东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

(上接B11版)

如果在存款期限内,由于基金规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要,经与定期存款行友好协商,基金管理人可以提前支取全部资金,但应继续按原有利率计提利息,因提前支取导致的利息损失应由基金管理人承担。

提前支取的具体事项按照基金管理人与存款行签订的《存款协议书》执行。

(6)银行存款相关文件的保管

1)基金资金存入存款银行当日,存款行分支机构开具存款证实书或其他有效存款凭证,同时传真复印件给托管行和基金管理人,并寄送原件给托管人代为保管;若存款行代为保管存单原件,存款行传真复印件给托管行和基金管理人

2)存款证实书或其他有效存款凭证原件由基金托管人保管。基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在10个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在10个工作日内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在10个工作日内纠正或拒绝结算,若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失,基金托管人不承担任何责任。

6、本基金投资中小企业私募债券的应符合证监会《关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(1)基金管理人应在基金首次投资中小企业私募债券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资中小企业私募债券的投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案、信用风险处置预案等。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(2)基金管理人对本基金投资中小企业私募债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。

(3)基金托管人有权根据基金管理人制定的风险控制制度对基金管理人投资中小企业私募债券的额度和比例进行监督。如果基金管理人对相应风险控制制度进行修改的,应及时修订后通知基金托管人。

(4)基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督,如发现异常情况,应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人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。

如因市场变化,基金管理人投资的中小企业私募债券超过投资比例的,基金托管人有权要求基金管理人在10个交易日内将中小企业私募债券调整至规定的比例要求。

7、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。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人,否则由此造成的损失应由基金管理人承担。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。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单,但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。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需要临时调整银行间债券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个交易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。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内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。

8、本基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(1)本协议所称的流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券,且限于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的,并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购,不得预付任何形式的保证金,法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券,且锁定期不得超过本基金的封闭期剩余期限,但法律法规或中国证监会另有规定的除外。

(2)基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

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。

(3)基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息,致使基金托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的,基金托管人免于承担责任。

(4)基金托管人依照法律法规、《基金合同》、《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定,应及时通知基金管理人,并呈报中国证监会,同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》的投资指令不予执行,并立即通知基金管理人纠正,基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时,基金托管人应向中国证监会报告。

9、基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究,认真评估中期票据投资业务的风险,本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定,制定了经公司董事会批准的《基金投资中期票据管理办法》(以下简称《制度》),以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的,以本协议的约定为准。

(1)基金投资中期票据应遵循以下投资限制:

1) 中期票据属于固定收益类证券,基金投资中期票据应符合法律、法规及《基金合同》中关于该基金投资固定收益类证券的相关比例及期限限制;

2)基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的10%;

(2)基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于:

基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督,如发现异常情况,应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人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。

(3)如因市场变化,基金管理人投资的中期票据超过投资比例的,基金托管人有权要求基金管理人在10个交易日内将中期票据调整至规定的比例要求。

10、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。

11、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。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人,对于收到的书面通知,基金管理人应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。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。

12、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。包括但不限于:对基金托管人发出的提示,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。

13、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及时纠正,由此造成的损失由基金管理人承担。

14、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。

(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、证券账户和期货账户等投资所需账户、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。

3、基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查,包括但不限于:对基金管理人发出的书面提示,基金托管人应在规定时间内答复并改正,或就基金管理人的疑义进行解释或举证;基金托管人应积极配合提供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。

4、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。

(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、证券账户和期货账户等投资所需账户。

(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。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人不承担。

(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银行托管账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收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。

(7)基金托管人应安全、完整地保管基金资产;未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失,基金托管人不承担责任。

(8)基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的委托财产,或交由期货公司或证券公司负责清算交收的委托资产(包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等)及其收益;由于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等不承担责任。

(9)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开立"基金募集专户"。该账户由基金管理人开立。

(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,注册登记机构应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金银行托管账户,同时在规定时间内,基金管理人应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、基金银行托管账户的开立和管理

(1)基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行托管账户,保管基金的银行存款,并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行托管账户预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

(2)基金银行托管账户的开立和使用,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)基金银行托管账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

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、深圳分公司为本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、债券账户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定,以本基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。

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,由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本合同的约定协商后开立。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按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库,或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,实物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,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

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。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果,由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

(五)基金资产净值计算与复核

基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

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、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金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,则按相关法律法规承担责任。

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。基金管理人和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

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上海国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为上海市,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)托管协议的变更与终止

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备案。

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。

二十二、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)基金份额持有人交易资料的寄送服务

本基金成立后每次交易结束后,投资者可在T+2个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单。

基金管理人在每年第1-3季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易的投资者寄送季度对账单,在每年第4季度结束后向定制纸质对账单且季度内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资者寄送年度对账单。

由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者,敬请及时通过本公司网站,或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

(二)定期定额投资计划

通过定期定额投资计划,投资者可以通过固定的渠道,定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则和开放时间另行公告。

(三)免费信息定制服务

基金客户可以通过拨打电话、发送邮件等方式定制每周基金净值、季度电子对账单等服务,基金管理人通过手机短信、E-MAIL定期为客户发送所定制的信息。

(四)客户呼叫中心电话服务

客户呼叫中心自动语音系统提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

客户呼叫中心人工坐席提供每周5天、每天不少于8小时的座席服务,投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

(五)客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、客户呼叫中心人工热线、书信、电子邮件等方式对基金管理人和销售网点所提供的服务以及基金管理人的政策规定进行投诉。

(六)基金管理人客户服务联络方式

客户呼叫热线:4009200808,工作时间内可转人工坐席。
传真:(021)63326981
公司网址:www.dfham.com
电子信箱:dfhjhlc@orientsec.com.cn

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,投资者可在办公时间查阅。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。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所,在办公时间可供免费查阅。

(一)中国证监会准予东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
(二)《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(三)《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
(四)基金管理人业务资格批件、营业执照
(五)基金托管人业务资格批件、营业执照
(六)关于申请募集注册东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
(七)注册登记协议
(八)中国证监会要求的其他文件

上海东方证券资产管理有限公司
二〇一四年八月二十日

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告

(上接B9版)

1)本人有效身份证明原件(身份证、户口本、军人证等);
2)指定银行账户的证明原件及复印件;
3)填妥的开户申请表;
4)代销机构要求的其他资料。

(2)提出认购申请:

个人投资者在开立代销机构交易账户后,可提出基金认购申请,应提供以下资料:

1)指定银行账户的证明原件及复印件;
2)填妥的认购申请表;
3)基金交易卡;
4)深圳开放式基金账户(已在该代销机构开立过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司基金账户的投资者无需再次办理,已在其他机构开立过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司基金账户的投资者仅需在该代销机构开通已有基金账户);
5)代销机构要求的其他资料。

(3)注意事项:

1)没有银行借记卡的投资者可当场办理,但建议有意认购的投资者提前办理;

2)个人投资者在代销机构开户和认购的详细程序如与上述规定有所不同,或若代销机构有其他方面的要求,以各代销机构的规定和说明为准。

二、机构客户的认购程序

(一)直销网点

如果机构客户认购金额在500,000元(含500,000元)以上,可以选择到本公司直销中心办理。

1、业务办理时间:2014年8月25日至2014年9月23日9:30-15:00(周六、周日、法定节假日不营业)。

2、机构客户办理开户申请时,应由指定经办人亲赴直销网点,并提供下列资料:

(1)加盖单位公章的企业法人营业执照复印件及副本原件;事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件;
(2)业务授权委托书;
(3)业务经办人有效身份证件原件及复印件;
(4)印鉴卡一式两份;
(5)指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件(或指定银行出具的开户证明);
(6)填妥的《机构投资者风险承受能力评估问卷》、《开放式基金账户业务申请表》和《权益须知》,未在直销网点开户的还需提交开户申请,并加盖单位公章。

注:"指定银行账户"是指:在本直销网点认购基金的客户需指定一银行账户作为客户赎回、分红等资金结算汇入账户。此账户可为客户在任一商业银行的存款账户,账户名称必须与客户名称严格一致。

3、认购资金的划拨程序:

(1)机构客户开户后,在办理认购手续前,应将足额资金通过银行系统汇入富国指定的银行账户:

户名:上海东方证券资产管理有限公司
开户行:中国农业银行股份有限公司上海卢湾支行
账号:03492300040015591
大额支付号:103290028025

(2)汇款时,客户必须注意以下事项:

1)客户务必在"汇款人"栏中完整填写其在东证资管直销系统开户登记的客户全称,汇款的账户必须与开户时预留的银行账户一致;

2)汇款完成后,客户应尽快将加盖银行业务受理章的汇款单回单联传真至上海东方证券资产管理有限公司。

4、机构客户办理认购申请时,应提供以下资料:

(1)业务经办人有效身份证件原件;
(2)填妥的《基金风险确认单》和《开放式基金交易业务申请表》,并加盖预留印鉴章。

(二)招商银行

1、网点办理:

(1)开户及认购的时间:上午9:30至下午15:00(当日15:00之后的委托将于下一工作日办理),基金最后一个份额发售日,募集截止时间为当日15:00。周六、周日暂停受理。

(2)机构投资者开户及认购程序:

a)事先办妥招商银行机构活期存款账户并存入足额认购资金。

b)由被授权人到开户会计柜台提交以下材料,办理开户手续:

① 被授权人携带授权机构银行存款账户的印鉴、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。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 法定代表人身份证件复印件;
③ 基金业务授权书;
④ 被授权人有效身份证明及复印件、印鉴;
⑤ 填妥的开户申请表并加盖公章。

c)开户同时可办理认购手续,需填妥并提交基金认购申请表。

2、注意事项:

(1)若有其他方面的要求,以招商银行的说明为准。
(2)机构活期存款账户须是人民币存款账户。

(三)东方证券股份有限公司

1、开户和认购的时间:2014年8月25日至2014年9月23日9:30—11:30和13:00—15:00(周六、周日及节假日不受理)。

2、机构投资者开户和认购的程序:

(1)事先在东方证券股份有限公司营业部开立资金账户,并存入足额认购资金。如果没有,携带如下材料到营业部办理资金账户开户,同时办理基金账户开户。

1)机构证件原件和加盖公章的复印件:营业执照副本原件和加盖公章的复印件或民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件和加盖公章的复印件;
2)经办人证件原件和复印件;
3)填妥的《开放式基金基金账户开户申请表》;
4)法定代表人身份证件及其复印件,法定代表人签发的授权委托书(法定代表人签字加盖公章);
5)法定代表人身份证明书(加盖机构公章)。

(2)如果已有资金账户,到网点提交以下材料办理开户手续:

1)填妥的开户申请表;
2)有效法人营业执照(副本)或其他主管部门颁发的注册登记证书,上述文件需同时提供复印件(加盖机构公章);
3)机构经办人身份证件及复印件;
4)开户授权委托书(加盖机构公章和法定代表人章);
5)法定代表人身份证明文件(加盖机构公章);
6)证券公司资金账户卡。

(3)开户同时可办理认购手续,需填妥并提交基金认购申请表。

3、注意事项:

(1)机构投资者在代销券商代销网点开立资金账户和开放式基金账户的具体手续可能有所区别,请投资者仔细阅读代销网点的业务公告或咨询代销网点的相关工作人员;

(2)机构投资者需由授权的业务经办人本人到代销机构指定的代销网点办理开户和认购手续。

(3)机构投资者在代销券商代销网点认购本基金的方式包括电话、互联网、磁卡自助、热自助等,具体可以采用的方式以代销网点的规定为准;

(4)机构投资者在代销券商代销网点查询认购确认情况的方式可能有所区别,以代销网点的规定为准;

(5)其他有关在代销券商代销网点认购本基金的程序,若有其它方面的要求,以代销券商代销网点的说明为准。

(四)其他代销机构

以下程序原则上适用于代销本基金的其他代销机构,此程序原则仅供投资者参考,具体程序以各代销机构的规定和说明为准。

1、业务办理时间:各代销机构营业日的受理时间,以代销机构的具体规定为准。

2、开户与认购的程序

(1)开立银行交易账户:机构投资者必须由指定的经办人亲自到网点办理交易账户的开户手续,并提交以下资料:

1)加盖单位公章的企业法人营业执照复印件及副本原件;事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件;
2)基金业务授权委托书;
3)业务经办人有效身份证件原件;
4)机构活期存款账户的印鉴卡;
5)填妥的开户申请表并加盖单位公章和法定代表人名章。
6)深圳开放式基金账户(已在该代销机构开立过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司基金账户的投资者无需再次办理,已在其他机构开立过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司基金账户的投资者仅需在该代销机构开通已有基金账户)。

(2)提出认购申请:

机构投资者在开立银行交易账户后,可提出基金认购申请,应提供以下资料:

1)业务经办人有效身份证件原件;
2)加盖预留印鉴的认购申请表。

(3)注意事项:

1)同一机构投资者只能在代销机构开立一个基金交易账户,并只能指定一个人民币活期结算账户作为与之关联的资金账户;

2)机构投资者在代销机构开户和认购的详细程序如与上述规定有所不同,或若代销机构有其他方面的要求,以各代销机构的规定和说明为准。

五、清算与交割

1、本基金合同生效前,全部认购资金将被冻结在中国证券登记结算有限责任公司的募集专户中,认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息以注册登记机构的记录为准。利息折成基金认购份额不收取认购费、不受最低认购份额限制。

2、在募集期结束后,本基金权益登记由基金管理人(上海东方证券资产管理有限公司)在中国证券登记结算有限责任公司办理完成。

六、退款

1、个人及机构客户认购失败(指客户的认购申请未得到过户登记人的确认)时,其认购资金将于基金合同生效之日起5个工作日内向客户指定银行账户划出。

2、在募集期结束后,如果本基金合同不能生效,本基金管理人承担全部募集费用,将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天内退还基金认购人。

七、基金的验资与基金合同的生效

本基金募集期满,达到合同规定的条件,基金合同方可生效。

1、募集期截止后,由银行出具各基金募集专户存款证明,由基金管理人委托具有资格的会计师事务所对认购资金进行验资;

2、注册登记机构确认数据将该基金的有效认购资金和认购资金在认购期所生利息扣除认购费用后一并划入该基金托管账户。由该基金托管账户开户行出具基金存款证明后,基金管理人委托具有资格的会计师事务所对各基金资产进行验资并出具报告,注册登记机构出具认购户数证明;

3、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。基金管理人在《基金合同》生效的次日发布基金合同生效公告。

八、基金合同生效前的费用处理

本基金合同生效前与基金相关的会计师费、律师费、信息披露费从认购费中列支,不在基金资产中列支。

九、本次募集当事人或中介机构

(一)基金管理人
名称:上海东方证券资产管理有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼31层
法定代表人:王国斌
联系电话:(021)33315895
传真:(021)63326381
联系人:廉迪
公司网址:www.dfham.com

(二)基金托管人
名称: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
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户服务电话:95555(全国)
网址:www.cmbchina.com

(三)销售机构
1、直销机构
名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼31层
法定代表人:王国斌
联系电话:(021)33315895
传真:(021)63326381
联系人:廉迪
公司网址:www.dfham.com

2、场内代销机构
场内代销机构是指具有基金代销资格的深圳交易所会员单位。

3、场外代销机构
(1)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
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户服务电话:95555(全国)
网址:www.cmbchina.com

(2)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层—29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层—29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:胡月茹
电话:(021)63325888
传真:021—63326173
客户服务电话:(021)95503
网址:www.dfzq.com.cn

(3)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系电话:(021)60897840
传真:(0571)26698533
联系人:张裕
客服电话:4000766123
公司网站:www.fund123.cn

(4)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
联系电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
联系人:童彩平
客服电话:4006788887
公司网站:www.zlfund.cn

(四)注册登记机构:
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:任瑞新

(五)律师事务所和经办律师
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:黎明
经办律师:黎明、孙睿

(六)会计师事务所和经办注册会计师
名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市黄浦区南京东路61号4楼
办公地址:上海市黄浦区南京东路61号4-11楼
法人代表:朱建弟
经办注册会计师:朱颖、尤文杰
电话:021- 63392558
传真:021- 63391166
联系人:尤文杰

上海东方证券资产管理有限公司
二〇一四年八月二十日

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要

(上接B9版)

(1)一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;除下列第2项所规定的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。

(2)特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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,提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人,符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

7、计票

(1)现场开会

1)如大会由基金管理人或基金托管人召集,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选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

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

3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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出席大会的,不影响计票的效力。

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下,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(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。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。

8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决定的事项自完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作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。

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议。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。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

1、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。

2、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未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

(1)封闭期间,基金收益分配采用现金方式;本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,其基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资,投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额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红利;登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金红利方式,不能选择红利再投资;

(2)本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(3)封闭期内,本基金的收益分配,每年不得少于一次,且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的90%。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配6次,且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的25%;

(4)若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配;

(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)法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

5、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

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。

6、基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日的单位基金资产净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》的有关规定执行。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、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)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金的证券、期货交易费用;
(7)基金的银行汇划费用;
(8)基金上市初费和上市月费;
(9)证券、期货账户开户费用和账户维护费;
(10)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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金管理人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)证券账户开户费用:证券账户开户费由基金托管人在开户时先行垫付,基金在证券账户开户两个月内成立的,经基金管理人与基金托管人核对无误后,自证券账户开户两个月内由基金托管人从基金财产中扣划;如证券账户开户两个月内基金未能成立,由基金管理人在收到基金托管人缴费通知后的5个工作日内支付给基金托管人,基金托管人不承担垫付开户费用义务。

上述基金费用的种类中第3—10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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
(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、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费。

调高基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率或基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

5、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。

五、基金资产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金以追求绝对收益为目标,在有效控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。

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,包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含中小企业私募债)、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债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的相关规定)。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的,本基金可参与同业存单的投资,不需召开基金份额持有人大会,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

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。

本基金的投资比例为:本基金转换为上市开放式基金(LOF)后股票资产投资比例为基金资产的0%—95%,封闭期内股票资产投资比例为基金资产的0%—100%;权证投资比例为基金资产净值的0%-3%;

本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,每个交易日日终,在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货和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。

待基金参与证券投资基金投资、融资融券和转融通业务等的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与证券投资基金投资、融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与证券投资基金投资、融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

本基金在中国经济增长模式转型的大背景下,寻找符合经济发展趋势的行业,积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会,挖掘重点行业中的优势个股,自下而上精选具有核心竞争优势的企业,分享转型期中国经济增长的成果,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。

(1)资产配置

本基金通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。

(2)股票组合的构建

本基金股票投资主要遵循"自下而上"的个股投资策略,利用基金管理人投研团队的资源,对企业内在价值进行深入细致的分析,并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好,符合转型期中国经济发展趋势的上市公司股票进行投资。

1) 中国经济发展的趋势

A) 新型城镇化

城镇化是扩大内需、拉动经济增长的持久动力。城镇化带动大量农村人口进入城镇,带来消费需求的大幅增加,同时还产生庞大的基础设施、公共服务设施以及住房建设等投资需求。

城镇化既创造了供给,也能够创造需求。推进城镇化将从基础设施建设和消费市场扩大两方面消化工业化带来的产能。此外,城镇化和第三产业的发展紧密相连,城镇化还可以推进消费和服务行业发展,实现经济结构转型。

我国的城镇化率刚刚超过50%,仍然处于快速提升的阶段。与发达国家相比,我国的城镇化率仍然有较大上升空间。但是受到人口、土地、资源、环境等诸多因素制约,传统的以基建投资和圈地造城为主要手段的城镇化方式已经面临越来越高的成本约束,走到了尽头。如何把潜在的空间变为现实,解决的办法只有依靠改革。十八大以来政府推行的一系列市场化改革措施,就是旨在通过改革财政金融体系、土地制度、户籍制度、人口政策、要素价格、人力资本等多方面,优化资源配置效率,提升全要素生产率,从而跨越中等收入陷阱。

未来的城镇化图景一定有别于过去,核心是人的城镇化。它应该着眼农村和中小城镇,实现城乡基础设施一体化和公共服务均等化,进城人口的市民化,促进经济社会发展,实现共同富裕。以新型工业化为动力,实现制造业和服务业升级,投入资本的回报率逐步提升,人力资本在收入分配中的占比提升,消费和服务业占GDP的比重提高,资源和环境更加友好。新型城镇化将带动消费和服务产业大发展,尽管增长速度的绝对值未必比得上过去,但增长将更有质量和更加可持续。

B)人口结构变化

随着出生率的下降、婴儿潮部分人口步入老龄以及预期寿命的延长,我国人口结构将发生巨大的变化,在未来的十五到二十年内这个趋势是无可逆转的。随着人口结构的调整,将给传统的经济模式带来挑战与考验,同时对相关产业带来投资机会。比如将形成大量对于自动化的需求以替代人工;比如由于人口老龄化的增多,使得医疗服务业、养老产业的市场需求迅速进入到爆发周期;又比如人口结构的剧变也会驱动着人口政策随之变化,从而带来相关投资机会。

C)资源环境约束

中国经济经过30多年的高速发展,以GDP单一考核的机制,已经让环境付出了巨大代价。环境治理、能源结构调整、要素价格改革将为中国的环保服务、新能源产业和设备商等带来新一轮的发展机遇。同样,也将对传统产业的行业集中度产生影响,从而改变企业的投资价值。

D)产业升级和商业模式创新

由于人口和资源环境约束,传统型企业正在逐渐失去成本优势,迫切需要转型升级来提高附加值和竞争力。这种机会既有产业层面的,比如劳动力结构的智力化带来的工程师红利,将直接表现为我国科技型企业的人均效率和成本优势。也有企业层面的,更多依靠企业家的勤奋和创新精神,运用智能化生产、信息和网络技术、新材料技术等先进手段来建立创新型企业,或者改造传统企业。

产业升级带来的投资价值提升是巨大的,重要的是回避了低水平恶性竞争,提高了企业的附加值。企业的人均产出和人均效益将得到提升,资产由重变轻,更多依靠创新来获得竞争优势。另外,人力资本高端化正在成为重要的趋势,有些企业在享受这种红利,比如在互联网、生物医药、先进制造业等领域,已经在局部领域具有了全球一流的竞争力,这样的企业数量必然会越来越多。

随着互联网逐渐成为人们生活中无所不在的基础设施,互联网化已成为一个趋势。互联网化是指企业利用互联网(包含移动互联网)平台和技术从事的内外部商务活动。随着企业互联网化的发展,对传统商业模式进行优化、创新、甚至替换,带来了巨大的投资机会。

2)行业配置策略

在行业配置层面,本基金会倾向于一些符合转型期中国经济发展趋势的行业或子行业,比如由人口老龄化驱动的医疗行业、具有品牌优势的消费品行业、可以替代人工的自动化行业等。具体分析时,我们会跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC变动情况,依此来判断各行业的景气度,再根据行业整体的估值情况,市场的预期,目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。

3)股票投资选择

针对个股,每个报告期基金管理人都会根据公开信息和一些假设推理初筛一批重点研究标的,围绕这些公司,基金管理人的股票研究团队将展开深入的调研,除了上市公司外,基金管理人还会调研竞争对手,产业链的上下游,以此来验证基金管理人的推理是否正确。对于个股是否纳入到组合,基金管理人会重点关注3个方面:公司素质,公司的成长空间及未来公司盈利增速、目前的估值。其中公司素质是基金管理人最看重的因素,包括公司商业模式的独特性、进入壁垒、行业地位、公司管理层的品格和能力等方面;对于具有优秀基因的公司,如果成长性和估值匹配的话,基金管理人将其纳入投资组合;否则将会放在股票库中,保持持续跟踪。

(3)折价和套利策略

本基金可运用在封闭期没有流动性需求的优势,抓住一些长期投资的机会,在价值低估或者有折价机会的时候介入,将价值回归转化为投资收益。

1)大宗交易策略

基金管理人将利用自身在二级市场的规模及影响力的优势寻找大宗交易机会,并综合考虑二级市场价格、折价情况、大宗交易数量、二级市场成交量、交易对手减持目的等多种因素,同时根据公司的基本面情况审慎做出买入决定,对于一些好的大宗交易机会,可利用基金有一定封闭期的优势承诺锁定一定期限,以获得优先获得大宗交易的机会或以此获得更大的折扣优惠,并根据历史和实时交易数据设计了自动化交易算法和交易系统,以扑捉有利的卖出时机,同时尽可能的减小卖出股票时的冲击成本,从而将以大宗交易方式买入股票时的折价转化为基金的收益。

2)可转换债券

基金管理人在进行可转换债券投资时,首先以债性作为依托进行选择,利用对股票的判断选择可转换债券可以接受的转股溢价率,积极捕捉可转换债券的套利机会。当可转换债券的转换溢价率为负时,买入可转换债券的同时卖出标的股票可以获得套利价差;反之,买入标的股票的同时卖出可转换债券也可以获得套利价差。当对可转换债券未来的转换溢价率有比较明确的趋势判断时,该种套利策略同样适用。另外,基金管理人在投资时不轻易进行条款博弈,但可以通过分析大股东转股动力来进行投资。

3)参与定向增发投资策略

基金管理人将通过实地调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息;对定向增发价格的合理性做出判断,并结合上市公司大股东参与定向增发的情况,在进行全面和深入研究的基础上做出投资决定,在控制风险的基础上力求获取较高的收益。

4)定向增发破发股票投资策略

基金管理人将密切关注当前已经实施完定向增发,且还处于锁定期的上市公司,当二级市场股价跌破定向增发价时,通过考虑定向增发数量、发行对象、大股东认购方式、增发锁定期限、资金运用目的等因素,并结合发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息,同时结合当前股价在技术面的情况,在定向增发达到一定的破发幅度后择机买入,在定向增发股票解禁日逐渐临近或定向增发股票解禁后择机卖出,以获取破发回补的收益。

(4)债券等其他固定收益类投资策略

本基金的固定收益类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的,具有良好流动性的金融工具。固定收益投资主要用于提高非股票资产的收益率,管理人将坚持价值投资的理念,严格控制风险,追求合理的回报。

在债券投资方面,管理人将以宏观形势及利率分析为基础,依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标,结合货币政策、财政政策的实施情况,以及国际金融市场基准利率水平及变化情况,预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,进行定量评价。

(5)中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时,将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时,将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债,以降低信用风险。

(6)股指期货投资策略?

本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萃取相应股票组合的超额收益。

(7)国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。

4、投资限制

(1)投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

1)在封闭期内,本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—100%,在本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—95%;

2)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;

3)本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,每个交易日日终在扣除国债期货和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,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货和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;

4)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

5)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%;

6)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%;

7)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%;

8)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%;

9)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%;

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%;

11)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%;

12)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%;

13)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;

14)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

15)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,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

16)本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,每个交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,封闭期内的每个交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和,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;

17)本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

本基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

18)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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

19)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%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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30%;

20)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;本基金投资中小企业私募债券的剩余期限,不得超过本基金封闭期的剩余期限;

21) 流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》(证监基金字[2006]141号)及相关规定执行;

22)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。

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,则在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制。

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。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。

(2)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)违反规定向他人贷款或提供担保;
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)法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(3)关联交易原则

基金管理人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。

5、业绩比较基准

本基金在封闭期内的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后);

本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

其中,三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。

本基金以实现绝对收益作为投资目标,在封闭期内,可运用在封闭期没有流动性需求的优势,抓住一些长期投资的机会,在价值低估或者有折价机会的时候介入,将价值回归转化为投资收益,追求风险较低的投资回报。银行定期存款可以近似理解为定息产品,而三年期银行定期存款收益较符合本基金在封闭期的预期。因此,本基金采用三年期银行定期存款利率(税后)作为封闭期的业绩比较基准,与本基金在封闭期内追求的预期收益水平相符。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征,也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势,测算债券投资回报率水平,判断债券供求动向提供了很好的依据。

本基金转换为上市开放式基金(LOF),为满足流动性需求,无法运用一些长期的风险较小的投资策略,业绩比较基准沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,本基金可以变更业绩比较基准,经基金管理人与基金托管人协商一致,在履行适当程序后报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒体上及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

6、风险收益特征

本基金是一只混合型基金,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债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

7、基金的融资融券、转融通、基金投资基金

待基金参与证券投资基金投资、融资融券和转融通业务等的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与证券投资基金投资、融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与证券投资基金投资、融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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且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了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)投资固定收益品种的估值方法

1) 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。

2) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值,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) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券,按照成本估值。

4) 在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

5) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券,按中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种的当日估值净价估值。对未在银行间市场上市交易且中央国债登记结算有限责任公司未提供价格的,按成本估值。对在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也较难确认的,按成本估值。

6) 中小企业私募债采用估值技术确定的公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(4)投资证券衍生品的估值方法

1)从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值;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,将参考监管机构或行业协会有关规定,或者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)首次发行未上市的权证,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) 因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行估值。

4) 股指期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值,该日无交易的,以最近一日的结算价估值。

5)国债期货合约,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。

(5)存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(6)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。

(7)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《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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

(1)在本基金封闭期间:

本基金的《基金合同》生效后,在基金份额开始上市交易前,基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值;

在基金份额上市交易后,基金管理人应当通过基金管理人网站、上市的证券交易所、基金销售网点以及其他媒介,在每个交易日的次日披露基金份额净值、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(或自然日)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(或自然日)的次日,将基金资产净值、基金份额净值和份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(2)在本基金封闭期届满并转换为上市开放式基金(LOF)后:

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,通过基金管理人网站以及其他媒介,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(或自然日)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(或自然日)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报刊和网站上。

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生效后方可执行,基金管理人应在决议生效后2个工作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,《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)基金资产净值连续60个工作日低于5000万元;
(4)《基金合同》约定的其他情形;
(5)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)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;
2)《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;
3)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
4)对基金财产进行估值和变现;
5)制作清算报告;
6)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;
7)将清算报告报中国证监会备案并公告。
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。

(5)基金财产清算的期限为6个月。

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,应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为上海市,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,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》适用中华人民共和国法律并从其解释。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

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

上海东方证券资产管理有限公司
二〇一四年八月二十日