股票简称:中远航运　股票代码:600428　编　号:2013-32
债券简称:08 中远债　债券代码:126010

中远航运股份有限公司 第五届董事会第十次会议决议公告

本公司董事会及董事保证本报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、准确性和完整性负个别及连带责任。

中远航运股份有限公司第五届董事会第十次会议于二〇一三年九月二十九日发出通知,本次会议以书面通讯表决形式进行,会议就以下议案征询各位董事意见,议题以专人送达或电子邮件的方式送达每位董事,全体董事已经于二〇一三年十月十日前以书面通讯方式进行了表决,本次会议的召开程序符合《公司法》和《公司章程》的规定,会议合法、有效。全体董事审议并形成了如下决议。

一、审议通过聘任李建雄先生等公司高级管理人员的议案;

因工作原因,公司副总经理郭京先生、杜俊明先生及林敬伟先生提出辞职。与会董事一致同意聘任李建雄先生为公司副总经理兼董事会秘书,吴亮明先生为公司副总经理(个人简历详见附件)。聘任期同公司第五届董事会任期,即至2015年3月29日。

郭京先生、杜俊明先生、林敬伟先生任职期间,工作兢兢业业,任劳任怨,为中远航运的创立、首次公开募集股份、历次重大资本运作及重大改革调整等事项作出了突出贡献,在公司生产经营、船队结构调整等方面作了大量卓有成效的工作,为公司发展壮大作出了重要贡献,公司董事会对此表示衷心感谢!

独立董事就该议案发表了独立意见。

同意票9票,反对票0票,弃权票0票,全票通过。

二、审议通过聘请中远航运2013年度审计会计师事务所的议案;

因公司原聘请的2013年度审计会计师事务所中瑞岳华会计师事务所(特殊普通合伙)(以下简称中瑞岳华)与国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)合并,设立了瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)(以下简称瑞华会计师事务所),原中瑞岳华注销。原中瑞岳华的员工及业务转移到瑞华会计师事务所,并以瑞华会计师事务所的名义为客户提供服务。与会董事一致同意聘请瑞华会计师事务所为公司2013年度审计会计师事务所,聘任期一年,审计费为178万元。

本议案尚需提交公司2013年第三次临时股东大会审议批准。

同意票9票,反对票0票,弃权票0票,全票通过。

三、审议通过召开中远航运2013年第三次临时股东大会的议案。

公司拟定于近期召开2013年第三次临时股东大会,审议《关于审议聘请中远航运2013年度审计会计师事务所的议案》。股东大会具体召开时间等事宜公司将另行通知,并在公司指定网站和报纸上公告。

同意票9票,反对票0票,弃权票0票,全票通过。

特此公告。

中远航运股份有限公司
董事会
二〇一三年十月十一日

附件:个人简历

1、李建雄先生简历

李建雄先生,1959年出生,男,汉族,工商管理硕士。历任广州远洋运输公司船舶三副、二副、集装箱部副科长,中远国际货柜码头香港有限公司商务部经理,中远码头控股有限公司董事、副总经理,中远集装箱服务有限公司董事、总经理,香港上市公司中远太平洋有限公司副总经理,中远太平洋(中国)投资有限公司董事、副总经理,张家港永嘉集装箱码头副董事长,CIMC上海远东箱厂、CIMC海冷箱厂和CIMC天津北洋箱厂董事。2001年至2012年12月担任新加坡上市公司中远投资(新加坡)有限公司副总裁、替代董事,中远海事工程(新加坡)有限公司的董事,南通中远船务工程公司和大连中远船务工程公司董事等。2013年3月起任本公司董事会秘书。

李建雄先生具有开阔的国际视野和丰富的海外上市公司工作经验。在担任新加坡上市公司副总裁期间,主管公司发展战略和投资者关系,分管房地产和海事工程板块,2009年受邀担任新加坡投资者协会董事。具备丰富的航运及相关企业管理经验,工作勤勉尽职,诚实守信。

2、吴亮明先生简历

吴亮明先生,1964年出生,男,汉族,大学本科,高级船长。历任中远(香港)航运有限公司大副、船长,中远航运股份有限公司船舶管理部海务监督员、海务业务经理,广州越洋船务有限公司副总经理,中远航运股份有限公司航运经营部副总经理、常务副总经理,2011年1月起任本公司航运经营部总经理。

吴亮明先生具备丰富的航运公司管理经验,具有较强的敬业精神和开拓意识。担任公司航运经营部负责人后,努力克服市场经营不利形势,在客户维护开拓、市场营销、揽货网点建设和业务管理等方面做了大量工作,取得了较好成效。

证券代码:600428　证券简称:中远航运　公告编号:2013-033
债券代码:126010　债券简称:08 中远债

中远航运股份有限公司 2013年9月主要生产数据公告

本公司董事会及董事保证本报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、准确性和完整性负个别及连带责任。

一、主要生产经营数据

项目	2013年9月	比去年同期增减(备注1)		2013年累计	比去年同期增减(备注1)	
		绝对数	相对数%		绝对数	相对数%
运量(吨)	1,384,731	185,332	15.5	11,055,840	393,057	3.7
周转量(千吨海里)	9,521,141	2,736,657	40.3	67,652,066	4,278,222	6.8
营运率(%)	98.1	1.4	1.4	98.4	1.3	1.3
航行率(%)	54.9	-0.7	-1.3	53.6	0.1	0.2
载重率(%)	62.4	4.9	8.5	58.7	-2.2	-3.6
燃油单耗(千克/千吨海里)	6.5	-1.5	-18.8	7.1	0	0.0

二、分船型运量数据(单位:吨)

项目	2013年9月	比去年同期增减(备注1)		2013年累计	比去年同期增减(备注1)	
		绝对数	相对数%		绝对数	相对数%
多用途船	451,534	24,782	5.8	4,888,974	545,238	12.6
杂货船	461,309	153,555	49.9	2,481,451	16,386	0.7
重吊船	135,762	2,482	1.9	925,971	122,707	15.3
半潜船	3,217	-11,503	-78.1	265,656	80,435	43.4
汽车船	23,106	-14,454	-38.5	185,042	-58,598	-24.1
滚装船	15,979	9,021	129.6	135,210	10,816	8.7
木材船	164,272	26,092	18.9	1,096,221	-451,271	-29.2
沥青船	129,552	-4,643	-3.5	1,077,315	127,344	13.4
合计	1,384,731	185,332	15.5	11,055,840	393,057	3.7

三、备注

1、公司于2013年1月收购广州远洋运输有限公司,广州远洋运输有限公司及全资控股企业共拥有木材船、沥青船等26艘船舶。因此,自2013年1月起,公司公告的月度主要生产数据包括了收购船舶的相关数据。同时,为使公告的生产经营数据具有可比性,公司对2012年的月度及年度累计数据进行了同口径调整。

2、以上生产经营数据源自公司内部统计,仅供投资者了解公司生产经营情况;

3、以上生产数据统计口径均按已完航次;

4、相关航运指标释义详见附件。

特此公告。

中远航运股份有限公司
董事会
二〇一三年十月十一日

附件:相关航运指标释义

1.运量:指船舶运输货物数量;

2.周转量:指船舶运输的货运量与相应的运输距离的乘积;

3.营运率:指一定历期内船舶从事营运的时间占总航次时间的百分比;

$$营=\frac{T营}{T册}$$

4.航行率:指一定历期内船舶航行的时间占营运时间的百分比;

$$航=\frac{T航}{T营}$$

5.载重率:指船舶在一定的行驶距离内船舶定额吨位的平均利用程度;

$$a=\frac{\sum_{m}\sum_{n}Qij_Lij}{\sum_{m}\sum_{n}Dij_Lij}$$

注:Qij---第i艘船在第j航次完成的货运量;

lij----第i艘船在第j航次的货物运输距离;

Dij-----第i艘船的定额吨位;

Lij------第i艘船在第j航次的行驶距离;

6.燃油单耗:指船舶每一周转量所耗费的燃油数量;

$$Q=\frac{耗油量}{周转量}$$

7.营运时间:指船舶总航次时间中,技术状况完好可以从事货物运输工作的时间,它等于船舶总时间减去船舶不能从事生产的非营运时间(如:修理、待修及为修理进出船厂的航行时间,待报废时间,航次以外检修和洗炉时间);

8.航行时间:指船舶从离开港口码头或锚地,浮筒解去最后一根缆绳时起,至到达港靠码头或锚地,浮筒带上第一根缆绳时止的航行时间;

9.停泊时间:指船舶在运输生产过程中,因各种原因在港口或途中全部停泊时间,包括生产性,非生产性和其他原因停泊时间。

证券代码:600428　证券简称:中远航运　公告编号:2013-034
债券代码:126010　债券简称:08 中远债

中远航运股份有限公司 2013年第三季度业绩快报

本公司董事会及董事保证本报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、准确性和完整性负个别及连带责任。

本公告所载2013年第三季度的财务数据未经会计师事务所审计,敬请投资者注意投资风险。

一、主要会计数据(单位:万元)

	本报告期末	上年度期末	本报告期末比上年度期末增减(%)
总资产	1,738,084.22	1,915,941.59	-9.28
所有者权益(或股东权益)	671,751.96	875,200.01	-23.25
归属于上市公司股东的每股净资产(元/股)	3.97	5.18	-23.25
	报告期(7-9月)	年初至报告期期末(1-9月)	本报告期比上年度同期增减(%)
营业收入	202,636.54	565,640.63	2.41
营业利润	-3,531.16	-11,253.65	-1194.86
利润总额	3,593.14	-3,738.60	211.63
归属于上市公司股东的净利润	3,523.39	-4,278.92	235.30

二、主要财务指标

主要财务指标	报告期(7-9月)	年初至报告期期末(1-9月)	本报告期比上年度同期增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.021	-0.025	235.30
扣除非经常性损益的基本每股收益(元/股)	-0.017	-0.065	10.26
加权平均净资产收益率(%)	0.49	-0.61	增加0.79个百分点

三、备查文件

经公司首席执行官韩国敏、主管会计工作的负责人刘雪亮、会计机构负责人黄晓晖签字并盖章的业绩快报原件。

中远航运股份有限公司
董事会
二〇一三年十月十一日

华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告

为答谢广大投资者对华富基金管理有限公司(以下简称"本公司")长期以来的信任与支持,经本公司与徽商银行股份有限公司(以下简称"徽商银行")协商一致,决定自2013年10月15日起,本公司旗下部分开放式基金参加徽商银行网上银行基金申购费率优惠活动。现将有关事项公告如下:

一、适用基金范围

本公司参加徽商银行网上银行基金申购费率优惠活动的基金包括:华富竞争力优选混合型证券投资基金(基金代码:410001)、华富成长趋势股票型证券投资基金(基金代码:410003)、华富收益增强债券型证券投资基金A类基金(基金代码:410004)、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:410006)、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:410007)、华富中证100指数证券投资基金(基金代码:410008)、华富量子生命力股票型证券投资基金(基金代码:410009)、华富中小板指数增强型证券投资基金(基金代码:410010)、华富保本混合型证券投资基金(基金代码:000028)、华富强化回报债券型证券投资基金(基金代码:164105)。

二、优惠活动期间

自2013年10月15日起,结束时间将另行公告。

三、优惠活动内容

投资者通过徽商银行网上银行申购上述基金的(只限前端收费模式),原申购费率高于0.6%的,其申购费率享有4折优惠,优惠后费率低于0.6%的按0.6%执行;原申购费率等于、低于0.6%或为固定费用的,其申购费率按原费率执行。

四、限制条款

本次优惠活动仅针对正常申购期的开放式基金的前端收费模式,不包括基金的后端收费模式和基金募集期的认购费率。

五、重要提示

1、本次优惠活动期间,业务办理以徽商银行业务规则为准。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读所购买基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

2、本次优惠活动解释权归徽商银行所有。

3、请投资者注意基金投资风险。

六、咨询办法

投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况:

1、徽商银行股份有限公司

网站:www.hsbank.com.cn

客户服务电话:400-889-6588

2、华富基金管理有限公司

网站:www.hffund.com

客户服务电话:021-50619688,400-700-8001

特此公告。

华富基金管理有限公司
二零一三年十月十一日

华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加徽商银行股份有限公司为代销机构的公告

根据华富基金管理有限公司与徽商银行股份有限公司的代销业务安排,自2013年10月15日起,徽商银行股份有限公司将代理华富基金管理有限公司旗下华富竞争力优选混合型证券投资基金(基金代码:410001)、华富货币市场基金(基金代码:410002)、华富成长趋势股票型证券投资基金(基金代码:410003)、华富收益增强债券型证券投资基金(基金代码:410004A类;基金代码:410005B类)、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:410006)、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:410007)、华富中证100指数证券投资基金(基金代码:410008)、华富量子生命力股票型证券投资基金(基金代码:410009)、华富中小板指数增强型证券投资基金(基金代码:410010)、华富保本混合型证券投资基金(基金代码:000028)、华富强化回报债券型证券投资基金(基金代码:164105)的销售业务。投资者欲了解详细信息,请仔细阅读上述基金的相关基金合同、招募说明书及上述基金披露的公告。

投资者可在徽商银行股份有限公司的指定网点办理上述基金的开户、申购、赎回、定投、转换(不包括华富强化回报债券型证券投资基金)及其他业务,具体办理程序应遵循徽商银行股份有限公司的相关规定。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、华富基金管理有限公司

网站:www.hffund.com

客户服务电话:400-700-8001,021-50619688

2、徽商银行股份有限公司

网站:www.hsbank.com.cn

客户服务电话:400-889-6588

特此公告。

华富基金管理有限公司
二零一三年十月十一日

景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金最低转换份额限制的公告

为了给投资者提供更好的服务,景顺长城基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定于2013年10月14日起调整旗下基金最低转换份额限制。现将有关事项公告如下:

一、适用基金范围

1.景顺长城景系列开放式证券投资基金下设之景顺长城优选股票证券投资基金(基金代码:260101)、景顺长城货币市场证券投资基金(基金代码:260102(A级)/260202(B级))和景顺长城动力平衡证券投资基金(基金代码:260103);

2.景顺长城内需增长开放式证券投资基金(基金代码:260104);

3.景顺长城新兴成长股票型证券投资基金(基金代码:260108);

4.景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金(基金代码:260109);

5.景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金(基金代码:260110);

6.景顺长城公司治理股票型证券投资基金(基金代码:260111);

7.景顺长城能源基建股票型证券投资基金(基金代码:260112);

8.景顺长城中小盘股票型证券投资基金(基金代码:260115);

9.景顺长城稳定收益债券型证券投资基金(基金代码:A类261001,C类261101);

10.景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金(基金代码:260116);

11.景顺长城优信增利债券型证券投资基金(基金代码:A类261002、C类261102);

12.景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金代码:263001);

13.景顺长城支柱产业股票型证券投资基金(基金代码:260117);

14.景顺长城品质投资股票型证券投资基金(基金代码:000020)。

注:上述同一基金不同类别的基金份额间不开放相互转换业务。

二、调整方案

自2013年10月14日起,本公司上述基金在直销机构及其他销售机构的最低转换转出份额降至1份(其他销售机构另有规定高于本公司最低转换限额的,从其规定),最低转入金额不限。

三、其他注意事项

1.投资者应根据本公司各销售机构的规定在基金开放日申请办理基金转换业务,具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。

2.关于基金转换业务的相关费率计算及规则请另行参见本公司相关公告。

3.投资者办理基金转换业务时,应留意本公司相关公告,确认转出基金处于可赎回状态,转入基金处于可申购状态。

投资者可拨打本公司客户服务热线:4008888606(免长话费)咨询相关信息。

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

景顺长城基金管理有限公司
二〇一三年十月十一日

景顺长城大中华股票型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告

公告送出日期:2013年10月11日

1.公告基本信息

基金名称	景顺长城大中华股票型证券投资基金	
基金简称	景顺长城大中华股票(QDII)	
基金主代码	262001	
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司	
公告依据	《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》和《景顺长城大中华股票型证券投资基金招募说明书》	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2013年10月14日
	暂停赎回起始日	2013年10月14日
	暂停定期定额投资起始日	2013年10月14日
	暂停申购、赎回、定期定额投资的原因说明	2013年10月14日为香港交易所节假日(香港重阳节翌日)。

注:1、自2013年10月15日起恢复办理日常申购(含定期定额申购)、赎回业务,届时本公司不再另行公告。

2、投资者可通过以下代销机构网点进行咨询:

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、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、金华银行股份有限公司、嘉兴银行股份有限公司。

长城证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、安信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、方正证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、中航证券有限公司、中信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国盛证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、西南证券股份有限公司。

深圳众禄基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司和万银财富(北京)基金销售有限公司。

3、投资者可以登录本公司网站(www.invesco greatwall.com)查询或者拨打本公司的客户服务电话(400 8888 606)垂询相关事宜。

4、风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

(上接B50版)

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金标的指数使用费;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

(6)基金上市费及年费;

(7)基金份额持有人大会费用;

(8)基金的证券交易费用;

(9)基金的银行汇划费用;

(10)基金收益分配中发生的费用;

(11)基金的开户费用、账户维护费用;

(12)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2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、公休假或不可抗力等,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.13%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.13%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

(3)《基金合同》生效后的标的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提,且收取下限为每季度(包括基金成立当季)人民币5万元。计算方法如下:

H=E×0.03%÷当年天数

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算,逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

在基金存续期内,如果基金管理人与指数所有人中证指数有限公司签订的指数使用许可协议中关于"指数使用费"的内容有所修改的,将按照最新的内容进行费用计提和支付,此事无须召开份额持有人大会。

上述"一、基金费用的种类中第(4)—(12)项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)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;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

5、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定酌情调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人须于新的费率实施日前在指定媒体上公告。

(五)基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

2、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债存债、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及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。

本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产的90%;权证、股指期货以及其他金融工具的投资比例须符合法律法规和中国证监会的规定。

3、投资限制

(1)组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

1)本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产的90%;

2)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计(轧差计算)不得超过基金资产净值的100%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

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%;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%;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%;

4)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%;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%;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%;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%;

5)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;

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,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;

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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

8)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金申购或赎回带来现金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。法律法规另有规定的从其规定。

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。

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,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)违反规定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,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;

5)向基金管理人、基金托管人出资;

6)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;

7)依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

本基金运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合中国证监会的规定,并履行信息披露义务。

法律法规或监管部门调整上述限制的,本基金从其规定。

(六)基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

2、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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,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估值方法估值;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估值方法估值;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)股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

(4)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。

(5)对交易所上市的资产支持证券品种,鉴于其交易不活跃,各产品的未来现金流量也较难确认,按成本估值。

(6)对只在上海证券交易所固定收益平台进行交易的公司债,按照成本法进行估值。

(7)对只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的公司债,按照成本法进行估值。

(8)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。

(9)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。

(10)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。

3、基金资产净值、基金份额净值的公告

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

(七)基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

(1)变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

(2)关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案后生效,自决议生效后两日内在指定媒体公告。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行适当程序后,《基金合同》应当终止:

(1)基金份额持有人大会决定终止的;

(2)基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

(3)《基金合同》约定的其他情形;

(4)相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

(1)基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算小组组成:基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(4)基金财产清算程序:

1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

3)对基金财产进行估值和变现;

4)制作清算报告;

5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

6)将清算报告报中国证监会备案并公告。

7)对基金财产进行分配;

(5)基金财产清算的期限为6个月或根据登记结算公司的规定完成。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司等登记结算公司的最低结算备付金和交易席位保证金等未结事项占用资金,该资产可由基金管理人垫付后先行分配投资者,并由基金财产清算小组在相关登记结算公司对其进行调整并完成变现收回后返还基金管理人。

由于登记结算公司最低备付金、交易保证金制度及基金托管人清算规则的影响,以下作为清算未结事项:

1)证券账户销户;

2)托管资金账户销户;

3)开立的其它交易结算账户销户、席位退租清理等事项;

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、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

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会,按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

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。

《基金合同》受中国法律管辖。

(九)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

七、基金财务状况

深圳证券