上投摩根强化回报债券型证券投资基金招募说明书

(上接 D11 版)

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券,应事先根据中国证监会相关规定,明确基金投资流通受限证券的比例,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。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1)本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管,并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下,基金管理人负责相关工作的落实和协调,并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题,造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失,及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失,由基金管理人承担。

本基金投资受限证券,不得预付任何形式的保证金。

2)基金管理人投资非公开发行股票,应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施,以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算,并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3)本基金投资非公开发行股票,基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料,并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整,基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于:

(1)中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2)非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3)非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4)基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4)基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定,在合理期限内未能进行及时调整,基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书,予以公告。

5)基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督:

(1)本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

(2)在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3)有关比例限制的执行情况。

(4)信息披露情况。

6)相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的,从其规定。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时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在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

8、基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,由此造成的损失由基金管理人承担。

10、基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

(三)基金管理人对基金托管人的业务核查

1、基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

(四)基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

1)基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2)基金托管人应安全保管基金财产。

3)基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4)基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。

5)基金托管人根据基金管理人的指令,按照基金合同和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。

6)对于因为基金投资产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失,基金托管人对此不承担任何责任。

7)除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金募集期间及募集资金的验资

1)基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2)基金募集期满或基金停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户,同时在规定时间内,聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3)若基金募集期限届满,未能达到基金合同生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金银行账户的开立和管理

1)基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2)基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3)基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4)在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1)基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2)基金证券账户的开立和使用,仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户, 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3)基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4)基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作,基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5)若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开立、使用的,若无相关规定,则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

6、其他账户的开立和管理

1)因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2)法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外,基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同,基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人,并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

(五)基金收益与基金资产净值的计算与复核

1.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金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数,基金份额净值的计算,精确到 0.001 元,小数点后第四位四舍五入,国家另有规定的,从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,经基金托管人复核,按规定公告。

2.复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,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。

3.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,仍无法达成一致意见的,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)基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册,保存期不少于 15 年。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,不得无故拒绝或延误提供,并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

(七)争议解决方式和适用法律

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

(八)托管协议的修改与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

2、基金托管协议终止出现的情形

1)基金合同终止;

2)基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;

3)基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;

4)发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

二十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一)资料寄送

1.基金投资者对账单:

基金管理人将向发生交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送对账单。

2.其他相关的信息资料。

(二)多种收费方式选择

基金管理人在合适时机将为基金投资者提供多种收费方式购买本基金,满足基金投资者多样化的投资需求,具体实施办法见有关公告。

(三)基金电子交易服务

在未来市场和技术条件成熟时,基金管理人将为基金投资者提供基金电子交易服务。

(四)联系方式

上投摩根基金管理有限公司
咨询电话:4008894888
网址:www.51fund.com

二十一、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所,基金投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

二十二、备查文件

(一)中国证监会批准上投摩根强化回报债券型证券投资基金募集的文件
(二)上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同
(三)上投摩根强化回报债券型证券投资基金托管协议
(四)法律意见书
(五)基金管理人业务资格批件、营业执照
(六)基金托管人业务资格批件、营业执照
(七)上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则
(八)中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所,基金投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金份额发售公告

(上接 D9 版)

(24)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn
(25)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
客户服务电话:4008188118
网址:www.guodu.com
(26)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户咨询电话:025-84579897
联系人:张小波
联系电话:025-84457777-248
网址:www.htsc.com.cn
(27)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市招商银行大厦 A 层
办公地址:北京朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20
法定代表人:王东明
电话:010-84588888
传真:010-84865560
联系人:陈忠
客户服务热线:010-95558
(28)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:庞晓芸
客服电话:95513
公司网址:www.lhzq.com
(29)中国国际金融有限公司
注册地址: 北京市建国门外大街 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 27 层及 28 层
法定代表人:李剑阁
电话:010-65051166
传真:010-65051156
公司网址:www.cicc.com.cn
联系人:邓力伟
电话:021-58881690
(30)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
法定代表人:牛冠兴
客服电话:4008001001
公司网址:www.essence.com.cn

其他代销机构:如本次发售期间,新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另行公告。

9、直销机构和直销地点

上投摩根基金管理有限公司上海贵宾理财中心
地址:上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼(200120)
理财中心电话: 400 889 4888, (021)38794888
传真:(021)68881190
上投摩根基金管理有限公司北京贵宾理财中心
地址:北京市西城区金融街七号英蓝国际金融中心 19 层 1925 室(100034)
电话:010-58369199
传真:010-58369138
上投摩根基金管理有限公司深圳贵宾理财中心
地址:深圳市罗湖区深南东路 5001 号华润大厦 2705-07 室(518001)
电话:0755-82690060
传真:0755-82690104
上投摩根基金管理有限公司电子交易系统
www.51fund.com
全国统一客服热线:400 889 4888

9、发售时间安排与基金成立

本基金的发售时间自 2011 年 7 月 18 日起至 2011 年 8 月 5 日止。对于具体的募集期限,基金管理人可根据市场变化予以适当缩短。

本基金符合法定成立条件后,本基金可以宣布成立;发售时间内,本基金若未达到法定成立条件,基金管理人将延长发售时间并及时公告,但最长不超过法定募集期。

若募集期满,本基金仍未达到法定成立条件,则本基金不能成立,基金管理人将把已募集资金并加计银行同期活期存款利息在募集期结束后 30 天内退还给基金认购人。

10、基金认购方式与费率

(1)本基金采取金额认购的方式;

(2)本基金的认购费率为:

A 类基金份额

认购金额区间	费率
人民币 100 万以下	0.6%
人民币 100 万以上(含),500 万以下	0.3%
人民币 500 万以上(含)	每笔人民币 1,000 元

B 类基金份额的认购费率为 0

投资者重复认购,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

(3)基金份额的计算:

本基金认购份额的计算包括有效认购金额折算的基金份额加上申请认购总金额在募集期产生的利息折算的基金份额(利息具体数额以注册登记人的记录为准)。认购份数采取四舍五入的方法保留小数点后两位,由此产生的误差计入基金资产。利息折算份额不收认购手续费,也不受基金账户最低持有份额的限制。

认购份数的计算公式如下:

认购费用 = 认购金额/(1+认购费率)× 认购费率,对于 500 万元(含)以上的认购适用绝对数额的认购费金额

净认购金额 = 认购金额-认购费用

认购份额 = (净认购金额+利息)/ 基金份额面值

认购费用以人民币元为单位,四舍五入,保留小数点后二位;认购份数采取四舍五入的方法保留小数点后两位,由此产生的误差计入基金资产。认购费用不属于基金资产。

举例如下:

某投资者投资 10,000.00 元认购 A 类基金,假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 4.6 元,则其可得到的基金份数计算如下:

认购费用=10,000.00/(1+0.6%)×0.6%=59.64 元
净认购金额=10,000.00-59.64=9,940.36 元
认购份额=(9,940.36+4.6)/1.00=9,944.96 份

即投资者投资 10,000.00 元认购本基金,加上募集期间利息后一共可以得到 9,944.96 份基金份额。

二、发售方式及相关规定

1、发售期内本公司代销网点和本公司贵宾理财中心和电子交易系统将同时面向个人投资者和机构投资者发售本基金,本基金不设最高认购限额。

2、最低认购限额:在基金募集期内,投资者通过基金管理人的电子交易系统首次认购任一类别基金的单笔最低限额为人民币 1,000 元,追加认购任一类别基金的单笔最低限额为人民币 1,000 元;基金管理人的贵宾理财中心首次认购单笔最低限额为人民币 1,000,000 元;投资者通过代销机构首次认购的任一类别基金的单笔最低限额为人民币 1,000 元以上(含 1,000 元),追加认购任一类别基金的单笔最低限额为人民币 1,000 元。各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各代销机构的业务规定为准。

3、有效认购申请的确认方式

本基金不设募集上限,将对所有有效认购申请全部予以确认。

4、已购买过本公司管理的其它基金的投资者,在原开户机构的网点购买本基金时不用再次开立本公司基金账户卡,在新的销售机构网点购买本基金时,需先办理多渠道开户业务,此业务需提供原基金账号。

三、个人投资者的开户与认购程序

个人投资者可以在上投摩根基金管理有限公司贵宾理财中心、电子交易系统和建设银行、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国都证券有限责任公司 、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、安信证券股份有限公司指定基金代销网点办理基金账户开户、认购申请。

(一)通过建设银行办理开户和认购的程序

1、业务办理时间:基金发售日的 9:30~17:00。周六、日及法定节假日正常受理客户申请,该认购申请计入下一发售日;发售日每天 17:00 后客户发起的认购申请计入下一发售日。

2、开户程序及所需材料

(1)请事先办妥或持有中国建设银行理财卡或龙卡通并存入足额开户和认购资金;

(2)请到网点提交以下材料,办理开户手续,开立上投摩根基金管理有限公司的基金账户;

①本人有效身份证件原件(包括:居民身份证、军官证、士兵证等);

②本人的中国建设银行理财卡或龙卡通;

③填妥的“个人开通/取消证券交易申请表”。

(3)开户同时可办理认购手续,需填妥并提交“证券买入(基金认购/申购)委托单”。

3、认购程序及所需材料

(1)本人有效身份证件原件;

(2)填妥的“证券买入(基金认购/申购)委托单”。

4、注意事项

(1)请个人投资者本人到中国建设银行指定的代销网点办理开户和认购手续;

(2)有关详细的办理手续,请查阅代销网点摆放的《中国建设银行证券业务系统个人客户操作指南》。

通过其它银行办理开户和认购的程序及所需资料以该银行的具体业务规则为准。

(二)代销本基金的证券公司

以下程序原则上适用于代销本基金的证券公司,包括申银万国证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国都证券有限责任公司 、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中国国际金融有限公司 、安信证券股份有限公司。此程序仅供投资者参考,具体程序以各代销机构的规定为准,新增代销渠道的认购程序以有关公告为准。

1、业务办理时间:基金发售日的 9:30-15:00(周六、周日和法定节假日不办理)。

2、资金账户的开立:(已在该代销券商处开立了资金账户的客户不必再开立该账户)

个人投资者申请开立资金账户应提供以下材料:

(1)填妥的《资金账户开户申请表》;

(2)本人有效身份证明原件及复印件;

(3)营业部指定银行的存折(储蓄卡)。

3、基金账户的开立:个人投资者申请开立基金账户应提供以下材料:

(1)填妥的《开户申请表》;

(2)本人有效身份证件及复印件;

(3)在本代销机构开立的资金账户卡;

(4)营业部指定银行的存折(储蓄卡)。

4、提出认购申请:个人投资者在开立资金账户和基金账户并存入足额认购资金后,可申请认购本基金。个人投资者申请认购本基金应提供以下材料:

(1)填妥的《认购申请表》;

(2)本人有效身份证原件及复印件;

(3)在本代销机构开立的资金账户卡;投资者还可通过各代销券商的电话委托、自助/热自助委托、网上交易委托等方式提交认购申请。

5、注意事项:

(1)若有其他方面的要求,以各代销机构的说明为准。

(2)个人投资者需本人亲自到网点办理开户和认购手续。

(3)投资者认购时要注明所购买的基金名称或基金代码。

基金名称:“上投摩根强化回报债券型证券投资基金”、基金代码:“A 类 372010;B 类 372110”。

(三)上投摩根基金管理有限公司贵宾理财中心

1、开户和认购的时间

基金发售日的 9:30-17:00。周六、日及其他法定节假日正常受理客户申请,该认购申请计入下一发售日;发售日每天 17:00 后客户发起的认购申请计入下一发售日。

2、开户和认购的程序

(1)个人投资者办理基金账户开户申请时须提交下列材料:

◇有效身份证明文件原件;

◇指定银行收款账户证明;

◇填妥的经本人签字确认的《投资者风险承受能力调查表》

◇预留印鉴卡;

◇填妥的经本人签字确认的《账户业务申请表》。

个人投资者开立基金账户必须本人亲自办理;

委托他人代办的,还需提供经公证的委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。

本公司需要留存的材料为:有效身份证明文件复印件、填妥的经本人签字确认的申请表(第一联)、预留印鉴卡(二张)、委托代办书正本、代办人有效身份证明文件复印件、指定收款银行卡复印件、《投资者风险承受能力调查表》。

(2)个人投资者办理认购申请时须提交下列材料:

◇填妥的经本人签字确认的《交易业务申请表》。

委托他人代办的,还需提供委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。

销售机构需要留存的材料为:委托代办书及代办人有效身份证明文件复印件(委托他人代办时),填妥的经本人签字确认的申请表。

(3)认购资金的划拨

个人投资者办理认购前应将足额认购资金划入本公司指定的任一直销专户:

账户名称:上投摩根基金管理有限公司直销专户
帐 号:31001550400050002872
开户银行:中国建设银行上海市分行营业部
联行号:52364
人民银行大额支付系统联行号:105290036005
账户名称:上投摩根基金管理有限公司
帐 号:1001190729013313135
开户银行:中国工商银行上海市分行第二营业部
开户行交换号:001021907
联行号:20304018
人民银行大额支付系统联行号:102290019077
账户名称:上投摩根基金管理有限公司
帐 号:216089238510001
开户银行:招商银行上海分行营业部
联行号:096819
人民银行大额支付系统联行号:308290003020

3、注意事项

(1)以下将被认定为无效认购:

◇投资者已划付资金,但逾期未办理开户手续或开户不成功的;

◇投资者已划付资金,但逾期未办理认购手续的;

◇投资者已划付的认购资金少于其申请的认购金额的;

◇本公司确认的其它无效资金。

(2)投资者 T 日提交开户申请后,可于 T+1 日到本公司贵宾理财中心查询确认结果,或通过本公司客户服务中心、本公司网站查询。

(3)投资者 T 日提交认购申请后,可于 T+1 日到本公司贵宾理财中心查询认购接受结果,或通过本公司客户服务中心、本公司网站查询。认购确认结果可于基金成立后到本公司贵宾理财中心查询,或通过本公司客户服务中心、本公司网站查询。

(四)上投摩根基金管理有限公司电子交易系统

1、开户和认购的时间

(1)开户时间:电子交易系统 24 小时(周六、周日和法定节假日照常受理)接受个人投资者开户业务,基金交易日 17:00 之后提交的开户申请于下一交易日受理。

(2)认购时间:电子交易系统在基金发售时段内 24 小时(周六、周日和法定节假日照常受理)接受个人投资者提交的认购申请,基金交易日 17:00 之后提交的认购申请于下一交易日受理。

2、开户和认购的程序

网上开户及认购程序参见网站相关说明。

3、注意事项

(1)以下将被认定为无效认购:

◇投资者已划付资金,但逾期未办理开户手续或开户不成功的;

◇投资者已划付资金,但逾期未办理认购手续的;

◇本公司确认的其它无效资金。

(2)投资者 T 日提交开户申请后,T 日即可通过本公司网站认购基金。

(3)投资者 T 日提交开户申请后,可于 T+1 日通过本公司网站、本公司客户服务中心查询。

(4)投资者 T 日提交认购申请后,可于 T+1 日通过本公司网站、本公司客户服务中心查询。认购确认结果可于基金成立后通过本公司网站、本公司客户服务中心查询。

四、机构投资者的开户与认购程序

机构投资者可以在上投摩根基金管理有限公司贵宾理财中心、建设银行,代销本基金的证券公司等指定基金代销网点办理基金账户开户、认购申请。

(一)上投摩根基金管理有限公司贵宾理财中心

1、开户和认购的时间

基金发售日的 9:30~17:00。周六、日及其他法定节假日正常受理客户申请,该认购申请计入下一发售日;发售日每天 17:00 后客户发起的认购申请计入下一发售日。

2、办理基金交易账户和基金账户开户申请时须提交下列材料:

(1)加盖公章的有效身份证明文件复印件;

(2)加盖公章的组织机构代码证及税务登记证复印件;

(3)法定代表人(负责人)授权委托书(账户类)原件;

(4)加盖公章的银行开户证明文件复印件;

(5)加盖公章业务经办人及账单收件人的身份证件复印件;

(6)预留印鉴卡;

(7)填妥的加盖公章的《投资者风险承受能力调查表》;

(8)填妥的加盖公章及法人代表章的申请表;

(9)加盖公章的法定代表人的身份证件复印件。

本公司或账户代理机构需要留存的材料为:有效身份证明文件的复印件;组织机构代码证及税务登记证复印件;法定代表人授权委托书原件;银行证明文件复印件;业务经办人及账单收件人的身份证件复印件;预留印鉴卡;《投资者风险承受能力调查表》;填妥的加盖公章及法人代表章的申请表;法定代表人的身份证件复印件。

3、机构投资者认购基金的申请,应当提供下列材料:

填妥的加盖预留印鉴章的《交易业务申请表》。

销售机构需要留存的材料为:填妥的加盖预留印鉴章的申请表。

4、认购资金的划拨

机构投资者办理认购前应将足额认购资金划入本公司指定的任一直销专户

账户名称:上投摩根基金管理有限公司直销专户
帐 号:31001550400050002872
开户银行:中国建设银行上海市分行营业部
联行号:52364
人民银行大额支付系统联行号:105290036005
账户名称:上投摩根基金管理有限公司
帐 号:1001190729013313135
开户银行:中国工商银行上海市分行第二营业部
开户行交换号:001021907
联行号:20304018
人民银行大额支付系统联行号:102290019077
账户名称:上投摩根基金管理有限公司
帐 号:216089238510001
开户银行:招商银行上海分行营业部
联行号:096819
人民银行大额支付系统联行号:308290003020

5、注意事项

(1)以下将被认定为无效认购:

◇投资者已划付资金,但逾期未办理开户手续或开户不成功的;

◇投资者已划付资金,但逾期未办理认购手续的;

◇投资者已划付的认购资金少于其申请的认购金额的;

◇本公司确认的其它无效资金。

(2)投资者 T 日提交开户申请后,可于 T+1 日到本公司贵宾理财中心或通过本公司客户服务中心查询确认结果。

(3)投资者 T 日提交认购申请后,可于 T+1 日到本公司贵宾理财中心查询认购接受结果,或通过本公司客户服务中心、本公司网站查询。认购确认结果可于基金成立后到本公司贵宾理财中心查询,或通过本公司客户服务中心、本公司网站查询。

(二)通过建设银行办理开户和认购的程序

1、业务办理时间:基金发售日的 9:30~17:00。周六、日及法定节假日不办理业务。

2、开户及认购程序

(1)请事先办妥或已有中国建设银行的机构活期存款账户并存入足额开户和认购资金。

(2)由被授权人到开户会计柜台提交以下材料,办理开户手续,开立上投摩根基金管理公司的基金账户:

①机构活期存款账户的印鉴卡及印鉴、营业执照或事业社团法人证书及复印件、军队或武警开户许可证及复印件、组织机构代码证及复印件。开户单位为分支机构的,还应提交法人授权其开户的书面证明;

②证券业务授权书;

③被授权人有效身份证明及复印件、印鉴;

④填妥的“机构开通/取消证券交易申请表”,并加盖公章和法定代表人章。

(3)开户同时可办理认购手续,请填妥并提交“证券买入(基金认购/申购)委托单”。

3、认购程序及所需材料

(1)被授权人有效身份证明原件;

(2)填妥的“证券买入(基金认购/申购)委托单”。

4、注意事项

(1)机构投资者请到原机构活期存款账户开户会计柜台办理开户和认购手续;

(2)若有其他方面的要求,请以中国建设银行《中国建设银行证券业务系统机构客户操作指南》为准。

通过其它银行办理开户和认购的程序及所需资料以该银行的具体业务规则为准。

(三)代销本基金的证券公司

以下程序原则上适用于代销本基金的证券公司,包括申银万国证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国都证券有限责任公司 、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、安信证券股份有限公司。仅供投资者参考,具体程序以各代销机构的规定为准。新增代销渠道的认购程序以有关公告为准。

1、业务办理时间:基金发售日的 9:30-15:00(周六、周日不受理)。

2、开立资金账户:机构投资者申请开立机构账户应提供以下材料:

(1)资金账户开户申请表(加盖机构公章和法定代表人章),已开立了资金账户的客户不必再开立该账户;

(2)企业法人营业执照或其他法人的注册登记证书原件(营业执照或注册登记证书必须在有效期内且已完成上一年度年检)及复印件(加盖机构公章);

(3)法定代表人授权委托书(加盖机构公章和法定代表人章);

(4)法定代表人证明书;

(5)法定代表人身份证件复印件,法定代表人签发的标准格式的授权委托书;

(6)预留印鉴;

(7)经办人身份证件及其复印件;

3、开立基金账户:机构投资者开立基金账户应提供以下材料:

(1)开户申请表(加盖机构公章和法定代表人章);

(2)经办人身份证件及复印件;

(3)授权委托书(加盖机构公章和法定代表人章);

(4)代销券商开立的资金账户卡。

4、提出认购申请:机构投资者申请认购本基金应提供以下材料:

(1)认购申请表(加盖机构公章和法定代表人章);

(2)经办人身份证件及复印件;

(3)授权委托书(加盖机构公章和法定代表人章);

(4)代销券商开立的资金账户卡。

投资者还可通过电话委托、自助/热自助委托、网上交易等方式提出认购申请。

5、注意事项:

(1)若有其他方面的要求,以代销券商的说明为准。

(2)投资者认购时要注明所购买的基金名称或基金代码。基金名称:“上投摩根强化回报债券型证券投资基金”、基金代码:“A 类 372010;B 类 372110”。

五、清算与交割

1、本基金正式成立前,全部认购资金将被冻结,认购资金(包括认购费)产生的资金利息在募集期结束后折算成基金份额,归投资者所有。投资者认购资金的利息以注册登记机构的计算为准。

2、本基金权益登记由基金注册登记机构在发售结束后完成。

六、基金的验资与成立

1、本基金发售期截止后,由基金管理人委托具有证券从业资格的会计师事务所对认购资金进行验资并出具验资报告,基金注册登记机构出具认购户数证明。

2、基金管理人应当按照规定办理基金备案手续。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。

3、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。

4、若本基金不成立,本基金将把已募集资金并加计银行同期活期存款利息在募集期结束后 30 天内退还给基金认购人。

七、发售费用

若本基金发售失败,发售费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关法规列支;若本基金发售成功,基金合同生效前的各种费用由基金管理人承担。

八、本次发售当事人或中介机构

(一)基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
名称:上投摩根基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层
办公地址:上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层
法定代表人:陈开元
总经理:章硕麟
成立日期:2004 年 5 月 12 日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[2004]56 号
经营范围:基金管理业务、发起设立基金以及经中国证监会批准的其他业务。
组织形式:有限责任公司
实缴注册资本:25000 万元
存续期间:持续经营
公司网址:www.51fund.com
(二)基金托管人:建设银行
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码:100032
法定代表人:郭树清
成立日期:2004 年 09 月 17 日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]12 号
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间:持续经营

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保管箱服务;经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

(三)销售机构

1、直销机构

上投摩根基金管理有限公司上海贵宾理财中心
地址:上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼(200120)
理财中心电话:400 889 4888, (021)38794888
传真:(021)68881190
公司网址:www.51fund.com
上投摩根基金管理有限公司北京贵宾理财中心
地址:北京市西城区金融街七号英蓝国际金融中心 19 层 1925 室(100034)
电话:010-58369199
传真:010-58369138
上投摩根基金管理有限公司深圳贵宾理财中心
地址:深圳市罗湖区深南东路 5001 号华润大厦 2705-07 室(518001)
电话:0755-82690060
传真:0755-82690104

2、代销机构

建设银行、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司等 30 家机构代理销售本基金,代销机构的具体信息请参见本发售公告第一部分“本次发售基本情况”第 8 条“代销机构与代销地点”。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(四)注册登记机构:上投摩根基金管理有限公司
(五)律师事务所:国浩律师集团(上海)事务所
注册地址:上海市南京西路 580 号南证大厦 45 楼
负责人:倪俊骥
联系电话:021-52341668
传真:021-52341670
经办律师:宣伟华、屠懿
(六)会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室
法定代表人:杨绍信(SILAS SIU SHUN YANG)
联系电话: +86 21 6123 8888
传真电话:+86 21 6123 8800
经办注册会计师:汪棣 陈宇
联系人:郁豪伟

上投摩根基金管理有限公司
2011 年 7 月 13 日

上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同内容摘要

(上接 D9 版)

4.采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(八)计票

1.现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

(3)如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第(二)条所规定的第(1)-(8)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行,关于本章第(二)条所规定的第(9)、(10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

2.生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

(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)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1.本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权;

2.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权后的单位净值自动转为基金份额;

3.本基金收益每年最多分配 6 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 30%;

4.若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;

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权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

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止日)的时间不得超过 15 个工作日;

7. 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;

8.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

(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.销售服务费:本基金从 B 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

4.基金财产拨划支付的银行费用;

5.基金合同生效后的基金信息披露费用;

6.基金份额持有人大会费用;

7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

8.基金的证券交易费用;

9.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,基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times$ 年管理费率 $\div$ 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 5 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,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times$ 年托管费率 $\div$ 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 5 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.销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

B 类基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金份额资产净值的 0.4%年费率计提,计算方法如下:

$H=E\times$ 年销售服务费率 $\div$ 当年天数

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 5 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、公休日等,支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

4.除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用,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)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率。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。

(六)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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资目标

本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,通过主动管理,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率,实现基金资产的长期稳定增值。

(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,包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证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。

本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购等固定收益品种。本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股,以及在二级市场上投资股票、权证等权益类资产。

本基金的投资组合比例为:债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的 20%。本基金持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%,并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三)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%,债券回购的最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(6) 债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的 20%。

(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%;

(14)保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(15)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应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,但是中国证监会另有规定的除外;

(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。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一)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、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。

4、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。

5、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。

6、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。

(二)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 0.001 元,小数点后第四位四舍五入。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。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同将终止:

(1)基金份额持有人大会决定终止的;

(2)基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;

(3)基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;

(4)连续 90 个工作日基金份额持有人少于 200 人;

(5)连续 90 个工作日基金资产规模少于 3000 万人民币;

(6)连续 90 个工作日本基金前十大基金份额持有人持有本基金 90%以上的基金份额;

(7)中国证监会规定的其他情况。

(二)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2.基金财产清算程序

基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:

(1)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;

(2)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;

(3)对基金财产进行清理和确认;

(4)对基金财产进行估价和变现;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;

(6)聘请律师事务所出具法律意见书;

(7)将基金财产清算结果报告中国证监会;

(8)参加与基金财产有关的民事诉讼;

(9)公布基金财产清算结果;

(10)对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

4.基金财产按下列顺序清偿:

(1)支付清算费用;

(2)交纳所欠税款;

(3)清偿基金债务;

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)-(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式和适用法律

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。