关于以通讯方式重新召开东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

东方基金管理有限责任公司(以下简称“本基金管理人”)旗下东方央视财经50指数增强型证券投资基金(以下简称“东方央视50”或“本基金”)于2015年7月8日至2015年7月20日以通讯方式召开了东方央视50基金份额持有人大会,并在基金份额持有人大会上审议本基金转型为“东方启明量化先锋混合型证券投资基金”的有关事项。由于出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额未达到权益登记日基金总份额的50%,故该次基金份额持有人大会未能成功召集。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》和《东方央视财经50指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,本基金管理人决定以通讯方式重新召开本基金的基金份额持有人大会。会议的具体安排如下:

1.会议召开方式:通讯方式。

2.会议投票表决起止时间:自2015年10月22日起,至2015年11月30日17:00止(以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准)。

3.会议通讯表决票的寄达地点:

公证机关:北京市方正公证处

办公地址:北京市西城区西环广场塔3办公楼11层1113室

收件人:王顺心

电话:(010)58073628

邮政编码:100044

二、会议审议事项

《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》(详见附件一)。

上述议案的内容说明见《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的说明》(详见附件四)。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2015年10月21日,即2015年10月21日下午交易时间结束后,在本基金登记机构登记在册的基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。纸质表决票的填写和寄交方式如下:

1.本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站(www.orient-fund.com)下载并打印表决票。

2.基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件复印件;

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(或基金管理人认可的相关的业务专用章,下同),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的有效身份证件复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2015年10月22日起,至2015年11月30日17:00以前(以基金管理人委托的公证机关收到表决票的时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本次基金份额持有人大会公证机关的办公地址,并请在信封表面注明:“东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4.投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-628-5888(免长途话费)咨询。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会,使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志,基金份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》的约定,基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则:

1.委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书,待申购申请确认后,授权委托书自动有效。

基金份额持有人(含新申购投资者,下同)授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算,一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的,授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以东方基金管理有限责任公司的登记为准。

2.受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3.授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载(http://www.orient-fund.com)等方式获取授权委托书样本。

(1)基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件:

个人基金份额持有人委托他人投票的,代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本),并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证明文件复印件;如代理人为机构,还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

机构基金份额持有人委托他人投票的,代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本),并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证明文件复印件;如代理人为机构,还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

(2)对基金管理人的纸面授权文件的送达基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人进行授权的,可通过邮寄授权文件或在基金管理人柜台办理授权事宜。基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人办公地点。

4.授权效力确定规则

(1)如果同一基金份额存在多次有效纸面方式授权的,以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的,如最后时间收到的授权委托有多次,以表示具体表决意见的纸面授权为准;

(2)如果同一基金份额在委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的,视为委托人授权代理人按照代理人意志行使表决权;

(3)基金份额以非纸面方式进行授权的,为无效授权;

(4)如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权;

(5)如委托人既进行委托授权,又送达了有效表决票,则以有效表决票为准。

5.对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2015年11月30日16:00。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人的指定地址的,授权时间以收到时间为准。

六、计票

1. 本次通讯会议的计票方式为:由本基金管理人授权的两名监票人在基金托管人(中国农业银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证并形成决议。

2.基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3.表决票效力的认定如下:

(1)表决票填写完整清晰,所提供文件符合本会议通知规定,且在截止时间之前送达指定联系地址的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2)如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按“弃权”计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3)如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达指定联系地址的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4)基金份额持有人重复提交表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

1)送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

2)送达时间为同一天的,计入弃权表决票;

3)送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以基金管理人委托的公证机关收到的时间为准。

七、决议生效条件

1.本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%);

2、本次议案如经参加会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;

3.本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起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持有人大会表决通过之日起生效,本基金管理人将在本次基金份额持有人大会表决结果的公告中约定东方央视50实施转型的具体时间。

八、重新召集基金份额持有人大会及重新授权

根据《基金法》及《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》的规定,本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%)方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,根据2013年6月1日生效的《基金法》,本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

九、本次大会相关机构

1、召集人(基金管理人):东方基金管理有限责任公司

2、基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3、公证机关:北京市方正公证处

4、见证律师:上海市通力律师事务所

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站(www.orient-fund.com)查阅,投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-628-5888(免长途话费)咨询。

3.本公告的有关内容由东方基金管理有限责任公司负责解释。

附件一:《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二:《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三:《授权委托书》

附件四:《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的说明》

东方基金管理有限责任公司
2015年10月16日

附件一

《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》

东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人:

根据市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》和《东方央视财经50指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金管理人提议对东方央视财经50指数增强型证券投资基金进行转型。具体调整安排可参见附件四《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的说明》。

以上议案,请予审议。

东方基金管理有限责任公司
2015年10月16日

附件二

《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决票			
基金份额持有人 姓名或名称			
证件号码(身份证件号或营业执照号)			
基金账户			
审议事项	《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》		
表决意见	同意	反对	弃权
基金份额持有人/代理人签名或盖章 年 月 日			

说明:请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见,基金份额持有人必须且只能选择一种表决意见,表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见,表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的(且其他各项符合会议通知规定)的表决票均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”,签字/盖章部分不完整、不清晰的,将视为无效表决。

同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写基金账户号,其他情况可不必填写,此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

附件三

授权委托书

兹授权_____代表本人(或本机构)参加投票截止日为2015年11月30日的以通讯方式重新召开的东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使对所有议案的表决权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):_____

委托人身份证件号或营业执照号:_____

委托人基金账户:_____

代理人(签字/盖章):_____

代理人身份证件号或营业执照号:_____

委托日期:_____年____月____日

授权委托书填写注意事项:

1.授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制,在填写完整并签字盖章后均为有效;

2.委托人为机构的应当于名称后加盖公章,个人则为本人签字;

3.同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写基金账户号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,以上授权将被视为是持有人就其持有的本基金全部份额向代理人所做授权;

4.如本次持有人大会权益登记日,投资者未持有本基金的基金份额,则其授权无效。

附件四

《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金转型有关事项的说明》

东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金份额持有人:

截至2014年11月中旬,东方央视财经50指数增强型证券投资基金(以下简称“东方央视财经50指数基金”)基金规模已出现连续60个工作日低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益,更好的为基金份额持有人服务,东方基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定和《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》约定,经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,提议对东方央视财经50指数基金实施转型。

为实施东方央视财经50指数基金转型方案,提议授权基金管理人办理本次东方央视财经50指数基金转型的有关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定各项基金转型工作的具体时间和方式,并可以根据现时有效的法律法规的要求、本议案和转型后开放式基金的特征,或在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

转型方案说明如下:

一、更改基金名称及投资类型

(一)转型后基金名称

东方启明量化先锋混合型证券投资基金(以下简称“东方启明量化先锋基金”)

(二)转型后基金类型

混合型证券投资基金

二、更改基金的投资目标、投资范围和投资策略等

根据东方央视财经50指数基金转型后的基金投资类型和相关法律法规对投资范围及比例的规定,东方启明量化先锋基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准等条款拟调整如下:

(一)投资目标

东方央视财经50指数基金的投资目标为:

本基金为股票型指数增强基金,在对央视财经50指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值,分享中国经济的持续、稳定增长的成果。

基金转型后,东方启明量化先锋基金的投资目标为:

在严格控制投资风险的前提下,通过量化选股策略,结合类别资产的配置,力争获得基金的长期稳定增值。

说明:根据基金转型后的投资类型及投资策略重新制定投资目标。基金投资目标不再为超越跟踪指数,故修改。

(二)投资范围

东方央视财经50指数基金的投资范围为:

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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中央视财经50指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的80%,货币市场工具、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产比例为5%-10%,其中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%,投资的权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。

基金转型后,东方启明量化先锋基金的投资范围为:

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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中小企业私募债)、货币市场工具、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,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:股票资产占基金资产的比例为30%-95%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行;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的投资比例不低于基金资产净值的5%。

说明:适当拓宽投资范围,将中小企业私募债和股指期货纳入投资范围。基金管理人在投资于上述投资标的时,会依照法律法规的规定对投资情况进行披露。

(三)投资策略

基金转型后,投资策略不再以指数增强策略为主,东方启明量化先锋基金的投资策略为:

本基金基金资产的30%-95%可投资于股票,在符合法律法规的规定和基金合同约定的前提下,本基金通过量化选股策略筛选股票,结合类别资产的配置力争实现分散组合投资风险、提高投资收益的目标。

1、类别资产配置策略

本基金结合各类经济数据对我国宏观经济运行、资本市场运行情况等进行分析,结合国家政策走向、国内外经济环境变化等因素对各类资产的当期、中短期和中长期风险收益水平形成判断,在符合相关投资比例限制的前提下,进行类别资产的配置和动态调整。

2、股票投资策略

股票投资分为量化选股和量化择时。

量化选股是通过数量化的方法,分析股票交易数据、财务数据、分析师预测评级及宏观数据等,来建立各种股票预测模型,以战胜市场和获得稳定的绝对收益为根本目标。量化选股的策略包括但不限于:多因子策略、事件驱动策略、套利策略等。为了获得稳定、低风险的收益,本产品采用多个策略,从而在风格转换的行情下,规避单一策略的回撤风险。

量化择时是根据技术指标、宏观经济指标等,来判断未来股市整体走势,并根据判断结果,对股票仓位进行增减。在股票市场上涨期间高配股票,低配债券和货币,获得股票市场贝塔收益;在股票市场下跌期间低配股票,高配债券,规避市场风险。

3、债券投资策略

本基金通过动态调整债券的投资比例,在一定程度上规避股票市场的投资风险,获得相对稳定的投资收益。结合市场利率趋势及信用环境变化情况等,综合判断各类券种的风险收益水平,构造债券的投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期调整策略、收益率曲线策略、类属券种配置策略、期限结构策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。

4、中小企业私募债券投资策略

在控制信用风险的基础上,本基金对中小企业私募债投资,主要通过期限和品种的分散投资控制流动性风险。以买入持有到期为主要策略,审慎投资。

针对内嵌转股选择权的中小企业私募债,本基金通过深入的基本面分析及定性定量研究,自下而上精选个债,在控制风险的前提下,谋求内嵌转股权潜在的增强收益。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制订严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型,深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化,寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,谨慎投资,追求较稳定的当期收益。

6、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

7、股指期货投资策略

本基金进行股指期货的投资以套期保值为主要目的,本基金投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过对股票市场和股指期货市场短期和中长期趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

(四)投资限制

根据现行法律法规的规定和转型后基金的投资范围等设置,投资限制调整为:

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30%—95%;

(2)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,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)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)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%;

(5)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%;

(6)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%;

(7) 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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11) 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%;

(12)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;

(13)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;

(14)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;

(15)本基金参与股指期货交易后,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;

③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本基金持有的股票总市值的20%;

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,即占基金资产的30%-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%;

(16)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%;

(17)本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(18)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;

(19)本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。

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,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本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。

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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

(五)业绩比较基准

根据基金转型情况调整业绩比较基准为:

沪深300指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%

三、调整转型后基金申购和赎回的数量限制

根据相关法律法规的规定,基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额及每次赎回的最低份额。为提高转型后投资于东方启明量化先锋基金的灵活度,更好地为基金投资人服务,申购赎回的数量限制调整为:

投资者每次最低申购金额由1000.00元降为1.00元(含申购费),每次定期定额最低申购金额由100.00元降为1.00元,具体办理要求以销售机构的交易细则为准,但不得低于基金管理人规定的最低限额。

基金份额持有人在销售机构赎回时,每次赎回申请最低基金份额由100.00份降为1.00份。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足1.00份的,在赎回时需一次全部赎回。

四、转型后基金的费率结构

(一)东方央视财经50指数基金转型为东方启明量化先锋基金后,基金管理费率保持不变。

	东方央视财经50基金	东方启明量化先锋基金
管理费率	1.00%/年	

东方启明量化先锋基金的管理费每日按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提,基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

(二)东方央视财经50指数基金转型为东方启明量化先锋基金后,基金托管费率上调。

	东方央视财经50基金	东方启明量化先锋基金
托管费率	0.20%/年	0.25%/年

东方启明量化先锋基金的托管费每日按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提,基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

参考目前同类型基金的托管费率水平,东方启明量化先锋基金托管费率上调至0.25%/年。

(三)东方央视财经50指数基金转型为东方启明量化先锋基金后,基金的申购费率和赎回费率在符合相关法律法规规定的前提下调整。

原申购费率为:

申购金额(M,含申购费)	申购费率
0万≤M<100万	1.20%
100万≤M<500万	0.80%
M≥500万	每笔1000元

申购费率调整如下:

申购金额(M,含申购费)	费率
M<50万	1.50%
50万≤M<500万	1.00%
500万≤M<1000万	0.50%
M≥1000万	1000元/笔

原赎回费率为:

持有期限(N)	赎回费率
0≤N<365天	0.50%
365天≤N<730天	0.25%
N≥730天	0

赎回费率调整如下:

持有期限(T)	赎回费率	计入基金财产比例
T<7天	1.50%	100%
7天≤T<30天	0.75%	100%
30天≤T<6个月	0.50%	75%
6个月≤T<1年	0.20%	50%
1年≤T<2年	0.15%	25%
T≥2年	0	0%

(四)东方央视财经50指数基金转型为东方启明量化先锋基金后,原东方央视财经50指数基金基金份额持有人的持续持有期限自认购或申购东方央视财经50指数基金确认之日计算。

举例:若原东方央视财经50指数基金基金份额持有人自认购东方央视财经50指数基金(成立日为2012年12月19日)始持续持有至东方央视财经50指数基金转型为东方启明量化先锋基金,则若持续持有期限不满2年,赎回费率为0.15%(原赎回费率为0.25%);持续持有期大于2年,赎回费率为0。

五、转型后基金的收益分配原则

根据现行法律法规的规定,东方央视财经50指数基金转型为东方启明量化先锋基金后,基金收益分配原则拟调整为:

1、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;选择采取红利再投资形式的,分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额,红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即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;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红,分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

六、基金合同的其他修订内容

除上述内容的调整需要修改基金合同以外,考虑到自《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》生效以来,《基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布、实施和修订,基金管理人需要根据法律法规的最新要求编写《东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金合同》,并根据基金合同编写相关文件的相关内容。

综上所述,基金管理人按照法律法规的规定、东方央视财经50指数增强型基金的转型方案编写《东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金合同》的内容,并依据基金合同内容编写相关文件。编写后的基金合同已经基金管理人和基金托管人签字盖章,并经中国证监会变更注册。

七、基金管理人就方案相关事项的说明

(一)基金东方央视财经50指数增强型的历史沿革

东方央视财经50指数增强型基金依据《中华人民共和国合同法》、《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规和《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》等,经中国证监会于2012年10月10日发布证监许可[2012]1344号文核准募集,东方央视财经50指数增强型基金于2012年12月19日募集成立,成立规模5.46亿元,存续期为不定期。

东方央视财经50指数增强型基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

(二)基金转型运作有利于保护基金份额持有人利益

东方央视财经50指数增强型证券投资基金已出现基金规模持续60个工作日低于5000万元的情形,根据现行法律法规的规定,应将此情形上报中国证监会,就基金是否持续运作、转型等形成方案。基金管理人从保护基金份额持有人利益的角度出发,经过充分论证各备选方案的可行性及对基金份额持有人利益的影响等,认为如果进行清算,基金份额持有人不仅要承担股票资产变现的冲击成本,还要承担清算费用以及清算期间的机会成本。实施基金转型运作可避免相关成本,有利于更好的保护基金份额持有人利益。

(三)基金转型的可行性

1.基金转型不存在法律障碍

依据《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》和《基金法》的规定,东方央视财经50指数增强型基金转型涉及的变更基金类型、修改与基金投资相关的条款、基金的收益分配等应当经参加持有人大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的50%以上通过。按照基金份额持有人大会的决议,基金可以变更基金类别,并修改基金合同的相关内容,大会决议自表决通过之日起生效,并经中国证监会备案。

因此,东方央视财经50基金转型为东方启明量化先锋基金不存在法律障碍。

2.基金转型不存在技术障碍

东方央视财经50指数增强型基金和拟转型后的东方启明量化先锋基金均为契约型开放式基金。转型后,基金的投资比例限制等可逐步调整至符合东方启明量化先锋基金的投资比例要求。

因此,东方央视财经50指数增强型基金转型为东方启明量化先锋基金不存在技术障碍。

3.调整投资目标、投资范围和投资策略的可行性

东方央视财经50指数增强型基金转型之后,必须对原有基金合同中的有关内容进行修订,使其在投资目标、投资范围、比例限制等方面符合法律法规的规定。

4.调整费率结构的可行性

东方央视财经50指数增强型基金转型为混合型基金后,需根据最新法律法规的相关规定和基金自身属性对原有的基金费率进行修订,使其更符合现行法律法规的规定。

八、基金转型的主要风险及预备措施

(一)转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前,我公司已对基金份额持有人进行了走访,认真听取了相关意见,拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后,我公司还将再次征询基金份额持有人的意见。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人的意见,对《基金合同》修改方案进行适当的修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,预留出足够的时间,以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本修改方案未获得基金份额持有人大会批准,基金管理人将按照《基金法》和《基金合同》的有关规定,重新向基金份额持有人大会提交《基金合同》修改方案议案。

(二)基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

本基金《基金合同》修改前后,为保护基金份额持有人利益,回避修改《基金合同》期间的运作风险,拟采取如下措施:

1.资产投资比例按照《基金合同》规定的前提下,保持充足的流动性应对可能发生的大规模赎回情况。

2.持有流动性好、波动性较小的资产,以降低由于修改《基金合同》而可能带来的市场申购或赎回压力。

东方基金管理有限责任公司
2015年10月16日

富安达基金管理有限公司关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持,经与上海好买基金销售有限公司(以下简称好买基金“好买基金”)协商一致,富安达基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定旗下基金参加好买基金的费率优惠活动。现将具体费率优惠情况公告如下:

一、费率优惠活动

1、费率优惠内容

自2015年10月19日起,投资者通过好买基金申(认)购本公司旗下基金,申(认)购费率不设折扣限制,具体折扣费率以好买基金活动为准。基金费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限内,如本公司新增通过好买基金代销的基金产品,则自该基金产品开放申(认)购当日起,将同时开通该基金上述优惠活动。

2、费率优惠期限

以好买基金官方网站所示公告为准。

二、重要提示

1、本优惠活动仅适用于我司产品在好买基金处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费及处于基金募集期的基金认购费。

2、本优惠活动仅适用于我司产品在好买基金申(认)购业务的手续费,不包括基金赎回、转换业务等其他业务的手续费。

3、费率优惠活动