中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书

(上接B9版)

联系人:邓炯鹏
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
客服热线:95555
公司网站:www.cmbchina.com
8)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
联系人:张作伟
电话:021-58766688
传真:021-58798398
客户热线:95559
网址:www.bankcomm.com
9)中信银行股份有限公司
住所: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:常振明
联系人:赵树林
电话:010-65558000
传真:010-65550809
客服热线:95558
网址:bank.ecitic.com
10)广发银行股份有限公司
住所:广州市越秀区东风东路713号
办公地址:广州市越秀区东风东路713号
法定代表人:董建岳
联系人:李静筠
电话:020-38322888
传真:020-87310779
客服热线:400-830-8003
网址:www.gdb.com.cn
11)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址: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
电话:0755-82960223
传真:0755-82960141
客服热线:95565、4008888111
网址:www.newone.com.cn
12)国信证券股份有限公司
住所: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
法定代表人:何如
联系人:周杨
电话:0755-82130578
传真:0755-82130573
客服热线:4001099918
网址:www.cfsc.com.cn
13)广发证券股份有限公司
住所:广东省广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87550265
传真:020-87553600
网址:www.gf.com.cn
14)中信建投证券股份有限公司
住所: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:王常青
联系人:权唐
电话:010-85130588
传真:010-65182261
客服热线:4008888108
网址:www.csc108.com
15)国都证券有限责任公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:010-84183202
传真:010-64482090
客服热线:400-818-8118
网址:www.guodu.com
16)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:福建省福州市湖东路268号;上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20-22层
法定代表人:兰荣
联系人:夏中苏
电话:0591-38507869
传真:0591-38507538
客服热线:95562
网址:www.xyzq.com.cn
17)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
联系人:尹伶
电话:010-66045152
传真:010-66045518
客服热线:010-66045678
网址:www.txsec.com 、www.jjm.com.cn
18)光大证券股份有限公司
住所: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:薛峰
联系人:刘晨
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客服热线: 95525、4008888788、10108998
网址:www.ebscn.com
19)华福证券有限责任公司
住所:福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
办公地址:福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591-96326
传真:010-88085195、010-88085265-8191
客服热线:0591-96326
网址:www.hfzq.com.cn
20)中国银河证券股份有限公司
住所:中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
办公地址:中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
法定代表人:陈有安
联系人:田薇
电话:010-66568062
传真:010-66568704、010-66568532、010-66568640
客服热线:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn
21)齐鲁证券有限公司
住所: 济南市经七路86号
办公地址:济南市经七路86号23层
法定代表人: 李玮
联系人:王霖
电话:0531-68889118
传真:0531-68889093
客服热线:95538
网址:www.qlzq.com.cn
22)申万宏源证券有限公司
住所:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:储晓明
联系人:黄莹
电话:4008895523
传真:021-33388224
客服热线:95523
网址:www.swhysc.com
23)海通证券股份有限公司
住所:上海市广东路689号海通证券大厦
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
联系人:王立群
电话:021-23219000
传真:021-63410707、021-63410627
客服热线:95553
网址:www.htsec.com
24)国元证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券
法人代表:蔡咏
联系人:李飞
电话:0551-62207323
传真:021-38670767
客服热线:95578、4008888777
网址:www.gyzq.com.cn
25)平安证券有限责任公司
住所:广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
办公地址:广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
法定代表人:杨宇翔
联系人:郑舒丽
电话:0755-22622268
传真:0755-82400862
客服热线:95511-8
网址:www.stock.pingan.com
26)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海浦东新区商城路618号
办公地址:上海市银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
联系人:芮敏祺
电话:021-38676798
传真:021-38670798
客服热线:4008888666
网址:www.gtja.com
27)安信证券股份有限公司
住所:广东省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安联大厦
法定代表人:牛冠兴
联系人:张晨
电话:021-66581727
传真:010-66581721
客服热线:4008-001-001
网址:www.essences.com.cn
28)信达证券股份有限公司
住所: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:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63080985
传真:010-63081173
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
29)华泰证券股份有限公司
住所:江苏省南京市中山东路90号
办公地址: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:孔晓君
电话:0755-82943666
传真:025-84579938、025-84579778
客服热线:95597
网址:www.htsc.com.cn
30)德邦证券有限责任公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
联系人:刘然
电话:021-68761616-8259
传真:021-68761616
客服热线:400-8888-128
网址:www.tebon.com.cn
31)英大证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:广东省深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十、三十一层
法定代表人:吴骏
联系人:李欣
电话:0755-26982993
传真:0755-26998301
客服热线:4008-698-698
网址:www.ydsc.com.cn
32)中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:张于爱
电话:010-60836030
传真:0755-83025625
客服热线:95558
网址:www.citics.com
33)爱建证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:郭林
联系人:戴莉丽
电话:021-32229888
传真:010-60836221
客服热线:021-63340678
网址:www.ajzq.com
34)金元证券股份有限公司
住所:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人:陆涛
联系人:马贤清
电话:0755-83025500
传真:0755-83025625
客服热线:4008-888-228
网址: www.jyzq.cn
35)中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
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:杨宝林
联系人:吴忠超
电话:0532-85022313
传真:0532-85022301
客服热线:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn
36)中信证券(浙江)有限责任公司
住所:中国浙江省杭州市江南大道 588号 恒鑫大厦19、20楼
办公地址:中国浙江省杭州市江南大道 588号 恒鑫大厦19、20楼
法定代表人:沈强
联系人:李珊
电话:0571-96598
客服热线:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn
37)联讯证券有限责任公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人:徐刚
联系人:宋航
电话:0752-2119391
传真:0931-4890628
网址:www.lxzq.com.cn
38)华龙证券有限责任公司
住所:甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富大厦21楼
办公地址:甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富大厦21楼
法定代表人:李晓安
联系人:邓鹏怡
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
客服热线:0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618
网址:www.hlzqgs.com
39)国联证券股份有限公司
住所:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦7-9楼
法定代表人:雷建辉
联系人:沈刚
电话:0510-82588168
客服热线:95500
网址:www.glsc.com.cn
40)西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786433
传真:023-63786477
网址:www.swsc.com.cn
41)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号 A座3层
法定代表人:祝献忠
联系人: 黄恒
电话:010-58568235
传真:010-58568140
客服热线:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(42)民族证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
法人代表人:赵大建
联系人:李微
电话:400-889-5618
传真:010-66553216
客服热线:400-889-5618
网址:www.e5618.com
(43)东吴证券股份有限公司
住所:江苏省苏州工业园区星阳街5号
办公地址:江苏省苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
联系人: 方晓丹
电话:0512-62601555
传真:0512-62938812
客服热线:400-860-1555
网址:www.dwzq.com.cn
44)深圳众禄基金销售有限公司
住所: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
联系人:童彩平
电话:0755-33227953
传真:0755-82080798
客服热线:4006-788-887
众禄基金销售网:www.zlfund.cn
基金买卖网:www.jjmmw.com
45)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
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
联系人:张洋
电话:0571-28829790
传真:0571-26698533
客服热线:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
46)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:马良婷
电话:021-58788678
传真:021-58787698
客服热线:400-089-1289
网址:www.erichfund.com
47)上海天天基金销售有限公司
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人:其实
联系人:李广宇
电话:021-54509998-7019
传真:021-64385308
客服热线:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
48)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
联系人:薛年
电话:021-58870011
传真:021-68596916
客服热线:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
49)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
联系人:张姚杰
电话:021-38602377
传真:021-38509777
客服热线:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
50)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦25楼C区
法定代表人:王莉
联系人:吴卫东
电话:021-68419822
传真:021-68419822-8566
网址:licaike.hexun.com
51)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:翟飞飞
电话:010--62020088
传真:010—62020088--8802
网址:www.myfp.cn
52)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人:李晓涛
联系人:胡璇
电话:0571-88920810
传真:0571-86800423
客服热线:400-877-3772
网址:www.5ifund.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构,并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

2.场内发售机构

具有基金销售资格的、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)

(二)基金注册登记机构
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
联系人:朱立元
电话:010-59378839
传真:010-59378907

(三)出具法律意见书的律师事务所与经办律师
律师事务所名称:上海市通力律师事务所
住所: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:俞卫锋
经办律师:黎明、孙睿
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人: 俞伟敏
经办会计师:单峰 俞伟敏

六、基金的历史沿革

中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)由中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)通过转型变更而来。

中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)经中国证监会《关于核准中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2009]1192号)核准募集,基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)自2009年12月1日至2009年12月24日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2009年12月30日生效。

2015年1月30日中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》,同意将中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型为中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF),根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,将基金类别由股票型基金变更为混合型基金,同时将本基金的投资范围由主要投资中小盘股票变更为主要投资成长性行业的股票,并基于上述投资范围的变更,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的名称、投资及其他部分条款进行相应修改。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2015年1月30日起,《中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,原《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》自同日起失效,中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)正式转型为中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)。

七、基金的存续

(一)基金合同生效和基金份额的变更登记

本基金基金合同于2015年1月30日正式生效。

基金合同生效后,本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。

(二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

八、基金的上市交易

基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的基金份额名称、简称变更和复牌。本基金复牌后,投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额。

(一)上市交易的地点

深圳证券交易所。

(二)上市交易的时间

中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)已于2010年3月26日开始上市交易。转型后的中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)的基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的基金份额复牌。

(三)上市交易的规则

本基金的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

(四)上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定办理。

(五)上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

(六)上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

(七)相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,基金合同相应予以修改并按照新规定执行,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

(八)若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能,本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

九、基金份额的场外申购、转换与赎回

本章内容仅适用于本基金的场外申购和赎回业务。

(一)场外申购与赎回业务办理的场所

投资人可在以下场所办理基金申购与赎回等业务:

1、本基金管理人的直销网点。

2、不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或临时公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所,并予以公告。

(二)场外申购与赎回的开放日及办理时间

1、本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理,具体业务办理时间另行公告。基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的3个工作日前,在中国证监会指定的媒介上公告本基金开放申购、赎回的信息。

2、申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日(基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外)。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。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。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的,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。

3、基金合同生效后,若出现新的证券交易市场或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》的有关规定在中国证监会指定媒介上公告。

(三)场外申购与赎回的原则

1、"未知价"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、当日的场外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、场外赎回遵循"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介上公告。

(四)场外申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式:书面申请或销售机构公布的其他方式。

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,本基金注册登记机构在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,投资人应在T+2日后(包括该日)及时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。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。

3、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,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。

申购采用全额缴款方式,若申购资金在基金管理人和销售机构规定的时间内未全额到账则申购不成功,若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将把投资人已缴付的申购款项退还给投资人,该退回款项产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后,基金管理人在T+7 日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。

在发生巨额赎回的情形时,赎回的处理办法请参见本基金招募说明书的有关条款处理。

(五)场外申购和赎回基金份额的注册登记

投资人申购申请受理后,注册登记机构在T+1日为投资人办理增加权益的登记手续,投资人自T+2日起可赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金份额成功后,注册登记机构在T+1日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以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,但不得实质影响投资人的合法权益,并最迟于开始实施前3个工作日在中国证监会指定的媒介上公告。

(六)场外申购与赎回的限制

1、申购金额的限制

场外申购时,其他销售机构的销售网点每个账户单笔申购的最低金额为1000元人民币。

直销网点每个账户首次申购的最低金额为10000元人民币,追加申购单笔最低金额为10000元人民币;已在直销网点有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。

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。

2、赎回份额的限制

场外赎回时,赎回的最低份额为5份基金份额;基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于5份时,剩余基金份额将与该次赎回份额一起全部赎回。

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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(七)场外申购费用和赎回费用

1、申购费用

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

本基金申购费率如下:

单笔金额 (M)	收费标准
M<50万元	1.50%
50万元≤ M <100万元	1.00%
100万元≤ M <1000万元	0.50%
M≥1000万元	单笔1000元

2、赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担,赎回费的25%归基金财产,未归入基金财产的部分用于登记和其他必要的手续费。

本基金赎回费率如下:

持有基金份额期限 (N)	收费标准
N<1年	0.50%
1年≤ N <2年	0.25%
N≥2年	0

(注:此处1年按365天计算)

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介上公告。

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。

(八)场外申购份额与赎回金额的处理方式及计算

1、申购份额与赎回金额的处理方式:

(1)申购份额、余额的处理方式:场外申购时,申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以有效申请当日基金份额净值为基准计算,四舍五入保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担;

(2)赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以有效申请当日基金份额净值并扣除相应的费用,四舍五入保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2、本基金申购份额的计算:

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中:

申购费用适用比例费率的情形下:
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
申购费用适用固定金额的情形下:
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

例:某投资人投资4万元申购本基金,申购费率为1.5%,假设申购当日基金份额净值为1.040元,如果其选择前端收费方式,则其可得到的申购份额为:

申购金额=40000元
净申购金额=40000/(1+1.5%)=39408.87元
申购费用=40000-39408.87=591.13元
申购份额=(40000-591.13)/1.040=37893.14份

即:某投资人投资40,000元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.040元,则可得到37893.14份基金份额。

3、本基金赎回支付金额的计算:

本基金以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,

赎回总额=T日申请份额* 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

例:某投资人赎回1万份基金份额, 持有期限为10个月,对应的赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=10000×1.016=10160.00元
赎回费用 =10160.00×0.5%=50.80元
赎回金额 = 10160.00-50.8=10109.20元

即:投资人赎回本基金1万份基金份额,持有期限为10个月,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为10109.2元。

4、基金份额净值的计算公式为:

基金份额净值=计算日基金资产净值总额/计算日发行在外的基金份额总数。

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,由此产生的误差在基金财产中列支。

T 日的基金份额净值在当日收市后计算并在次日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(九)拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。此时,本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理:

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受投资人的申购申请。

3、证券/期货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些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,或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、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、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介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。当出现拒绝或暂停申购时,场内申购申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。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及处理方式

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。此时,本基金的转出申请将按同样方式处理:

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受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货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、出现继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,可暂停接受投资人的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时,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。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。当出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时,场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。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,对于场外赎回申请,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。

当出现巨额赎回时,场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。

(3)暂停赎回:连续2个开放日以上(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,并应当在指定媒介上进行公告。

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,同时在指定媒介上刊登公告。

(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介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为一日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布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一日但少于两周,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,在指定媒介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工作日的基金份额净值。

4、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,基金管理人应提前两个工作日,在指定媒介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工作日的基金份额净值。

(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)基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

(十五)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在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。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, 每期申购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。

(十六)基金份额的冻结和解冻

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。

(十七)、基金份额的折算

基金管理人有权根据市场情况对本基金进行份额折算,折算前后基金份额持有人持有的基金资产不变。基金管理人将在份额折算前3个工作日就折算方案、折算时间等内容进行相关公告。

十、基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。

(一)投资人范围

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者(法律、法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外)以及合格的境外机构投资者,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者。

(二)使用账户投资人通过深交所场内申购、赎回基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户(账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告)。

(三)场内申购和赎回的办理场所

具有基金销售业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位。

深交所场内申购赎回业务办理单位的名单(有可能进行调整或变更)可在深交所网站查询,本基金管理人将不就此事项进行公告。

(四)申购与赎回的办理时间

1、本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理,具体业务办理时间另行公告。基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的3个工作日前,在中国证监会指定的媒介上公告本基金开放申购、赎回的信息。

2、申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日(基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外)。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。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。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的,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。

3、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介上公告。

(五)场内申购和赎回的原则

1、"未知价"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、"全额缴款"原则,即投资人申购基金时,必须全额交付申购款项,只有在投资人全额交付申购款项后,申购申请方为有效;

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销。

5、本基金的场内申购、赎回等业务,按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则执行。

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介上公告。

(六)场内申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则,在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,否则所提交的申购申请无效。

投资人在提交赎回申请时,应确保账户内有足够基金份额余额,否则赎回申请无效。

2、申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构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),并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下,T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)及时到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以注册登记机构的确认结果为准。

3、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,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。

申购采用全额缴款方式,若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,申购款项将退回投资人账户,由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后,基金托管人按有关规定将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。

在发生巨额赎回的情况下,对于场内赎回部分,当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销。关于"巨额赎回的认定"和"巨额赎回的公告"参照第九章相关内容规定。

(七)场内申购和赎回的数额限制

1、单笔场内申购的最低金额为1,000元。

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。

2、赎回份额的限制

场内赎回时,基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,赎回份额必须是整数份额。

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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

4、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制,深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的,按其最新规定办理。

5、申购份额、余额的处理方式:本基金的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。基金份额份数采用截位法保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资人。

6、赎回金额的处理方式:本基金的赎回金额由赎回份额乘以申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元,赎回金额保留到小数点后两位,小数点后两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。

(八)申购费用和赎回费用

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

本基金申购费率如下:

单笔金额 (M)	收费标准
M<50万元	1.50%
50万元≤ M <100万元	1.00%
100万元≤ M <1000万元	0.50%
M≥1000万元	单笔1000元

2、投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由基金份额赎回人承担,赎回费的25%归基金财产,未归入基金财产的部分用于登记和其他必要的手续费。

场内赎回费率统一为0.5%。

3、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介上公告。

4、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。

(九)场内申购份额和赎回金额的计算方式

1、基金申购份额的计算

申购费用适用比例费率的情形下:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购手续费=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
申购费用适用固定金额的情形下:
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

场内申购份额采用截位法保留到整数位,计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例:某投资人通过场内投资10,000元申购本基金,对应的申购费率为1.5%,假设申购当日基金份额净值为1.025元,则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

净申购金额=10,000/(1+1.5%)=9,852.22元
申购手续费=10,000-9,852.22=147.78元
申购份额=9,852.22/1.025=9,611.92份

因场内申购份额采用截位法保留至整数份,故投资人申购所得份额为9,611份,整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为:

实际净申购金额=9,611*1.025=9,851.28 元
退款金额=10,000-9,851.28-147.78=0.94元

即:投资人投资10,000元从场内申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.025元,则其可得到基金份额9,611份,退款0.94元。

2、基金赎回金额的计算

赎回总金额=T日赎回份额*T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额*赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人从深交所场内赎回本基金10,000份基金份额,赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值为1.148元,则其可得净赎回金额为:

赎回总金额=10,000*1.148 =11,480.00元
赎回费用=11,480*0.5% =57.40元
净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60元

即:投资人从深交所场内赎回本基金10,000份基金份额,假设赎回当日基金份额净值为1.148元,则可得到的净赎回金额为11,422.60元。

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算,并在次日内公告。遇特殊情况,基金份额净值可以适当延迟计算或公告。

4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

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。

(十)场内申购和赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务,按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

(十一)办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,将按新规定执行,且无须召开基金份额持有人大会。

(十二)有关拒绝或暂停基金场内申购、赎回业务或延缓支付赎回款项的情形及处理方式参见本招募说明书第九章中关于"拒绝或暂停基金申购、赎回业务"的相关内容以及深交所有关规定,并据此执行。

十一、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

(一)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,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

(二)基金份额的登记

1、基金份额的登记业务

本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。

2、基金登记业务办理机构

本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的,应与代理人签订委托代理协议,以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务,保护基金份额持有人的合法权益。

3、基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利:

(1)取得登记费;

(2)建立和管理投资者基金账户;

(3)保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等;

(4)在法律法规允许的范围内,对登记业务的办理时间进行调整,并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告;

(5)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

4、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务:

(1)配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务;

(2)严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务;

(3)妥善保存登记数据,并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年;

(4)对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失,须承担相应的赔偿责任,但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外;

(5)按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务;

(6)接受基金管理人的监督;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三)系统内转托管

(1)系统内转托管是指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为。

(2)基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构(网点)时,需办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3)基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回的会员单位(交易单元)、或变更办理基金份额上市交易的会员单位(交易单元)时,需办理已持有基金份额的系统内转托管。

(四)跨系统转托管

(1)跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

(2)本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

十二、基金的投资

(一)投资目标

在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

(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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需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。

基金的投资组合比例为:

本基金股票投资占基金资产的比例为60% - 95%, 其中投资于成长性行业股票的比例不低于非现金基金资产 的80%,权证投资占基金资产净值的比例为0% - 3%,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%。

(三)投资策略

1、资产配置策略

本基金将通过分析宏观经济趋势,政府政策行为和资金供需关系三个影响资本市场的主要因素,在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控,确定相应大类资产配置比例。

(1)宏观面

从股市与宏观经济的内在作用机理来看,宏观经济决定着股市波动,引起股市上涨的原动力是一国经济的发展,当经济向好时,企业业绩上升,投资股票收益高,资金大量涌入股市,股价持续上升;反之,经济衰退,企业不景气,投资缩减,股价下跌。另一方面,股价会充分反映宏观经济变动的各种信息,当实际公布的经济数据和市场预测相背离时,股市会随之做出相应的修正。鉴于以上内在作用机理的存在,本基金资产配置主要建立在对未来宏观经济走势的预期以及预期和实际偏离的修正上。

(2)政策面

国家政策对股市有直接的影响,是影响股市走势的主要因素之一,本基金将主要通过分析政府的财政政策、货币政策和其他政策三个方面来判断政策对股市的影响:

国家财政通过税收总量和结构的变化,调节证券投资和实际投资规模,抑制社会投资总需求膨胀或者补偿有效投资需求的不足。当政府实行积极的财政政策,并且财政政策落到实处时,有利于股市。

政府通过灵活运用利率、存款准备金率和公开市场操作等政策工具,调节市场资金供求,宽松的货币政策会扩大社会上货币供给总量,对经济发展和证券市场交易有着积极影响。

其他政策(如印花税调整等)会通过影响投资者的股权风险溢价(ERP),从而显著影响估值水平。

(3)资金面

最终决定股市价格水平的因素来源于市场的供需关系,本基金通过分析市场的货币供应量和股票供给量来分析市场的供需关系:当资金充沛,需求大于供给时,股市上升;当供给大于需求时,股市下跌。

2、行业配置策略

(1)本基金的行业配置特点

本基金的主要特点是对于成长性行业的重点配置。在本基金的投资标的中,成长性行业主要包括以下两种类型:一是从行业的生命周期来看,处于快速成长期和成熟成长期的行业,处于这两个阶段的行业增长率快速提高,企业利润水平超出市场平均水平,获得超额收益率的可能性很高;二是短期内处于复苏景气阶段的行业,部分行业虽然从长期来看并未进入成长阶段,但仍存在阶段性景气复苏的可能性,这往往是由于经济周期波动、供求关系变化等因素造成,从较长时间来看,投资于此类行业的收益率水平往往趋于市场平均值,但若能够准确预计行业的阶段性复苏,则有可能抓住行业阶段性成长的机会。

(2)成长性行业的选择标准

基金管理人将在申银万国一级行业的分类标准基础上,采取定性和定量的指标综合判断行业的成长性。筛选出的成长性行业将每六个月进行更新。

定量标准:

判断一个行业是否具有成长性,其核心是未来获得收入与盈利的能力。为了方便反映行业成长性,基金管理人将对行业的平均主营业务收入增长率、主营业务利润增长率及净利润增长率等成长性指标进行测算,并对测算结果分别进行排序。对于该三项指标中至少有一项增长率超越市场平均水平的行业,将进入本基金管理人重点研究的范围 。

定性标准:

对行业基本面的深入分析也是判断成长性行业的重要途径。从行业自身来看,行业的成长性将受到行业发展阶段、行业景气程度、行业竞争状况、政策扶持程度、所处产业链地位、是否具有垄断性等多个定性指标的影响。基金管理人将在对各行业基本面进行分析的过程中,针对各行业的特殊性重点考察对其成长性影响较大的因素。在对行业的上述六个因素深入分析的基础上,基金管理人将分别就每个因素对该行业的影响做出"有利"或"不利"的判断。

综合判断:

在对各行业的定量指标进行排序的基础上,并结合对影响各行业的定性因素做出的"有利"或"不利"的判断,基金管理人将对各行业的成长性进行综合性评分并排序。对于排名处于前80%的行业,将作为成长性行业进入本基金重点研究和投资的范围。

3、个股选择策略

本基金将重点选择成长性行业内基本面优良且具有成长潜力的股票进行最终的投资组合构建。

本基金将重点分析各成长性行业上市公司的成长性指标(市盈增长比率(PEG)、近三年平均主营业务收入增长率、近三年平均息税折旧前利润(EBITA)增长率、未来一年预测每股收益(EPS)增长率等)、价值指标(市盈率(P/E)、市净率(P/B)、每股收益(EPS)、股息率等)、盈利指标(近三年平均净资产收益率(ROE)、近三年平均投资资本回报率(ROIC)等)等,筛选出基本面良好、成长潜力较大的股票进行投资。

4、债券选择策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。

(1)久期偏离

本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析,预测利率的变化趋势,从而采取久期偏离策略,根据对利率水平的预期调整组合久期。

(2)期限结构配置

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

(3)类属配置

类属配置指债券组合中各债券种类间的配置,包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布,债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

(4)个券选择

个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素,确定一定期限下的债券品种的过程。

5、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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的交易成本。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构,将信贷资产信托给受托机构,由受托机构向投资机构发行,以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。

7、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上,本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判,估算权证合理价值,同时还充分考虑个券的流动性,谨慎进行投资。

(四)投资决策

1.投资决策依据

投资决策依据包括:国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定;宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势;证券市场走势。

2.投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

3.投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资事业部负责人、基金经理、研究部和中央交易室,投资过程须接受监察稽核部的监督和基金运营部的技术支持。

其中,投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构,对基金投资的重大问题进行决策,并在必要时做出修改。

投资事业部负责人负责事业部内投资管理和内外部沟通工作,并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理根据投资决策委员会的原则和决议精神,结合股票池及有关研究报告,负责投资组合的构建和日常管理,向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

4.投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限,建立完善的投资决策体系和投资运作流程:

(1)投资决策委员会会议:由投资决策委员会主席主持,对基金总体投资政策、业绩表现和风险状况、基金投资授权方案等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

(2)在借助外部研究成果的基础上,研究部同时进行独立的内部研究。

(3)基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议,在研究部的研究支持下,拟定投资计划,并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中,基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

(4)中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令,并担负一线风险监控职责。

5.风险分析与绩效评估

研究部负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面,对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略,进而调整投资组合。

6.组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化,结合基金当期的申购和赎回现金流量情况,以及组合风险与绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整。

(五)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%。

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,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示,而无需召开基金份额持有人大会。

(六)风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益风险水平的投资品种。

(七)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票投资占基金资产的比例为60% - 95%;其中投资于成长性行业股票的比例不低于非现金基金资产的80%;

(2)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%;

(3)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%;

(4)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%;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(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%;

(11)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;

(12)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;

(13)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;

(14)本基金参与股指期货交易,需遵守下列投资比例限制:

1)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%;

2)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%;

3)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95%;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;

4)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,即为基金资产的60-95%;

5)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%;

(15)本基金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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

(16)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(17)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,但中国证监会规定的特殊情形除外。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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,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或按照调整后的规定执行。

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,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

(八)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、有利于基金财产的安全与增值;

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。

十三、基金的财产

(一)基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

(二)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。

(三)基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四)基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处分。

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财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权,不得与其固有资产产生的债务相互抵销;基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十四、基金资产的估值

(一)估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的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。

(二)估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(三)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、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。

4、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。

5、股指期货合约的估值方法

(1)评估股指期货合约价值时,应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值。

(2) 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。

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。

(四)估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第4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,并按规定公告。

(下转B11版)