,深圳证券交易所正常交易日已达20日而该部分证券的正常交易日低于2日,则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

若现金替代日(T日)后至T+2日(在特殊情况下则为T日起的第20个正常交易日)期间被替代的证券发生除息、送股(转增)、配股,以及由于股权分置改革等发生的其他权益变动,则进行相应调整。

T+2日后的第1个市场交易日(在特殊情况下则为T日起的第21个市场交易日),基金管理人将应退款和应补款的明细及汇总数据发送给登记结算机构,相关款项的清算交收,将于此后3个工作日内完成。

4)替代限制:为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为:

$$现金替代比例(\%)=\frac{\sum_{i=1}^{n}第i只替代证券数量\times该证券最新价格}{申购基金份额\times最新基金份额参考净值(IOPV)}\times 100\%$$

(3)必须现金替代

1)适用情形:必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除的成份证券,或出于保护基金持有人利益等目的基金管理人认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

2)替代金额:对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金,即"固定替代金额"。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其T日预估开盘价。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指,为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金,由基金管理人计算的现金数额。

T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分,其计算公式为:

T日预估现金部分=T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值-(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额+申购赎回清单中可以用现金替代的所有成份证券的数量与其T日预估开盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代的所有成份证券的数量与其T日预估开盘价乘积之和)

其中,T日预估开盘价是对标的指数成份证券预估的开盘价。另外,若T日为基金分红除息日,则计算公式中的"T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值"需要扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告,其计算公式为:

T日现金差额=T日最小申购赎回单位的基金资产净值-(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额+申购赎回清单中可以用现金替代的所有成份证券的数量与其T日收盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代的所有成份证券的数量与其T日收盘价乘积之和)

T日投资人申购、赎回基金份额时,需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时,如现金差额为正数,则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金,如现金差额为负数,则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金;在投资人赎回时,如现金差额为正数,则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金,如现金差额为负数,则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购赎回清单的格式

T日申购赎回清单的格式举例如下:

基本信息	
最新公告日期	
基金名称	
基金管理公司名称	
一级市场基金代码	
T-1日信息内容	
现金差额(单位:元)	
最小申购赎回单位资产净值(单位:元)	
基金份额净值(单位:元)	
T日信息内容	
预估现金部分(单位:元)	
可以现金替代比例上限	
是否需要公布IOPV	
最小申购赎回单位(单位:份)	
申购、赎回的允许情况	
T日成份股信息内容	

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢比价率	固定替代金额
000001	深发展A		禁止		
000002	万科A		禁止		
000006	深振业A		禁止		
000009	中国宝安		禁止		
000012	南玻A		禁止		
000016	深康佳A		禁止		
000021	长城开发		禁止		
000024	招商地产		必须		固定金额
000027	深圳能源		禁止		
000028	一致药业		禁止		
000031	中粮地产		禁止		
000039	中集集团		禁止		
000042	深长城		禁止		
000043	中航地产		禁止		
000046	泛海建设		禁止		
000059	辽通化工		禁止		
000060	中金岭南		允许	8%	
000061	农产品		禁止		
000062	深圳华强		禁止		
000063	中兴通讯		禁止		
000066	长城电脑		禁止		
000069	华侨城A		禁止		
000088	盐田港		禁止		
000089	深圳机场		禁止		
000090	深天健		禁止		
000096	广聚能源		禁止		
000100	TCL集团		禁止		
000155	川化股份		禁止		
000157	中联重科		禁止		
000158	常山股份		禁止		
000301	东方市场		禁止		
000338	潍柴动力		禁止		
000400	许继电气		禁止		
000401	冀东水泥		禁止		
000402	金融街		禁止		
000410	沈阳机床		禁止		
000417	合肥百货		禁止		
000422	湖北宜化		禁止		
000423	东阿阿胶		禁止		
000425	徐工机械		禁止		
000429	粤高速A		禁止		
000488	晨鸣纸业		禁止		
000501	鄂武商A		禁止		
000513	丽珠集团		禁止		
000520	长航凤凰		禁止		
000527	美的电器		禁止		
000528	柳工		禁止		
000531	穗恒运A		禁止		
000538	云南白药		禁止		
000539	粤电力A		禁止		
000541	佛山照明		禁止		
000543	皖能电力		禁止		
000550	江铃汽车		禁止		
000554	泰山石油		禁止		
000559	万向钱潮		禁止		
000562	宏源证券		禁止		
000568	泸州老窖		禁止		
000572	海马股份		禁止		
000581	威孚高科		禁止		
000589	黔轮胎A		禁止		
000597	东北制药		禁止		
000599	青岛双星		禁止		
000600	建投能源		禁止		
000601	韶能股份		禁止		
000608	阳光股份		禁止		
000612	焦作万方		禁止		
000616	亿城股份		禁止		
000619	海螺型材		禁止		
000623	吉林敖东		允许	10%	
000625	长安汽车		禁止		
000630	铜陵有色		禁止		
000651	格力电器		禁止		
000652	泰达股份		禁止		
000659	珠海中富		禁止		
000666	经纬纺机		禁止		
000667	名流置业		禁止		
000677	山东海龙		禁止		
000680	山推股份		禁止		
000683	远兴能源		禁止		
000685	中山公用		禁止		
000686	东北证券		禁止		
000690	宝新能源		禁止		
000698	沈阳化工		禁止		
000701	厦门信达		禁止		
000708	大冶特钢		禁止		
000709	河北钢铁		禁止		
000717	韶钢松山		禁止		
000718	苏宁环球		禁止		
000725	京东方A		禁止		
000726	鲁泰A		禁止		
000728	国元证券		禁止		
000729	燕京啤酒		禁止		
000731	四川美丰		禁止		
000755	山西三维		禁止		
000758	中色股份		禁止		
000759	武汉中百		禁止		
000761	本钢板材		禁止		
000767	漳泽电力		禁止		
000768	西飞国际		禁止		
000778	新兴铸管		禁止		
000780	平庄能源		禁止		
000783	长江证券		禁止		
000786	北新建材		禁止		
000792	盐湖钾肥		允许	15%	
000793	华闻传媒		禁止		
000800	一汽轿车		禁止		
000807	云铝股份		禁止		
000822	山东海化		禁止		
000823	超声电子		禁止		
000825	太钢不锈		禁止		
000828	东莞控股		禁止		
000829	天音控股		禁止		
000830	鲁西化工		禁止		
000839	中信国安		禁止		
000850	华茂股份		禁止		
000852	江钻股份		禁止		
000858	五粮液		禁止		
000860	顺鑫农业		禁止		
000869	张裕A		禁止		
000876	新希望		禁止		
000877	天山股份		禁止		
000878	云南铜业		禁止		
000895	双汇发展		禁止		
000898	鞍钢股份		禁止		
000900	现代投资		禁止		
000903	云内动力		禁止		
000905	厦门港务		禁止		
000910	大亚科技		禁止		
000911	南宁糖业		禁止		
000912	泸天化		禁止		
000913	钱江摩托		禁止		
000916	华北高速		禁止		
000917	电广传媒		禁止		
000918	嘉凯城		禁止		
000919	金陵药业		禁止		
000926	福星股份		禁止		
000927	一汽夏利		禁止		
000932	华菱钢铁		禁止		
000933	神火股份		禁止		
000936	华西村		禁止		
000937	冀中能源		禁止		
000939	凯迪电力		禁止		
000949	新乡化纤		禁止		
000950	建峰化工		禁止		
000951	中国重汽		禁止		
000959	首钢股份		禁止		
000960	锡业股份		禁止		
000961	中南建设		禁止		
000963	华东医药		禁止		
000966	长源电力		禁止		
000968	煤气化		禁止		
000969	安泰科技		禁止		
000970	中科三环		禁止		
000973	佛塑股份		禁止		
000983	西山煤电		禁止		
000987	广州友谊		禁止		
000989	九芝堂		禁止		
000999	华润三九		禁止		
001696	宗申动力		禁止		
002001	新和成		禁止		
002007	华兰生物		禁止		
002008	大族激光		禁止		
002011	盾安环境		禁止		
002024	苏宁电器		禁止		
002028	思源电气		禁止		
002048	宁波华翔		禁止		
002051	中工国际		禁止		
002056	横店东磁		禁止		
002062	宏润建设		禁止		
002069	獐子岛		禁止		
002078	太阳纸业		禁止		
002082	栋梁新材		禁止		
002083	孚日股份		禁止		
002091	江苏国泰		禁止		
002092	中泰化学		禁止		
002106	莱宝高科		禁止		
002110	三钢闽光		禁止		
002122	天马股份		禁止		
002128	露天煤业		禁止		
002142	宁波银行		禁止		
002146	荣盛发展		禁止		
002152	广电运通		禁止		
002155	辰州矿业		禁止		
002191	劲嘉股份		禁止		
002194	武汉凡谷		禁止		
002202	金风科技		禁止		
002203	海亮股份		禁止		
002233	塔牌集团		禁止		
002242	九阳股份		禁止		
002244	滨江集团		禁止		
002251	步步高		禁止		
002254	烟台氨纶		禁止		
002267	陕天然气		禁止		
002269	美邦服饰		禁止		
002275	桂林三金		禁止		
002304	洋河股份		禁止		
002311	海大集团		禁止		
002314	雅致股份		禁止		
002336	人人乐		禁止		
002386	天原集团		禁止		

八、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下,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或基金管理人无法接受投资人的申购申请;

(2)证券交易场所在交易时间内非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3)深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购;

(4)发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况;

(5)基金管理人有正当理由认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时;

(6)法律法规、深圳证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述(1)、(2)、(3)、(4)项情形时,基金管理人应根据有关规定在指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停申购公告。

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、在如下情况下,基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请:

(1)因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项;

(2)证券交易场所在交易时间内非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3)深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理赎回;

(4)发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况;

(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,基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案并予以公告。

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。

九、集合申购与其他服务

在条件允许时,基金管理人可开放集合申购,即允许多个投资人集合其持有的组合证券,共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍,进行申购。

基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务,双方需签订书面委托代理协议,并报中国证监会备案。

十、联接基金的投资

本基金的联接基金可投资于本基金,与本基金跟踪同一标的指数。

十一、基金的非交易过户、冻结、解冻等其他业务

基金的登记结算机构可依据其业务规则,受理基金的非交易过户、冻结与解冻等业务,并收取一定的手续费用。

第十部分 基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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)。如法律法规或监管机构以后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。

在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

三、标的指数

深证基本面200指数。

该指数属于价格指数。

四、投资策略

本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具,包括融资融券等。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策,以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整及基金每日申购赎回清单的编制等决策。

3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合,构成了本基金的投资管理程序。

(1)研究。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台,整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果,开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本基金投资决策的重要依据;

(2)投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告,定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会议,对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议,做出基金投资管理的日常决策;

(3)组合构建。结合研究报告,基金经理主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下,基金经理可采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险;

(4)交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行,交易部同时履行一线监控的职责;

(5)投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估,并撰写相关的绩效评估报告,确认基金组合是否实现了投资预期,投资策略是否成功,并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略,如果需要,亦对投资组合进行相应的调整;

(下转D15版)