(上接D14版)

(9)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:张佑君
联系人:权唐
客服电话:400-888-8108
传真:010-65182261
公司网址: www.csc108.com
(10)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
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨
客服电话:95525
公司网址:www.ebscn.com
(11)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层
法定代表人:兰荣
电话:021-38565785
联系人:谢高得
客服电话:400-888-8123
公司网址:www.xyzq.com.cn
(12)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 38-45 层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
传真:0755-82943636
客服务电话:95565
公司网址:www.newone.com.cn
(13)东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 34 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
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82558305
传真:0755-82558555
联系人:陈剑虹
客服电话:400-800-1001
公司网址:www.essence.com.cn
(14)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号
法定代表人:庞介民
电话:0471-4972343
传真:0471-4961259
联系人:王旭华
客服电话:400-660-9926
公司网址:www.cnht.com.cn
(15)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人:高冠江
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
联系人:唐静
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
(16)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层
法定代表人:张智河
联系电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
联系人:吴忠超
客服电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn
(17)中信证券(浙江)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
办公地址: 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:沈强
电话:0571-87112510
传真:0571-86065161
联系人:丁思聪
客服电话:0571-96598
公司网址:www.bigsun.com.cn
(18)华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路 357 号
办公地址:安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座
法定代表人:李工
电话:0551-5161666
联系人:甘霖
客服电话:400-809-6518
公司网址:http://www.hazq.com/
(19)东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
联系电话:010-88085201
联系人:李巍
客服电话:400-800-0562
公司网址:www.hysec.com
(20)日信证券有限责任公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号
法定代表人:孔佑杰
电话:010-88086830-730
传真:010-66412537
联系人:陈韦杉
客服电话:010-88086830
公司网址:www.rxzq.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金,并及时公告。

二、登记机构
长安基金管理有限公司
注册地址:上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 371 室
办公地址:上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 16 楼
法定代表人:万跃楠
联系电话:021-20329775
传真:021-20329779
联系人:徐婵

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
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
负责人:韩炯
联系电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:黎明
经办律师:吕红、黎明

四、审计基金财产的会计师事务所
名称:毕马威华振会计师事务所
注册地址:北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层
办公地址:上海市南京西路 1266 号恒隆广场 1 期 50 楼
法定代表人:姚建华
电话:021-22122888
传真:021-62881889
联系人:王国蓓
经办注册会计师:王国蓓、江雯

第六部分 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》、《信息披露办法》等有关法律法规及《基金合同》,经 2012 年 1 月 30 日中国证监会证监许可 2012[30]号文件核准募集。

一、基金类型和存续期间
基金类型:股票型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
存续期间:不定期

二、募集方式和募集场所
通过各销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的增加销售机构的相关公告。

三、募集期限
自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

四、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、机构投资者和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人。

五、基金份额面值
本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

六、基金的最低募集份额总额
本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

七、认购安排
1、认购时间
本基金的认购时间由基金管理人根据有关法律法规和《基金合同》确定,在基金份额发售公告中列明。

2、认购应提交的文件和办理的手续
投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各销售机构的相关业务办理规则。

3、认购费率
本基金采用前端收费模式,即投资人在认购基金时缴纳认购费,认购费率如下:

单笔认购金额(含认购费)	认购费率
M<100 万	1.2%
100万≤M<500 万	0.8%
M≥500 万	1000元/笔

(注:M 为认购金额,单位为元)

本基金认购费由认购人承担,不列入基金财产。投资人重复认购,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

4、认购份额的计算
登记机构根据单次认购的实际确认金额确定每次认购所适用的费率并分别计算,具体计算公式如下:
当认购费用适用比例费率时,认购份额的计算方法如下:
净认购金额=认购金额/(1+认购费率)
认购费用=认购金额-净认购金额
认购份额=(净认购金额+认购金额在募集期内产生的利息)/基金份额面值
当认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下:
认购费用=固定金额
净认购金额=认购金额-认购费用
认购份额=(净认购金额+认购金额在募集期内产生的利息)/基金份额面值
认购份额的计算保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如:某投资人认购本基金 10,000 元,所对应的认购费率为 1.2%。假定该笔认购金额产生利息 7.25 元。则其认购费用和可得到的基金份额计算如下:
净认购金额=认购金额/(1+认购费率)=10,000/(1+1.2%)=9,881.42 元
认购费用=认购金额-净认购金额=10,000-9,881.42=118.58 元
认购份额=(净认购金额+认购金额在募集期内产生的利息)/基金份额面值=(9,881.42+7.25)/1.00=9,888.67 份

5、认购的方式和确认
1)投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。
2)投资人在募集期内可以多次认购基金份额,认购费按每笔认购申请单独计算,但已受理的认购申请不允许撤销。
3)投资人在 T 日规定时间内提交的认购申请,通常应在 T+2 日到原认购网点查询认购申请的受理情况。
4)销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

6、认购的限制
在募集期内,除份额发售公告另有规定外,投资人在代销机构销售网点每笔认购最低金额为 1,000 元人民币(含认购费);投资人在直销中心首次认购最低金额为 1 万元人民币(含认购费),追加认购的最低金额为 1,000 元人民币(含认购费)。通过本公司网上交易平台办理本基金认购业务的不受直销网点最低认购金额的限制,最低认购金额为单笔 1,000 元(含认购费)。

八、募集资金利息的处理方式
有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以登记机构的记录为准。

九、募集资金的保管
基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件
本基金自基金份额发售之日起 3 个月内,在基金募集份额总额不少于 2 亿份,基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在 10 日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式
如果募集期限届满,未满足募集生效条件,基金管理人应当承担下列责任:
1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息。
3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、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 元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续 20 个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。
法律法规另有规定时,从其规定。

第八部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所
本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间
1、开放日及开放时间
投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
基金合同生效后,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,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
2、申购、赎回开始日及业务办理时间
基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。
基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。
在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。
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或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接收的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则
1、“先知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;
2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;
3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;
4、赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。
基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

四、申购与赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
2、申购和赎回的款项支付
投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付款项,申购申请即为有效。
投资人赎回申请成功后,基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。
3、申购和赎回申请的确认
基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日),在正常情况下,本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请,投资人可在 T+2 日后(包括该日)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。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

五、申购和赎回的数量限制
1、申购金额的限制
投资人在代销机构销售网点每笔申购最低金额为 1,000 元人民币(含申购费);投资人在直销中心首次申购最低金额为 1 万元人民币(含申购费),追加申购的最低金额为 1,000 元人民币(含申购费)。通过本公司网上交易平台办理本基金申购业务的不受直销中心最低申购金额的限制,最低申购金额为单笔 1,000 元(含申购费)。
代销网点的投资人欲转入基金管理人的直销中心进行交易要受直销中心最低金额的限制。
投资人可多次申购,对单个投资人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、赎回份额的限制
基金份额持有人在销售机构赎回时,每笔赎回申请不得少于 100 份基金份额;基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构保留的基金份额余额不足 300 份的,需一并全部赎回。
3、基金管理人可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上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途
1、本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取,不列入基金财产。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。
2、根据基金合同的规定,本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%,赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。
3、本基金的申购费率按照申购金额逐级递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。实际执行的申购费率如下:

单笔申购金额(含申购费)	申购费率
M<100 万	1.5%
100万≤M<500 万	1.0%
M≥500 万	1000元/笔

(注:M 为认购金额,单位为元)

投资人重复申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。
4、本基金的赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减,实际执行的赎回费率如下:

持有时间(Y)	赎回费率
Y<365 天	0.5%
365天≤Y<730 天	0.3%
Y≥730 天	0%

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的部分或全部投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。
6、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

七、申购份额与赎回金额的计算
1、申购份额的计算
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算,具体计算公式如下:
当申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值
当申购费用为固定金额时,申购份额的计算方法如下:
申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值
申购份额的计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。
例一:某投资人申购本基金 10,000 元,对应的申购费率为 1.5%,假设申购当日基金份额净值为 1.128 元,则其申购费用和可得到的申购份额为:
净申购金额=10,000/(1+1.5%)=9,852.22 元
申购费用=10,000-9,852.22=147.78 元
申购份额=9,852.22/1.128=8,734.24 份
2、赎回金额的计算
本基金的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。计算公式如下:
赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用
赎回金额的计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。
例二:某投资人赎回持有期未满 365 天的本基金基金份额 10,000 份,对应的赎回费率为 0.5%,假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元,则其赎回费用和可得到的赎回金额为:
赎回总额=10,000×1.148=11,480 元
赎回费用=11,480×0.5%=57.40 元
赎回金额=11,480-57.40=11,422.60 元
3、基金份额净值的计算
T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。计算公式为:
T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日基金份额的余额数量
本基金份额净值的计算,保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

八、申购份额与赎回份额的登记
1、投资人 T 日申购基金份额成功后,正常情况下,基金登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理登记手续,投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额;
2、投资人 T 日赎回基金份额成功后,正常情况下,基金登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续;
3、基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述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、拒绝或暂停申购的情形
发生下列情形时,基金管理人可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;
2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的申购申请;
3、证券交易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;
4、基金管理人认为接受某笔或某批申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时;
5、基金资产规模过大,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利益的情形;
6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:
1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项;
2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项;
3、证券交易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;
4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回;
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,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式
1、巨额赎回的认定
若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%,即认为是发生了巨额赎回。
2、巨额赎回的处理方式
当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。
(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。
(2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。
(3)暂停赎回:连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

3、巨额赎回的公告
当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告
1、发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。
2、如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。
3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。
4、如发生暂停的时间超过 2 周,暂停期间,基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

十三、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决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,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,并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、基金的非交易过户
基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。
继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

十五、基金的转托管
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。

十六、定期定额投资计划
基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十七、基金的冻结和解冻
基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

第九部分 基金的投资

一、投资目标
本基金为股票型指数基金,力求通过对沪深 300 非周期行业指数进行完全复制,在严格控制跟踪误差的基础上,为投资者提供一个投资于沪深 300 非周期行业指数的有效工具。

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,包括沪深 300 非周期行业指数的成分股及其备选成分股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行和增发)、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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相关规定)。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(包括期权等金融衍生品),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:沪深 300 非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的 90%,在任何交易日日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的 100%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证占基金资产净值的比例为 0-3%,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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

三、投资策略
1、标的指数
本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 非周期行业指数。
沪深 300 非周期行业指数是中证指数有限公司编制的以沪深 300 指数成分股中的非周期行业股票作为样本,能够较为全面反映沪深两市 A 股市场非周期行业运行特点。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。
如果沪深 300 非周期行业指数被停止编制及发布,或沪深 300 非周期行业指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 非周期行业指数不宜继续作为标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等因素选择确定新的标的指数。本基金由于上述原因变更标的指数,不需召开基金份额持有人大会通过,但应及时通知本基金托管人并报中国证监会备案,并在履行必要手续后,在中国证监会指定的媒体上公告,并在更新的招募说明书中列示。若本基金由于变更投资目标、范围或策略而变更标的指数,应当召开基金份额持有人大会。

2、投资策略
本基金采用完全复制方法跟踪标的指数,即按照沪深 300 非周期行业指数的成分股组成及权重构建股票投资组合,进行被动指数化投资。
在建仓期结束后,本基金力争将年化跟踪误差控制在 4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内。
在基金运作过程中,当发生以下情况时,基金管理人将发挥专业优势,对投资组合进行适当调整,使跟踪误差控制在限定范围之内。
(1)标的指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成分股及权重的影响,在适当时机、采用适当方法调整投资组合。
(2)成分股发生新增、剔除等定期或临时调整。基金管理人将预测成分股调整方案,并判断指数成分股调整对投资组合的影响,在此基础上制定投资组合调整策略。
(3)沪深 300 非周期行业指数成分股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将分析这些信息对指数的影响,进而进行投资组合调整分析,确定相应的投资组合调整策略。
(4)基金发生申购赎回、基金分红、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪误差的影响,并相应调整投资组合。
(5)指数成分股的股票停牌、股票流动性不足等其他市场因素的影响,或者法律法规限制等合规因素的影响,使得基金管理人无法依据指数构成购买某成分股的情形。基金管理人将根据市场情况,以跟踪误差最小化为原则,采用样本股替代等方式对投资组合进行调整。
为有效控制投资组合对标的指数的跟踪误差,本基金投资股指期货将本着风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的合约。本基金管理人将根据宏观经济因素和资本市场状况,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估,并通过与现货资产进行匹配,选择合适的投资时机,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整而导致的交易成本和跟踪误差,从而确保投资组合对标的指数的跟踪效果。

3、投资决策依据
以国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定为投资依据,并以维护基金份额持有人利益为最高准则。

4、投资决策原则
(1)合法合规原则。公司各类投资、研究业务应都当严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。
(2)公平交易原则。公司应公平对待不同基金份额持有人、基金份额持有人和其他资产委托人,不得在不同基金财产之间、基金财产和其他委托资产之间直接或通过第三方交易等形式进行利益输送。公司应制定公平交易制度和公平交易规则,明确公平交易的原则和实施措施。
(3)独立性原则。公司基金资产、其他委托资产和固有资产的运作应当严格分离;投资、研究、决策、交易和评估等部门和岗位应当在物理上和制度上隔离。不同的基金要独立运作,分别管理。
(4)相互制约原则。投资业务部门和岗位的设置必须权责分明、相互牵制,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点;
(5)严格授权原则。授权制度是投资管理业务控制的核心,必须贯穿于公司投资管理活动的全过程;
(6)研究制约原则。任何基金投资决策都必须建立在有研究支持的基础之上。

5、投资决策流程
本基金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制定基金投资的整体投资机会和投资原则;决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。
(1)投资部运用数量化模型以及各种风险监控指标,对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算,并提供数量化风险分析报告;研究部对标的指数成分股的基本面和流动性出现变化的企业提供及时的风险分析报告。清算登记部每日提供基金申购赎回的数据分析,供基金经理投资决策参考。
(2)投资决策委员会定期召开会议,依据上述报告对资产配置制定整体投资战略;如遇重大事项,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。
(3)基金经理根据数量风险分析和申购赎回分析报告,在追求跟踪误差最小化的目标下,控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险,降低交易成本。
(4)中央交易室依据基金经理指令,制定交易策略,通过组合交易系统执行指数投资组合的交易。
(5)投资部根据市场变化,定期和不定期地对基金投资业绩进行评估,并提供相关绩效评估报告。
(6)风险管理部根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议。监察稽核部对指数化投资的执行过程进行合规监控。基金经理依据申购赎回和成份股停牌等情况,对投资组合进行监控和调整、控制投资组合的流动性风险。

四、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为 95%×沪深 300 非周期行业指数收益率+5%×活期存款利率(税后)。
本基金追求对标的指数成份股的充分投资,股票资产占基金资产的比例为 90%-95%,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%,因此采用该加权复合方法构建以上业绩比较基准。
如果沪深 300 非周期行业指数被停止编制及发布、被其他指数替代、指数编制方法出现重大变更等原因导致此业绩比较基准不再适用或者更加适合的业绩比较基准,基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,对本基金的业绩比较基准进行调整。本基金由于上述原因变更业绩比较基准,不需召开基金份额持有人大会通过,但应及时通知本基金托管人并报中国证监会备案,并在履行必要手续后,在中国证监会指定的媒体上公告,并在更新的招募说明书中列示。若本基金由于变更投资目标、范围或策略而变更标的指数,相应变更业绩比较基准应当召开基金份额持有人大会。

五、风险收益特征
本基金为跟踪指数的股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

六、投资限制
1、组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)沪深 300 非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的 90%;在任何交易日日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的 100%;
(2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后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;
(3)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%;
(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%;
(6)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%;
(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;
(8)本基金持有的同一(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%;
(9)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%;
(10)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;
(11)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;
(12)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%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
(13)本基金持有的所有流通受限证券,应符合法律法规的相关规定;
(14)本基金对于股指期货投资比例的限制,将遵从中国证监会、中国金融期货交易所的相关规定。
因证券期货市场波动、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。
法律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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

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