建信信用增强债券型证券投资基金上市交易公告书

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2011年9月9日
公告日期:2011年9月6日

一、重要声明与提示

建信信用增强债券型证券投资基金上市交易公告书(以下简称"本公告")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,建信信用增强债券型证券投资基金(以下简称"本基金")基金管理人建信基金管理有限责任公司(以下简称"本公司")的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人交通银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2011年5月11日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及本公司网站(www.ccbfund.cn)上的《建信信用增强债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:建信信用增强债券型证券投资基金
2、基金类型:债券型
3、基金简称:建信信用增强债券
4、基金场内简称:建信信用
5、交易代码:165311
6、基金份额总额:761,256,172.26份(截至:2011年9月2日)
7、基金份额净值:1.003元(截至:2011年9月2日)
8、本次上市交易份额:116,933,168份(截至:2011年9月2日)
9、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
10、上市交易日期:2011年9月9日
11、基金管理人:建信基金管理有限责任公司
12、基金托管人:交通银行股份有限公司
13、上市推荐人:无
14、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2011年4月6日证监许可〔2011〕493号

2、基金运作方式:契约型、债券型基金,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后转为上市开放式基金(LOF)。

3、基金存续期限:不定期

4、基金募集时间:自2011年5月16日至2011年6月10日

5、发售价格:1.00元人民币

6、发售方式:场内、场外发售

7、发售机构:

(1)场内代销机构

办理本基金场内认购的销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深圳证券交易所网站查询。

(2)场外销售机构

①直销机构

建信基金管理有限责任公司

②代销机构

中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、东北证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、财富证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司和国信证券股份有限公司。

8、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

9、募集资金总额及入账情况:经普华永道中天会计师事务所验资,此次募集扣除认购费后的净认购金额(不含利息)为人民币760,987,511.71元,折合760,987,511.71份基金份额;依照《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,在募集期间有效认购申请确认金额产生的银行利息共计268,660.55元人民币,折合基金份额268,660.55份,总确认份额为761,256,172.26份。

上述募集资金及利息已于2011年6月16日全额划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户。

10、本基金募集备案情况

本基金已于2011年6月16日验资完毕,当日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2011年6月16日获书面确认,本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日:2011年6月16日

12、基金合同生效日的基金份额总额761,256,172.26份

(二)本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上〔2011〕275号

2、上市交易日期:2011年9月9日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称:建信信用增强债券

5、基金场内简称:建信信用

6、交易代码:165311

7、本次上市交易份额:116,933,168份(截至:2011年9月2日)

8、基金净值的披露:基金管理人每个估值日对基金资产估值。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,基金托管人复核。本基金上市交易后,基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深圳证券交易所,深圳证券交易所于下个工作日通过行情系统揭示。

9、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内(即中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统)后即可上市流通。

(三)本基金的转托管

募集期内,本基金通过场内认购和场外认购两种方式公开发售基金份额。通过场内认购的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统(以下简称"证券登记系统")基金份额持有人的深圳证券账户下,在基金上市交易后,可以在深圳证券交易所上市交易,但在基金封闭期内不得赎回。通过场外认购的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统(以下简称"基金登记系统")中基金份额持有人的开放式基金账户下,在基金封闭期内不得赎回,但在基金上市交易后,可以通过跨系统转托管转至证券登记系统中后上市交易。投资者可通过跨系统转托管业务实现基金份额在两个注册登记系统之间的转换。

封闭期结束,本基金转为上市开放式基金(LOF)并开放赎回业务后,登记在基金登记系统中的基金份额可通过基金销售机构申请场外赎回,但不能上市交易,投资者可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内后再上市交易;登记在证券登记系统中的基金份额既可上市交易,也可直接申请场内赎回。

为了保证基金份额持有人的利益,根据《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》的约定,经本公司向深圳证券交易所申请,已开通本基金的跨系统转托管业务,投资者可以通过认购本基金的销售机构办理本基金跨系统转托管业务。封闭期结束,本基金转为上市开放式基金(LOF)并开放申购业务后,跨系统转托管业务将自动适用于在场内、场外申购的基金份额。本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司和深圳证券交易所的相关规定办理。场外认购的投资者欲办理跨系统转托管业务,须按照相关规定开立深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户和办理其他相关手续,具体请咨询相关业务办理机构。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)场内基金份额持有人户数

截至2011年9月2日,本基金场内份额持有人户数为117户,平均每户持有的场内基金份额为999,429份。

(二)场内基金份额持有人结构

截至2011年9月2日,场内机构投资者持有的本基金份额为110,004,583份,占本基金场内总份额的94.07%;场内个人资者持有的基金份额有6,928,585份,占本基金场内总份额的5.93%。

(三)本基金场内份额前十名持有人情况(截至2011年9月2日)

序号	基金份额持有人名称	持有基金份额数	占场内基金总份额的比例(%)
1	中信万通证券有限责任公司	80,003,333	68.42%
2	中航证券有限公司	30,001,250	25.66%
3	孙怀萍	800,033	0.68%
4	陈黎力	397,946	0.34%
5	金玉凤	397628	0.34%
6	李书兰	298503	0.26%
7	付冰	298459	0.26%
8	李国雄	248707	0.21%
9	乔东发	199009	0.17%
10	李永祥	198922	0.17%
合计		112,843,790	96.50%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因,占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、基本情况

名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
设立日期:2005年9月19日
批准设立机关和批准设立文号:中国证监会证监基金字〔2005〕158号文
法定代表人:江先周
总经理:孙志晨
联系人:孙桂东
咨询电话:010-66228888
法人营业执照文号:企合国副字第001136
注册资本:人民币2亿元
存续期间:持续经营
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

2、股权结构:

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务公司	25%
中国华电集团资本控股有限公司	10%

3、组织机构

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利,不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会,由5名监事组成,其中包括2名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部十五个职能部门以及深圳分公司、成都分公司、北京分公司和上海分公司。此外,公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

4、人员情况

截至2011年9月2日,公司共有员工164人,所有人员在最近三年内均没有受到有关管理部门处罚的记录。

5、信息披露负责人

路彩营

6、基金管理业务情况简介

截至2011年6月30日,基金管理人管理的基金为建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金和建信新兴市场优选股票型证券投资基金共16只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金1只封闭式基金,管理的基金总资产规模为433.14亿元。

7、本基金基金经理

李菁女士,经济学硕士。2002年7月,北京大学中国经济研究中心硕士研究生毕业,同年进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,先后任债券研究员和货币基金基金经理助理,2007年11月3日起担任建信货币市场基金基金经理,2009年6月2日起兼任建信收益增强基金基金经理,2011年6月16日起任建信信用增强基金基金经理。

(二)基金托管人

1、基本情况

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:上海市仙霞路18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。《财资》杂志(The Asset)"2010年全球最佳交易银行评选"中,交通银行荣膺"中国最具成长性现金管理银行"、"最佳次托管银行"两项大奖。英国《银行家》杂志2011年公布的全球1000家银行排名,交通银行以343.21亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行50强。截至2011年6月30日止,交通银行资产总额达到人民币4.34万亿元,实现净利润人民币263.96亿元。

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6月末,交通银行共托管证券投资基金55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、华夏亚债中国债券指数、博时深证基本面200ETF及联接、建信信用增强债券。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。

(三)基金验资机构

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1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:陈宇
经办会计师:许康玮、陈宇

六、基金合同摘要

(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利、义务

(1)基金投资人持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,基金投资人自依据招募说明书、基金合同取得本基金的基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

(2)基金份额持有人的权利

1)分享基金财产收益;
2)参与分配清算后的剩余基金财产;
3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;
5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
7)监督基金管理人的投资运作;
8)对基金管理人、基金托管人、注册登记人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
9)法律法规、基金合同规定的其它权利。

(3)基金份额持有人的义务

1)遵守法律法规、基金合同等有关规定;
2)交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用;
3)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
4)不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动;
5)执行生效的基金份额持有人大会决议;
6)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利;
7)法律法规及基金合同规定的其他义务。

2、基金管理人的的权利、义务

(1)基金管理人的权利

1)依法募集基金,办理基金备案手续;
2)自基金合同生效之日起,依照法律法规和基金合同独立管理基金财产;
3)根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;
4)根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
5)在符合有关法律法规和基金合同的前提下,决定本基金的相关费率结构和收费方式;
6)根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额;
7)依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人;
8)根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;
9)自行担任基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构,办理基金注册登记业务,并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;
10)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;
11)在法律法规允许的前提下,为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券;
12)依据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益的分配方案;
13)按照法律法规,代表基金对被投资企业行使股东权利,代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利;
14)在基金托管人职责终止时,提名新的基金托管人;
15)依据法律法规和基金合同的规定,召集基金份额持有人大会;
16)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
17)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;
18)法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

(2)基金管理人的义务

1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2)办理基金备案手续;
3)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5)配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务;
6)配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务;
7)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立,对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账,进行证券投资;
8)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益,不得委托第三人运作基金财产;
9)接受基金托管人依法进行的监督;
10)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按照有关规定计算并公告基金份额净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
11)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前,应予以保密,不得向他人泄露;
13)按基金合同确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
14)按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请,及时、足额支付赎回和分红款项;
15)不谋求对上市公司的控股和直接管理;
16)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会,或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
17)按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
18)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;
19)编制季度、半年度和年度基金报告;
20)确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料,能在规定时间内发出;保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
21)组织并参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
22)面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
23)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
24)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
25)不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动;
26)公平对待所管理的不同基金和受托资产,防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配;
27)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
28)法律法规及基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利和义务

(1)基金托管人的权利

1)依据法律法规和基金合同的规定保管基金财产;
2)依照基金合同的约定获得基金托管费;
3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的,不予执行并向中国证监会报告;
4)在基金管理人职责终止时,提名新的基金管理人;
5)依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会;
6)依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人,如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会,以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
7)法律法规、基金合同规定的其它权利。

(2)基金托管人的义务

1)以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产;
2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
3)建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金、受托资产之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
4)除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外,不以基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
5)按规定保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
7)按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
8)保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予以保密,不得向他人泄露;
9)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格;
10)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
11)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应说明基金托管人是否采取了适当的措施;
12)按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料,保存基金的会计账册、报表和记录等15年以上;
13)根据有关法律法规,建立并保存基金份额持有人名册;
14)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
15)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
16)按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
17)按照规定监督基金管理人的投资运作;
18)参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
19)面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会和中国银监会,并通知基金管理人;
20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,基金托管人应为基金向基金管理人追偿;
21)因违反基金合同导致基金财产的损失,应承担赔偿责任,其责任不因其退任而免除;
22)不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动;
23)法律、法规、本基金合同所规定的其他义务。

(二)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会,由本基金的基金份额持有人共同组成。本基金的基金份额持有人享有平等的表决权,每一基金份额具有一票表决权。

2、有以下事由情形之一时,应召开基金份额持有人大会:

(1)终止基金合同;
(2)转换基金运作方式,本基金依据基金合同的约定直接转换运作方式的除外;
(3)封闭期内基金的扩募;
(4)更换基金托管人;
(5)更换基金管理人;
(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
(7)本基金与其它基金的合并;
(8)变更基金类别;
(9)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
(10)终止基金上市,但因本基金不再具备上市条件而被交易所终止上市的除外;
(11)变更基金份额持有人大会程序;
(12)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
(13)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:

(1)调低基金管理费、基金托管费;
(2)在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
(3)因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
(4)对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
(5)对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
(6)除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

4、召集人和召集方式

(1)除法律法规或本基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

(2)基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集。

(3)代表基金份额10%以上(含10%,以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。

(4)代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前30日向中国证监会备案。

(5)基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

(6)基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1)召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前40天在指定媒体及基金管理人网站上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

1)会议召开的时间、地点和方式;
2)会议拟审议的主要事项;
3)会议形式;
4)议事程序;
5)有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
6)授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
7)表决方式;
8)会务常设联系人姓名、电话;
9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
10)召集人需要通知的其他事项。

(2)采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

(3)如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票结果和表决效力。

6、基金份额持有人出席会议的方式

(1)会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定,但决定更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2)召开基金份额持有人大会的条件

1)现场开会方式

在同时符合以下条件时,现场会议方可举行:

①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%);

②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备,到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下,则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时,通讯会议方可举行:

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

②召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

③本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%);

④直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表,同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书、身份证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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。

7、议事内容与程序

(1)议事内容及提案权

1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前35天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30天公布。

3)对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案),大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

①关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

②程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)单独或合并持有权利登记日基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定除外。

5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案,应当最迟在基金份额持有人大会召开日前30日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

(2)议事程序

1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项,确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后在公证机关监督下进行表决,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上(含50%)多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会做出的决议的效力。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人至少提前30天公布提案,在所通知的表决截止日期第2天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3)基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

8、决议形成的条件、表决方式、程序

(1)基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2)基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议:

1)特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同的重大事项必须以特别决议方式通过;

2)一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效,除须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(3)基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准,或者备案,并予以公告。

(4)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5)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。

(6)基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

9、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3名基金份额持有人担任监票人。

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)如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对投票数进行重新清点;如会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议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,会议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。

4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的,不影响计票的效力。

(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督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

(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。

(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的决定。

(3)基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内由相关信息披露义务人在至少一种指定媒体公告。

(三)基金收益分配原则、执行方式

1、基金收益分配原则

(1)本基金在封闭期内,收益分配应遵循下列原则:

1)基金收益分配方式为现金方式;
2)每一基金份额享有同等分配权;
3)基金收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)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)在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多4次,至少1次;
5)在符合上述收益分配条件的前提下,年度收益分配比例不得低于年度可供分配利润的百分之九十。基金合同生效不满3个月的,收益可不分配;
6)法律、法规或监管机构另有规定的,从其规定。

(2)转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金收益分配应遵循下列原则:

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期末(即收益分配基准日)可供分配利润的60%;

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)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,登记在场外TA系统的基金份额,投资人可选择现金红利或将现金红利按红利再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;选择红利再投资方式的投资者其红利所转换的基金份额免收申购费用;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

登记在场内系统中的基金份额只能采取现金红利的分配方式,投资人不能选择其他的分红方式,具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

4)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;

5)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;

6)每一基金份额享有同等分配权;

7)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2、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。

3、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。

(四)与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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)基金的证券交易费用;
(4)基金上市交易费;
(5)基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用;
(6)基金份额持有人大会费用;
(7)基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费;
(8)基金银行汇划费用;
(9)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

2、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

本基金的管理费率为年费率0.7%。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H =E×年管理费率÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,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。

(2)基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率0.2%。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H =E×年托管费率÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)本条第(一)款第(3)至第(9)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。

3、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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4、基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行必备的程序的条件下,基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,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日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

5、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定,基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用,并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

(五)基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。

2、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,包括国债、中央银行票据、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、分离型可转换债券、债券回购、资产支持证券、银行存款等固定收益类金融工具,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)、权证等权益类金融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)。如法律法规和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。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具,但可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离型可转换债券而产生的权证。

在封闭期,本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的比例不低于固定收益类资产的80%,投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%;

在开放期,本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的比例不低于固定收益类资产的80%,投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,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%。

本基金所指信用债券是指金融债(不含政策性金融债)、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券、分离型可转换债券、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用担保的固定收益类金融工具。

3、投资禁止行为与限制

(1)禁止用本基金财产从事以下行为

1)承销证券;

(下转D14版)