（上接 D5 版）

2. 公司内部控制遵循的原则

(1) 健全性原则

风险管理必须涵盖公司各个部门和各个岗位，并渗透到各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈等环节。

(2) 有效性原则

通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护风险管理制度的有效执行。

(3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位确保相对独立并承担各自的风险控制职责。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作须分离。督察长和监察稽核部对公司风险控制制度的执行情况进行检查和监督。

(4) 相互制约原则

公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制,从而建立起不同岗位之间的制衡体系,消除内部风险控制中的盲点,强化监察稽核部对业务的监督检查功能。

(5) 成本效益原则

公司将运用科学化的经营管理方法,并充分发挥各机构、部门及员工的工作积极性,尽量降低经营成本,提高经营效益,保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

(6) 适时性原则

风险管理应具有前瞻性,并且必须随着国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时进行相应的修改和完善。

(7) 内控优先原则

内控制度具有高度的权威性,所有员工必须严格遵守,自觉形成风险防范意识;执行内控制度不能有任何例外,任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力;公司业务的发展必须建立在内控制度完善并稳固的基础之上。

(8) 防火墙原则

公司在敏感岗位如:基金投资、交易执行、基金清算岗位之间,基金会计和公司会计之间、会计与出纳之间等等,在物理上和制度上设置严格的防火墙进行隔离,以控制风险。

3. 内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面:第一个层面是公司章程;第二个层面是公司内部控制大纲,它是公司制定各项规章制度的基础和依据;第三个层面是公司基本管理制度;第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序,每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验,并出具专项报告。

4. 内控监控防线

为体现职责明确、相互制约的原则,公司根据基金管理业务的特点,设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线:

(1) 建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责,各业务均制定详尽的操作流程,各岗位人员上岗前必须以书面形式声明已知悉并承诺遵守,在授权范围内承担各自职责;

(2) 建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督的责任;

(3) 建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门,对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

5. 关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

(1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权,健全公司逐级授权制度,确保公司各项规章制度的贯彻执行;各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程,经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式,授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当,对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制,对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观,不受任何部门及个人的不正当影响;建立严密的研究工作业务流程,形成科学、有效的研究方法;建立投资产品备选库制度,研究部门根据投资产品的特征,在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度,保持畅通的交流渠道;建立研究报告质量评价体系,不断提高研究水平。

(3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念,根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序;在进行投资时应有明确的投资授权制度,并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度,保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度,将重点投资限制在规定的风险权限额度内;对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

(4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度,投资指令通过集中交易室完成;建立了交易监测系统、预警系统和交易反馈系统,完善了相关的安全设施;集中交易室对交易指令进行审核,建立公平的交易分配制度,确保各基金利益的公平;交易记录应完善,并及时进行反馈、核对和存档保管;同时建立了科学的投资交易绩效评价体系。

(5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度,并根据风险控制重点建立严密的会计系统,对于不同基金、不同客户独立建账,独立核算;公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度,确保档案真实完整。

(6) 信息披露

公司建立了完善的信息披露制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人,并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作,以此加强对信息的审查核对,使所公布的信息符合法律法规的规定,同时加强对信息披露的检查和评价,对存在的问题及时提出改进办法。

(7) 监察稽核

公司设立督察长,对董事会负责,经董事会聘任,报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权,督察长可以列席公司相关会议,调阅公司相关档案,就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责,配备了充足的人员,严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度,通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况,确保公司各项经营管理活动的有效运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作,对违反法律、法规和公司内部控制制度的,追究有关部门和人员的责任。

6. 基金管理人关于内部控制制度声明书

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

(一) 基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期:1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期:2004 年 8 月 26 日

注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人:肖 钢

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24 号

托管及投资者服务部总经理:董杰

托管部门联系人:王圣明

电话:(010) 66594911

传真:(010) 66594942

发展概况:1912 年 2 月,经孙中山先生批准,中国银行正式成立。从 1912 年至 1949 年,中国银行先后行使中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能,坚持以服务大众、振兴民族金融业为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。新中国成立后,中国银行成为国家外汇外贸专业银行,为国家对外经贸发展和国内经济建设作出了重大贡献。1994 年,中国银行改为国有独资商业银行。2003 年,中国银行开始股份制改造。2004 年 8 月,中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年 6 月、7 月,先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市,成为首家在内地和香港发行上市的中国商业银行。中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行,在中国内地、香港、澳门及 29 个国家为客户提供全面的金融服务。主要经营商业银行业务,包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务,并通过全资附属机构中银国际控股集团开展投资银行业务,通过全资子公司中银集团保险有限公司及其附属和联营公司经营保险业务,通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务,通过全资子公司中银集团投资有限公司从事直接投资和投资管理业务,通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。按核心资本计算,2009 年中国银行在英国《银行家》杂志“世界 1000 家大银行”排名中列第十一位。

在近百年的发展历程中,中国银行始终秉承追求卓越的精神,稳健经营的理念,客户至上的宗旨和严谨细致的作风,得到了业界和客户的广泛认可和赞誉,树立了卓越的品牌形象,中国银行被 The Banker(英国《银行家》)评为“2009 年中国年度银行”,被 Euromoney(《欧洲货币》)评为“2009 年度最佳私人银行”,被 Global Finance(《环球金融》)评为“2009 年度中国最佳外汇交易银行”,被 Trade Finance(《贸易金融》)评选为“中国本土最佳贸易服务银行”,被 The Asset(《财资》)评为“中国最佳贸易融资银行”,被 Finance Asia(《金融亚洲》)评为“中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行、中国最佳外汇交易银行”。面对新的历史机遇,中国银行将坚持可持续发展,向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

(二) 主要人员情况

肖钢先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长,自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理,期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月,历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月,1981 年毕业于湖南财经学院,1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生,自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于 1952 年 5 月,1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业,1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司执行董事。2000 年 11 月加入中国银行并自此担任中国银行副行长。于 1980 年 11 月至 2000 年 11 月任职于中国建设银行,曾工作于多个岗位,先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978 年毕业于南京信息工程大学。2002 年 6 月起担任中银香港控股非执行董事。

董杰先生,自 2007 年 11 月 27 日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自 2005 年 9 月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员,1983 年 7 月至 2005 年 9 月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于 1962 年 11 月,获得西南财经大学博士学位。

(三) 基金托管部门的情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念;根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类,中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队,现有员工 110 余人。另外,中国银行在北京市分行、上海市分行、深圳市分行、广东省分行、江苏省分行等重点分行已开展托管业务。

(四) 证券投资基金托管情况

截止 2010 年 12 月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、工银全球股票(QDII)、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)等 95 只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型等多种类型的基金和理财品种,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(五) 托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

最近一年内,中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(六) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1. 直销机构

(1) 中邮创业基金管理有限公司北京直销中心
办公地址:北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层
联系人: 李扬帆
电话:010-82290840
传真:010-82294138
网址:www.postfund.com.cn

2. 代销机构

(1) 中国银行股份有限公司
住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号
法定代表人: 肖钢
客服电话: 95566
网址: www.boc.cn

(2) 中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册地址:北京市西城区宣武门西大街 131 号
办公地址:北京市西城区金融大街 3 号金鼎大厦 A 座
法定代表人:刘安东
联系人:陈春林
客服电话:95580
网址:www.psbc.com

(3) 中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址:北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人:项俊波
客户服务电话:95599
网址: www.95599.cn

(4) 中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(5) 中国建设银行股份有限公司
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 号楼长安兴融中心
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
联系人:王琳
网址:www.ccb.com

(6) 招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
网址: www.cmbchina.com

(7) 交通银行股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:胡怀邦
联系人:曹榕
电话:021-58781234
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(8) 中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
法定代表人:孔丹
联系人:丰靖
客服热线:95558
网址:bank.ecitic.com

(9) 北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙 17 号
法定代表人:闫冰竹
联系人:王曦
电话:010-66223584
客服电话: 010-95526
网址:www.bankofbeijing.com.cn

(10) 上海银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路 168 号
法定代表人:宁黎明
客服电话:021-962888
联系人:张萍
网址:www.bankofshanghai.com

(11) 平安银行股份有限公司
注册地址:中国深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
联系人:蔡宇洲
电话:0755-22197874
客服热线:40066-99999
网址: www.pingan.com

(12) 江苏银行股份有限公司
注册地址:江苏省南京市洪武北路 55 号
办公地址:江苏省南京市洪武北路 55 号
法定代表人:黄志伟
联系人:田春慧,法晓宁
客服电话:40086 96098
网址:www.jsbchina.cn

(13) 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:顾伟国
联系人:李洋、陈泉
联系电话:66568047
客服电话:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn

(14) 中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-84683893
网址:www.ecitic.com

(15) 中信建投证券股份有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝内大街 188 号
法定代表人:张佑君
联系人:权唐
客服电话:4008-888-108
网址:www.csc108.com

(16) 申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路 171 号
法定代表人:丁国荣
联系人:李清怡
客服电话:021-962505
网址:www.sw2000.com.cn

(17) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼
法定代表人:万建华
联系人:芮敏祺
客服电话:4008-888-666
网址: www.gtja.com

(18) 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
联系人:程高峰
联系电话::025-84457777
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

(19) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法人代表人:何如
联系人: 齐晓燕
联系电话:0755-82130833
客服电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

(20) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼
法定代表人:王志伟
联系人:黄岚
客服电话: (020)95575 或致电各地营业网点
网址:www.gf.com.cn

(21) 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
联系人:陈剑虹
客户服务电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn

(22) 广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层
办公地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
客服电话:96326(福建省外加拨 0591)或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.gfhfzq.com.cn

(23) 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
客服电话:95565、4008-888-111
网址:www.newone.com.cn

(24) 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
客户服务电话:95553 或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.htsec.com

(25) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路 268 号
法定代表人:兰荣
联系人:谢高得
客户服务电话:400-8888-123
网址:www.xyzq.com.cn

(26) 中信金通证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市 滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19-20 层
法定代表人:刘军
联系人: 丁思聪
客服电话:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn

(27) 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
法定代表人:李玮
联系人:吴洋
客服电话: 95538
网址: www.qlzq.com.cn

(28) 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
法定代表人:林俊波
联系人:钟康莺
客服电话:400-888-1551
网址: www.xcsc.com

(29) 长城证券有限责任公司
注册地址: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
客服电话:0755-33680000 400-6666-888
网址:www.cc168.com.cn

(30) 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
客服电话:4008888788
网址:www.ebscn.com

(31) 中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
办公地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
法定代表人:唐新宇
联系人:张静
客服电话:400-620-8888
网址:www.bocichina.com

(32) 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 1 号楼第 20 层
法定代表人: 张智河
联系人: 吴忠超
客服电话:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn

(33) 东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
办公地址:东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:游锦辉
联系人:张巧玲
联系电话: 0769-22119348
客服电话:0769-961130
网址:www.dgzq.com.cn

(34) 新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层
法定代表人:马金声
联系人: 孙恺
客服电话:400-698-9898
网址:www.xsdzq.cn

(35) 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
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
联系电话: 010-88085858
客服电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

(36) 浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场
办公地址:杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 6-7 层
法定代表人:吴承根
联系人:吴颖
联系电话:0571-87902080
客服电话: (0571)967777
网址:www.stocke.com

(37) 南京证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市大钟亭 8 号
法人代表:张华东
联系人:徐翔
客服电话:4008-285-888
网址:www.njzq.com.cn

(38) 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
客服电话:0510-82588168 400-888-5288
网址: www.glsc.com.cn

(39) 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
联系人:霍晓菲
客服电话:021-52574550 0519-88166222 0379-64902266
客服电话:400-888-8588
网址:www.longone.com.cn

(40) 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
法定代表人:马昭明
联系人:盛宗凌
客服电话:400-8888-555
网址:www.lhzq.com

(41) 世纪证券有限责任公司
注册地址: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: 王佳佳
联系电话:0755-83199511
网址:www.csco.com.cn

(42) 中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路 291 号
办公地址:江西省南昌市抚河北路 291 号
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
电话:0791-6768681
客服电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com

(43) 日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路 18 号
办公地址:北京西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈韦杉、朱晓光
电话:010-88986830
客服电话:请拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.rxzq.com.cn

(44) 天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
法定代表人:林义相
联系人: 林爽
咨询电话:010-66045566 010-66045529
网址:www.txsec.com

(45) 西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层
办公地址:西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层
法定代表人:刘建武
电话:029-87406488
传真:029-87406387
联系人:冯萍
网址:www.westsecu.com.cn
客户服务电话:029-95582

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二) 基金注册登记机构
名称:中邮创业基金管理有限公司
住所:北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层
办公地址:北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层
法定代表人:吴涛
联系人:李焱
电话:010-82295160
传真:010-82292422

(三) 律师事务所和经办律师
名称:北京市瑞天律师事务所
住所:北京市西城区莲花池东路甲 5 号院 1 号楼 18 层 1 单元 1805
负责人:姜森林
联系人:李飒
电话:010-63377073
传真:010-62116298
经办律师:李飒 刘敬华

(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称:北京京都天华会计师事务所有限责任公司
住所:北京市建国门外大街 22 号赛特广场五层
法定代表人:徐华
联系人:卫俏嫔
联系电话:010-65264838
传真电话:010-65227521
经办注册会计师: 王娟 卫俏嫔

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其它法律法规的有关规定募集,本基金募集申请已经中国证监会《关于核准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]1261 号)核准募集。

(一) 基金类型

股票型

(二) 基金的运作方式

契约型 开放式

(三) 基金存续期

不定期

(四) 基金的面值

基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

(五) 募集规模上限

本基金不设首次募集规模上限

(六) 募集方式和募集场所

本基金通过基金管理人的直销机构和代销机构的营业网点向投资者公开发售。销售机构联系方式详见基金份额发售公告。基金管理人可以根据情况增加其他代销机构,并另行公告。

(七) 募集期限

本基金募集期限自基金份额开始发售之日起不超过 3 个月。本基金自 2011 年 9 月 28 日至 2011 年 10 月 31 日进行发售。如果在此期间届满时未达到本招募说明书第七章第一条规定的基金备案条件,基金可在募集期内继续销售。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。

(八) 募集对象

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者(有关法律法规规定禁止购买者除外)和合格境外机构投资者。

(九) 认购安排

1. 认购时间:具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同,在基金份额发售公告中确定并披露。

2. 投资人认购应提交的文件和办理的手续,详见本基金的份额发售公告。

3. 认购原则和认购限额

(1) 本基金认购采取金额认购的方式,投资人认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款。

(2) 在募集期内,投资人可多次认购,对单一投资人在认购期间累计认购份额不设上限。

(3) 在基金募集期内,投资人通过代销机构认购的单笔最低限额为人民币 1000 元;投资人通过直销机构首次认购的单笔最低限额为人民币 50000 元,追加认购单笔最低限额是人民币 1000 元。

(4) 基金投资人在募集期内可以多次认购,认购一经受理不得撤销

4. 认购费用

本基金的认购费率如下:

认购金额(元,含认购费)	认购费率
100万元以下	1.0%
100万元(含)至 200 万元以下	0.6%
200万元(含)至 500 万元以下	0.2%
500万元(含)以上	1000元/笔

投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算。

本基金认购费由认购人承担,不列入基金财产。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

5. 基金认购份额的计算

本基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式如下:

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

认购份额 = (净认购金额+认购利息)/基金份额面值

对于 500 万元(含)以上的认购适用绝对数额的认购费金额。

认购费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留到小数点后两位;认购份额计算结果按照四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。多笔认购时,按上述公式进行逐笔计算。

例:某投资人投资 10000 元认购本基金,对应费率为 1.0%,如果募集期内认购资金获得的利息为 2 元,则其可得到的基金份额计算如下:

净认购金额=10000/(1+1.0%)=9900.99 元

认购费用=10000-9900.99=99.01 元

认购份额=(9900.99+2)/1.00=9902.99 份

即投资人投资 10000 元认购本基金,加上认购资金在募集期内获得的利息,可得到 9902.99 份基金份额。

6. 认购确认

销售网点受理申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记机构的确认为准。投资人可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

(十) 募集资金

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。

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

七、基金合同的生效

(一) 基金备案的条件

本基金募集期限届满,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。

(二) 基金的备案

基金募集期限届满,具备上述基金备案条件的,基金管理人应当自募集期限届满之日起 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,基金合同生效;

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

(四) 基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满,不能满足基金备案的条件的,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 日内返还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

(五) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本合同存续期内,基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的,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。

法律法规或监管部门另有规定的,按其规定办理。

八、基金份额的申购与赎回

(一) 申购和赎回场所

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。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

(二) 申购和赎回的开放日及开放时间

1. 开放日及开放时间

本基金的开放日为本合同生效后基金管理人公告开始办理申购或赎回之日,具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的,视为下一个开放日的申请,其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2. 申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后,由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(三) 申购与赎回的原则

1. “未知价”原则,即基金的申购与赎回价格以受理申请当日基金份额净值为基准进行计算;

2. 基金采用金额申购和份额赎回的方式,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3. 基金份额持有人在赎回基金份额时,基金管理人按先进先出的原则,即对该基金份额持有人在该销售机构托管的基金份额进行处理时,确认日期在先的基金份额先赎回,确认日期在后的基金份额后赎回,以确定所适用的赎回费率;

4. 当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销,在当日的业务办理时间结束后不得撤销;

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,但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(四) 申购与赎回的程序

1. 申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续,在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金,须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时,其在销售机构(网点)必须有足够的基金份额余额。

2. 申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

3. 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式,若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功,申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后,基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项,赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日的时间内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时,赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

(五) 申购和赎回的数额限制

1. 申请申购基金的金额

投资者通过代销机构首次申购单笔最低限额为人民币 1000 元;投资者通过直销机构首次申购单笔最低限额为人民币 50000 元,但已认购本基金的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币 1000 元;追加申购单笔最低限额为人民币 1000 元。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时,不受最低申购金额的限制。

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

2. 申请赎回基金的份额

单笔赎回不得少于 500 份(如该账户在该销售机构托管的基金余额不足 500 份,则必须一次性赎回基金全部份额);若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足 500 份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

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

(六) 申购份额与赎回金额的计算方式

1. 申购份额的计算方式:申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后,以申请当日基金份额净值为基准计算,各计算结果均按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

本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

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

举例说明:假定 T 日的基金份额净值为 1.200 元,申购金额 10000 元,计算如下:

适用申购费率为 1.2%

净申购金额= 10000 /(1+1.2%) = 9881.42 元

申购费用= 10000-9881.42 =118.58 元

申购份数= 9881.42/ 1.200= 8234.52 份

2. 赎回金额的计算方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额,净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额,各计算结果均按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中,

赎回金额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

举例说明:假定 T 日的基金份额净值为 1.200 元,赎回份数为 10000 份,各时期赎回金额如下:

持有期限	适用费率	赎回总金额	赎回费用	赎回金额
1 年以内	0.50%	10000*1.200=12000	12000*0.50%=60	12000-60=11940
1 年(含)-2 年以内	0.25%	10000*1.200=12000	12000*0.25%=30	12000-30=11970
2 年(含)以上	0.00%	10000*1.200=12000	12000*0.00%=0	12000-0=12000

(七) 申购和赎回的费用及其用途

1. 本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%,赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。

2. 本基金申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高额不超过申购金额的 5%,具体如下:

申购金额(元,含申购费)	申购费率
100万元以下	1.20%
100万元(含)至 200 万元以下	0.80%
200万元(含)至 500 万元以下	0.30%
500万元(含)以上	1000元/笔

3. 本基金赎回费率按照持有时间递减,即基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%,随持有期限的增加而递减。具体如下:

持有时间[1]	赎回费率
一年以下	0.5%
1年(含 1 年)至 2 年	0.25%
2年以上(含 2 年)	0%

注:[1] 就赎回费的计算而言,1 年指 365 天,2 年为 730 天,以此类推。

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

4. 本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中不低于 25%的部分归入基金财产(具体比例见招募说明书),其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

5. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更,基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在至少一种指定媒体上公告。

(八) 申购与赎回的注册登记

1. 经基金销售机构同意,基金投资者提出的申购和赎回申请,在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

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

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

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

(九) 巨额赎回的认定及处理方式

1. 巨额赎回的认定

单个开放日中,本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额)与净转出申请(转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额)之和超过上一日基金总份额的 10%,为巨额赎回。

2. 巨额赎回的处理方式

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接受全额赎回或部分延期赎回。

(1) 接受全额赎回:当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回:当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难,或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时,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 10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例,确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额;未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外,延迟至下一开放日办理,赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权,以此类推,直到全部赎回为止。

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式,在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在至少一种指定媒体上予以公告。

(4) 暂停接受和延缓支付: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,但延缓期限不得超过 20 个工作日,并应当在至少一种指定媒体上公告。

(十) 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者的申购申请:

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请;

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

(3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况;

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

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时,申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时,应当依法公告。在暂停申购的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2. 在以下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请:

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项;

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

(3) 基金连续发生巨额赎回,根据本基金合同规定,可以暂停接受赎回申请的情况;

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值的情况;

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应当在当日向中国证监会备案,并及时公告。除非发生巨额赎回,已接受的赎回申请,基金管理人应当足额支付。

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法公告。

3. 暂停基金的申购、赎回,基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4. 暂停申购或赎回期间结束,基金重新开放时,基金管理人应依法公告并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。

(1) 如果发生暂停的时间为一天,基金管理人将于重新开放日,在至少一种指定媒体,刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2) 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,基金管理人将提前一个工作日,在至少一种指定媒体,刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3) 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;当连续暂停时间超过两个月时,可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前三个工作日,在至少一种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开放日的基金份额净值。

(十一) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定,在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

(十二) 基金的非交易过户、转托管与冻结

1. 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”仅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、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

2. 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理;申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

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

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因,可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

4. 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益(包括现金分红和红利再投资)一并冻结。

九、基金的投资

(一) 投资目标

本基金为股票指数增强型基金,以指数化分散投资为主,适度的增强型主动管理为辅,在严格控制跟踪偏离风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,分享中国经济增长的成果。在正常市场情况下,本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年化跟踪误差不超过 7.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(二) 投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板和创业板,及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具、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,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%, 其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%;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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

(三) 投资策略

本基金为股票指数增强型基金,以上证 380 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动增强,在基本面深入研究与数量化投资技术的结合中,谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收益之间的最佳匹配。

当预期成分股发生调整和成分股发生分红、配股、增发等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金的投资策略包括以下几个层面:

1. 资产配置策略

本基金为股票指数增强型基金,采用“被动投资为主,主动增强为辅”的投资策略。为实现有效跟踪并力争超越标的指数的投资目标,在资产类别配置上,本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%,其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%,其余基金资产可适当投资于债券、权证、货币市场工具、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)。

2. 股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制的方法进行组合构建,按照成分股在上证 380 指数成分股权重分散化投资于上证 380 指数成分股;主动投资组合构建主要依据对上市公司宏观和微观的深入研究,优先在上证 380 指数成分股中对行业、个股进行适度超配或者低配;同时,在公司股票池的基础上,根据研究员的研究成果,谨慎地挑选上证 380 指数成分股以外的股票作为增强股票库,进入基金股票池,构建主动型投资组合。

(1)构建被动投资组合

本基金采用完全复制基准指数的方法,按照个股在基准指数中的权重构建指数化股票投资组合,并根据基准指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到基准指数成分股调整或停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重配置某成分股时,本基金将首选与该成分股行业属性一致、相关性高的其他成分股进行替代;若成分股中缺乏符合要求的替代品种,本基金将在成分股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

(2)构建增强型投资组合

本基金以指数化分散投资为主, 基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性,在严格控制跟踪误差的前提下,辅以适度的增强型主动管理;其目的有二,一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益;二是补偿较高的交易成本及其他费用。增强投资的方法包括:

1) 仓位调整

在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时,基金的股票投资仓位可进行下调,股票资产最低可下调到占基金资产净值的 90%以适度规避市场系统性风险。

2) 基本面优化

基本面优化提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重:

●上市公司基本面较好(根据财务指标等判断),具有鲜明的竞争优势,有持续增长能力。

●中长期估值水平明显高于目前估值水平,在同行业中,股票相对估值偏低。

●其他特殊个股,例如预期将纳入指数的个股。

●包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成分股。

将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重:

●基本面较差,缺乏核心竞争力,经营业绩下滑。

●中长期估值水平明显低于目前估值水平,在同行业中,股票相对估值偏高。

●短期内股价涨幅过高,预期短期内股价将大幅回调。

●其他特殊个股,例如预期将从指数中剔除的个股等。

3) 个股优选

本基金将依托于本公司投研团队的研究成果,精选成分股之外的股票作为增强股票库,在合适的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行适量优化配置,获取超额收益。另外,本基金也可以适当投资一级市场申购的股票(包括新股与增发)。

3. 债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。本基金将通过对宏观经济形势和宏观经济政策分析,预测未来的利率趋势,并据此积极调整债券组合的平均久期;通过对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析,预测收益率曲线的变化趋势,制定组合的期限结构配置策略;通过对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略。

4. 股票组合调整策略

本基金为股票指数增强型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、成分股流动性异常、成分股调整及配股、分红、增发等因素变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的上证 380 指数对其成分股的调整而进行相应的跟踪调整。根据标的指数的编制规则及调整公告,基金经理在指数成分股调整生效前,分析并确定组合调整策略,并报投资决策委员会批准。基金经理通过执行批准后的组合调整策略,尽量减少成分股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

(2)不定期调整

若基金投资组合表现与指数组合表现偏离超过基金管理人确定的预警水平,基金经理将根据市场状况及个股权重偏离状况,制定组合调整策略,降低组合跟踪偏离度。

5. 跟踪误差控制策略

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中,跟踪误差为核心监控指标,跟踪偏离度为辅助监控指标,以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。

(四) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:上证 380 指数收益率×95% +银行活期存款利率(税后)×5%。

上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中小市值成长性新兴蓝筹股指数,以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时,除剔除上证 180 指数样本股外,还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票,以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司,然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名, 根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数, 选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。上证 380 指数以 2003 年 12 月 31 日为基日,基点为 1000 点;指数样本每半年定期调整一次,实施时间分别为每年的 1 月和 7 月的第一个交易日。在两次定期调整之间,若上证 380 指数样本股进入上证 180 指数,该样本立即被调出上证 380 指数,并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。

随着市场环境的变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金时(如基金变更投资比例范围,或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布,或今后法律法规发生变化,又或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数等),本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

(五) 风险收益特征

本基金是股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

(六) 投资决策依据、决策程序和决策调整

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻实施,本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序:

1. 投资决策依据

(1)国家有关法律法规和本基金基金合同的有关规定;

(2)标的指数编制、调整等相关规定,以及基金管理人事先制定的指数模拟和跟踪策略;

(3)本基金对宏观经济走向、产业发展演变及上市公司基本面进行深入分析,对上市公司未来业绩进行预测,通过一定的价值评判标准对上市公司的投资价值进行分析,并在此基础上进行增强投资。

2. 投资决策程序

本基金的投资决策机制为,实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、行业研究员、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下:

(1)策略研究员、行业研究员、债券研究员、金融工程研究员各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

(2)金融工程小组利用量化模型进行指数化投资、投资组合优化和跟踪误差模拟测算,在此基础上进行投资论证,做出投资建议提交给基金经理,并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

(3)基金经理根据金融工程小组提交的指数组合优化及风险测算的结果以及投资研究部提交的投资建议初步决定下一阶段的投资组合策略,形成资产配置提案报投资决策委员会。

(4)投资决策委员会每月召开投资策略会议,决定基金的大类资产配置比例和股票、债券的投资重点等。

(5)投资总监每周召集投资例会,根据投资决策委员会的决定,结合市场和公司基本面的变化,决定具体的投资策略。

(6)基金经理根据投资决策委员会的决策制定相应的指数化投资组合投资和优化方案, 对超出基金经理权限的投资决策须报投资决策委员会审议核准。

(7)基金经理根据经投资决策委员会批准的基金投资组合方案,向交易部下达交易指令。

(8)交易部执行基金经理的交易指令,对交易情况及时反馈。

(9)风险控制部门负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估, 定期提交组合跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时,通知基金经理和相关部门及时进行投资组合的调整。

(10)风险控制部门根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

3. 投资决策调整

在正常市场情况下,本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 7.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(七) 投资限制

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。本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%,其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%;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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

(2) 本基金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%,但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资不受此限制。

(3) 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%,本基金符合中国证监会有关要求的指数化投资部分不计入该限制。

(4) 本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,不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超过基金资产净值的 3%,本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%。

(5) 本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基金资产净值的 10%;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%;本基金管理人管理的全部基金持有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%。

(6) 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,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。

(7) 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%。

(8) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 3%。

(9) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定;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。

(八) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

(九) 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. 向他人贷款或者提供担保;

3. 从事承担无限责任的投资;

4. 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

5. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

(十) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

2. 不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

3. 有利于基金资产的安全与增值;

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

(十一) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

十、基金的财产

(一) 基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

(二) 基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三) 基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户,与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

(四) 基金财产的保管及处分

1. 本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产,并由基金托管人保管。

2. 基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益,归基金财产。

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

4. 基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销;不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

十一、基金财产的估值

(一) 估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值,并为基金份额提供计价依据。

(二) 估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常交易日,以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

(三) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

(四) 估值方法

1. 股票估值方法:

(1) 上市股票的估值:

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;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,以最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

(下转 D7 版)