Disclosure 信息技術 2015年11月25日 星期三 zqsb@stcn.com (0755)83501750

(上接B13版)

(上接B13版)
(六)上述人员之间不存在近亲属关系。
三、基金管理人的职责
1、依法募集资金,办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2、办理基金备条手续;
3.自《基金合同》上数之日起、以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度、保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立、对所管理的不用基金分别管理、分别记账、进方证券投资;
6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益、不得委托第三人运作基金财产。

益、不得委托第三人运作基金财产;
7、依法接受基金托管人的监督;
8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购,申购,赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产单值,确定基金份额申购,赎回的价格;
9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
10.编制季度,半年度和年度基金报告;
11.严格按照(基金法)《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
12、保守基金商业秘密、不泄露基金投资计划,投资管向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密、不向他人泄露;
13、按(基金合同》的为定确定基金收益分配方案。及时向基金份额持有人分配基金收益;
14、按规定受理申申与规则申请。及时,是额支付规则款项。
15、依据(基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份等持有人大会。
16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册,报表、记录和其他相关资料15年以上;
17、确保需要的基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金介等分的公开资料,并在文付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

27、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。 四、基金管理人的承诺

、本基金管理人承诺严格遵守法律法规和基金合同,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全

金财产用于"两股贷款活动;
(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社管人出资;
(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;
(6) 法律法规和中国证监会及基金合同禁止的其他活动。?
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其他重大担资资。通信基金份取转有人利益优先的原则、防范利益必要、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。重大关联交易应据交基金管理人董事会市议,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应据交基金管理人董事会市议,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应据交基金管理人董事会市议,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更加近任审查。

对关联交易率则进行审查。
注律,行致法规或监管机构取消上述限制,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。?

4. 基金管理人不诺严格遵守法律法规,禁止发生下列行为;
(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对持其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)侵占,挪用基金财产。
(6)泄露因职务便和联取的未公开信息,利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;
(8)法律法规,中国正监会及基金合同禁止的其他行为。
5. 基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下行为;
(1)越权或违规经营;
(2)违反《基金合同》或《托管协议》;
(3)故意遗报各基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;
(4)在向中国证监会投送的资料中弄虚作假;
(5)拒绝,干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6)玩忽职守,滥用解以,不按照规定履行职责;
(7)泄漏在任职期间知悉的有关证券,基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者相示,能示他人从事相关的交易活动;
(6)远驱导产。通用解以,不按照规定履行职责;
(7)泄漏在任职期间知悉的有关证券,基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息,使事或者相示,能示他人从事相关的交易活动;
(6)违位罪守之易场所业务规则,利用对愈、倒仓等干段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(9)在公开信息披露和广告中故愈含有虚假、误导、城下成分;
(10)其他法律法规,中国证监会及基金合同赞业的行为。
6. 基金经理承诺 对关联交易事项进行审查。 法律、行政法规或监管机构取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金

(10)其他法律法规、甲国业监会及基金台同禁止的行为。 6.基金经理承诺 (1)依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益; (2)不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益; (3)不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息、或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。 (4)不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。 五、基金管理人的内部控制制度 1.内部控制目标

、内部控制目标 (1)保证基金管理人的经营运作严格遵守法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的

(1) 除此基立百 理八中交員是12/1日及 12/1日 12/1日

(1)健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级岗位,并渗透到决策、执

其他财产的运作必须相互分离。 (4)相互邮约原则。基金管理人内部部厂和岗位的设置须权责分明,相互制衡。 (5)成本效益原则。基金管理人互用科学化的经管管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控

制放本达到版注的内部控制依条。
3.内密控制体系结构是一个分工明确,相互制约的组织结构,具体包括:
(1)董事会负责决定基金管理人内部管理机炮的设置制定基金管理人基本管理制度,对确保基金管理人建立及维持适当而有效的内部控制负有最终责任。董事会下设的风险控制和审计委员会负责审核基金管理人建立及维持适当而有效的内部控制负有最终责任。董事会下设的风险控制和审计委员会负责审核基金管理人内部控制制度,检查公司标基金运作的合法合规情况等事项,并向董事会汇报。
(2)经营管理局负责组织设计公司的内部控制制度,拟订公司的基本管理制度和制定公司的部门业务规章,并确保公司的日常经营运作活动合法合规。
(3)督察长负责监督检查基金管理人运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况,并依据相关规定可独立向董事会和中国证监会报告。
(4)经营管理层下设的风险管理委员会协助经营管理层实施对各类业务和风险的总体控制以及解决公司内部控制中出现的问题。
(5)风险管理部负责跟踪和报告投资管理中的市场风险,评价基金投资业绩,并根据风险收益情况及时提出改进意见,为投资业务的稳健处度提倡交对。
(6)监察稽核部独立于基金管理人其他部门和业务活动,对基金管理人内部控制制度、风险管理政策和措施的执行情况实行严格检查和及时反馈,并向督察长、风险管理委员会和经营管理层定期或不定期报告告责。

口。 (7)各业务部门及员工对风险管理负有直接责任。各业务部门负责人在权限范围内,执行公司的各项风险管理程序,负责本部门业务风险的识别、监控,对本部门的风险管理负全部责任。每一位员工均负有一线风险控制职责,负责把公司的风险管理理念和控制措施落实到每一个业务环节当中,并在发现风险隐患 和问题时负有报告、反馈和改进的义务。

(1)建立合理、完备、有效并易于执行的内部控制制度体系。基金管理人内部控制制度体系由不同层面 (1) 理以管理、元命、有效共务丁內(1的內部從制制限條系。基金管理人內部從制制股係系由不同已局的制度构成、按照其所管理的层次可以分为四个级别、第一级别是公司舍起、第二级别是公司内部控制大纲、第二级别是公司内部控制,等一级别是公司会是、全部门根据业务需要制定的各种制度及实施细测等。基金管理人根据业务需要持续修订和更新各项制度、使其内部控制制度体系日趋完善(2)建立浓厚的风险管理文化。经营管理层生固树立内控优先的风险管理途。注重培养全体员工的风险防范意识、通过制度约束。学习培训使全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度,使风险管理意识深人人心,并贯穿到各个业务环节。(3)建立严密有效的内控防线。依据自身经营特点、基金管理人建立起各岗位的自控与互控、相关部门之间的监督制衡、监察榜核部和智察长的独立监督等内控防线。(4)建立,对持续完善风险管理体系。基金管理人通过建立风险分类、识别、评估、报告及监督等程序、定期或不定期地对风险进行评估、预警,并通过清晰的汇报路径,使相关部门及经营管理层即时把握风险状况、及时、快速地采取风险控制措施。(5)强化风险管理措施、随着业务发展及技术进步、基金管理人开始更多地采取系统化监控措施,增强风险管理的全面性、实时性和有效性。同时、采用数量化分析方法、提高风险管理的科学性。5、基金管理人关于内部控制制度的声明(1)本基金管理人所充控制制度的,其实处于使强度的责任;(2)本基金管理人所充控制制度的,其实处于使用。

第四部分 基金托管人

- 、基金托管人基本情况

(一)基金托管人概况 公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行) 公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

所: 上海市浦东新区银城中路188号 九公地址,上海市浦东新区银城中路1885

办公地址:上海巾浦东朝区银城中路188号邮览编局;200120 注册时间:1987年3月30日 注册时前:1987年3月30日 注册资本:742.62亿元 基金托管资格社文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号 联系人:汤嵩彦

取亦八·勿高厚 电 话·95559 交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。1987年重新组建后 的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2006年6月,交通 银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2014年(银行家)杂志发布 的全球千家大银行银告,交通银行一级资本位刘第19位,跻身全球银行20强,根据《财富》杂志发布的"世界 500强公司"排行榜,交通银行位刘第217位。2014年实获《首席财务官》杂志评选的"最佳资产社管奖"。 截至2015年9月30日,交通银行资产总额达到人民币7.21万亿元。实现净利润人民币520.40亿元。 交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称"托管中心")。现有员工具有多年基金、证券和银行的 从业经验、具备基金从业资格。以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层处 校宫 专业小布合理 职业技能任息 即以首使素据行题,是一专党经验勤龄。招展进事,开充创建。全身自 较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

放弃于于以、1977年平亚」「哈小祿上亚人子曾珠子的双人之价专业、於明工子证、1997年享全国为吃则及的政府特殊津贴。 彭宪生2013年11月起任本行剧董事长、执行董事、行长。 彭宪生2013年11月起任本行司董事长、执行董事、2013年10月起任本行行长、2010年4月至2013年9月任 中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月 任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长,2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助 理、2001年9月至2004年9月日本行行长助理;1994年至2011年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行 行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生都获经济学硕士学位。 袁女士2015年8月起任本行资产任营业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产任管部总经 理助理、副总经理、本行资产任营业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行资产任管部总经 理助理、副总经理、本行资产任营业务中心副总裁,1999年12月至2007年12月,历任本行资产任管部总经 理助理、副总经理、本行资产任营业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行资产任管部总经 等人计都国际长、科长、处长助理、副收长。会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科 学系,获得学士学位、2005年于新疆财经学院获硕士学位。 (三)基金社管业务经营销成、 截上2015年9月30日,交通银行共托管证券投资基金139只。此外,还托管了基金公司特定客户资产管理 计划,证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资资产、《保险资金、全国社保基金、养老 保障管理基金、企业年金基金、《PFI证券投资资产、RQFI证券投资资产、QDI证券投资资产和QDLP资金等 产品。

. 二、基金托管人的内部控制制度

一、密述几百八印写时空时即以 (一)内部控制目标 交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定、加强内部管理、保证托管中心业务规 章的健全和各项规章的贯彻执行、通过对各种风险的梳理、评估、监控、有效地实现对各项业务风险的管控、 确保业务经验运行、保护基金持有人的合法权益。 (二)内部控制原则 1.合法性原则,托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业

多经营管理活动的始终。

2、全面性原则,托管中心建立各二级都自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制,覆盖各项业 2、全面性原则,托管中心建立各二级都自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制,覆盖各项地 3、独立性原则,托管中心建立负责受托基金资产的保管,保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立对不同论学托基金资产分别设置服产,独立核算,分账管理。

4、制衡性原则,托管中心,贯彻适当授权,相互制约的原则,从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明,相互牵制,并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。
5、有效性原则,托管中心。民创心。举一级部和风险合规部二级内控管理模式的基础上,形成科学合理的内部控制决策机制,执行机制和监管机制,通过行之有效的控制流程,控制措施,建立合理的内控程序,保险和控管即的有效执行。

尽量降低经营运作成本,以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

(三)内部控制制度及措施 根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规,托管中心制定了一整套严密、高 效的证券投资基金托管管理规章制度,确保基金托管业务运行的规范安全、高效、包括《交通银行资产托管的金号理暂行办法》(交通银行资产托管部业务风险管理暂行办法)(交通银行资产托管部项目开发等。 管理办法》、《交通银行资产托管部后息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资 产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理,技术系统完整独立,业务管理制度化、核心作业区实行封闭管理,有

关信息披露由专人负责。 托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风 控制管理、聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。 三基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序 交通银行作为基金托管人,根据《证券投资基金法》、《公开察集证券投资基金运作管理办法》和有关 证券法规的规定、对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算, 金管理人报酬的计提和支付、基金托管人人预删估,提和支付、基金的严助资金的到账与赎回资金的划付。基 金管理人报酬的计提和支付、基金托管人人预测金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开察集证券投资基金运作 管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为。应当及时通知基金管理人于以纠正、基金管理人收到通 知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对交 通银行作为基金托管人,发现基金管理人有重人。

堪人限期知正。 四、其他事项 最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国人民银行。中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

第五部分 相关服务机构

第五部分 相关服务机构

(一)直销机构
(一)直销机构
(一)直销机构
(一)直销机构
(一)直销机构
(一)原根上丹利华鑫基金管理有限公司直销中心
注册地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室
成了55)88990631
2. 摩根上丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦1005室
联系人:杨雪
电话:(0755)889

联系》:杨雪 电话:(010)66155568 传真:(010)66158135 3.摩根上丹利华鑫基金管理有限公司上海分公司 注册地址:上海市浦东新区陆家嘅环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘅环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元

电话: (021)63343311-2100

传真: (021) 63343988 4、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司网上直销系统 交易系统网址: https://etrade.msfunds.com.cn/etrading

义分系统例证:ngry/retade.nstunds.com.cn/etraung 目前支持的网上直销银行卡。 中国银行卡、农业银行卡、工商银行卡、建设银行卡、交通银行卡、招商银行卡、光大银行卡、中信银行 业、银行卡、上海浦东发展银行卡、广发银行卡、民生银行卡、平安银行卡、中国邮政储蓄银行卡、南京银 金华银行卡、上海农村商业银行卡、长沙银行卡。以上银行卡均指银行借记卡,信用卡等贷记卡不支持 "金

网址:www.bankcomm.com 2、其他销售机构情况详见本基金基金份额发售公告或其他调整销售机构的公告。

(三) 登记别网 名称:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 住所:广东省深圳市福田区滨河大道9020号证券大厦4层 办公地址:广东省深圳市福田区滨河大道5020号证券大厦4层 法定代表人:Yu Hua (于华)

电话:021-23238889 经办注册会计师:单峰、俞伟敏

第六部分 基金的募集

第六部分 基金的募集 本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同,经中国证监会2015年7月15日证监许可【2015】1684号文件准予募集。

摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金

二、基立大// 混合型 三、存续期间

三、存续期间 不定期 四、基金的运作方式 契约型开放式 五、募集方式 通过名销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理 届时发布的调整销售机构的相关公告。 查集对象 "查集对象"""基本"。 六、募集对象 六、募集对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法 律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

七、募集期限 本基金的募集期自基金份额发售之日起不超过3个月(具体发售时间详见本基金基金份额发售公告)。

人。 本基金将通过基金管理人的直销网点及本基金其他销售机构的销售网点公开发售(具体名单参见本 基金发售公告及相关公告)。 九、最低募集份额总额和募集限额

本基金股係募集份额应额为2亿份,不设定募集规模上限。 本基金股额为2位值,认购价格;认购费相及计算公式 1.本基金份额的奶油面值,认购价格;认购费相及计算公式 1.本基金份额的奶油面值,认购价格;以购货和 2.本基金认购价格为每份基金份额人民币1.00元。

3.认购费用:本基金分声过直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的认购费率。 来基金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金,可以投资基金的地方社会保障基金,企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。 通时基金管理人的首单中式、制放基金基金价额的养老金家之户,比股费惠田下费。

M<100万元	0.40%	
100万元≤M<500万元	0.24%	
M≥500万元	每笔1000元	
其他投资者认购本基金基金份额认购费率见下表	:(单位:元)	
认购金额(M)	认购费率	
M<100万元	1.00%	
100万元≤M<500万元	0.60%	
M≥500万元	每笔1000元	

、 约认购金额包括认购费用和净认购金额。认购份额的计算公式如下:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率) 认购费用=认购金额—净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购期间的利息)/基金份额初始面值 2)认购费用适用固定金额的情形下:

99029.66份基金份额。 十一、投资人对基金份额的认购 1、认购时间安排 本基金的认购时间安排、投资人认购时应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售

(1)本基金认购采取金额认购的方式

(2)投资人认购时,须按销售机构规定的方式全额缴款。 3、0.009mp.0 销售机构对认购由请的受理并不表示该由请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到了认购由请。认

购的确认儿登记机构的确认结果为准。投资人应在基金合同生效后及时到各销售网点查询最终或交确认情况和认购的份额,否则,如因申请未得到登记机构的确认而造成的损失,由投资人自行承担。若投资人的认购申请被确认为无效,销售网点应当将投资人已支付的认购金额本金退还投资人。

十三、募集资金的保管 基金募集期间募集的资金存人专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。 第七部分 基金合同的生效

本基金自基金份额发售之日起3个月內,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金份额发售之日起3个月內,在基金募集份额总额不少于2亿分,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金份额及查查。 可以决定停止基金发售,并在10日內聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日內,向中国证监会办理基金资金子奖。 基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日 起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专厂账户,在基金募集行为结束前,

任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式
如果基金募集期届满、未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:
1.以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
2.在基金募集期限届满530日内返死投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息;
3.如基金募集失散,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量不减产规模
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人或者基金资产争值低于5000万元的,基金管理人。这至定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当应定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当应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。
自基金合同生效日起、出现如下情形之一的、将根据基金合同第十七部分的约定进行基金合同的终止及基金财产的清算,而汇票召开基金份额持有人大会;

及基金财产的清算,而无需召开基金份额持有人大会: 1、连续60个工作日,基金资产净值低于5000万元; 2、连续60个工作日,基金份额持有人数量少于200人。

2.连续60个上行口,28.34以外, 法律法规另有规定时,从其规定。 第八部分 基金份额的申购与赎回

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业 场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。 二、申购和赎回的开放日及时间

1.升放日及开放时间 投资人在开放日办理基金价额的申收和赎回,具体办理时间为上海证券交易所,深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,若上海证券交易所或深圳证券交易所的正常交易日为非港般通交易日,则本基金不开放。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。基金合理人根据法律法规,中国证监会的要求交易示务。证券交易所令。证时间变更或其他特殊情况,基金管理人将使指尽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》的有关规定在指令键体下公共 71 上公日。 2.申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中

。 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中 想定。 规定。 在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关 在中期定开购开始一两年间开加中时上海监查与不允益。 规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在 基金合同约定之外的日期和时间提出申购,赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回

价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。
三、申购与赎回的原则
1、"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,即申购应金额申请,赎回以份额申请;
3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。
4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人认购,申购的先后次序进行顺序赎回。
基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息被露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
四、申购与赎回的程序
1、申购和赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;本基金登记机构确

从金金近704001,1499年XX。 基金份鄉持有人達交戰回申请,赎回成立;本基金登记机构确人赎回时,赎回生效。投资人赎回申请成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合 同有关条款处理。 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在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

解以與起给稅贷人。 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 赎回申请的确认以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。 五、申购与赎回的数量限制 1.通过基金管理人网站和其他销售机构首次申购单笔最低金额为人民币100元;追加申购单笔最低金 5人民币100元;通过基金管理人直销柜台首次申购单笔最低金额为人民币100元;追加申购单笔最低金 9人民币100元;已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,但受追加申购最低金额的

2.基金投资者将当期分配的基金收益转为基金份额时,不受最低申购金额的限制。
3.基金投资者可多次申购。对单个基金投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。
4.基金投资者可将其全部或部分基金份额赎回,单笔最低赎回份额为10份(除非该账户在销售机构或

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刊登公告并报中国证监

六、申购份额与争赎回金额的计算 (一)申购费用 投资人在一天内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。 申购费用由投资人承担、不列人基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。 本基金对通过直销钟心申购的养老金客户与除止之外的其他投资者实施差别的申购费率。 养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基 金。包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业牛金单一计划以及集合计划。如将来 担契经养老基金监管部下山口的新的养老基金类型,基金管型和一位在特资调料更要新由或发布临时公告将 其纳人养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。 通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表: (单价·元)

		(単位:ラ	
申购金額(M)		申购费率	
M<100万元		0.48%	
100万元≤M<500万元		0.32%	
M≥500万元		每笔1000元	
其他投资者申购本基金基金份额	额申购费率见下表:(阜	单位:元)	
申购金額(M)	申购	申购费率	
M<100万	1.209	1.20%	
100万≤M<500万	0.809	0.80%	
M≥500万	毎笔	每笔1000元	
(二)赎回费用			

本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持

有人年纪,任金金订的时有人观问盘金订加时取取。 对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计人基金财产;对持续持有期超过30日但少于90日的投资人收取的赎回费总额的75%计人基金财产;对持续持有期不少于90日但少于180日的投资人收取的赎回费总额的50%计人基金财产;对持续持有期不少于180日但少于365日的投资人收取的赎回费总额的25%计 人基金财产;对持续持有期不少于365日但少于730日的投资人收取的赎回费总额的25%计入基金财产

具体赎回费率结构如下:		
持有时间(Y)	赎回费率	记人基金资产
Y<7⊟	1.5%	100%
7 ⊟ ≤ Y < 30 ⊟	0.75%	100%
30日 ≤ Y < 90日	0.5%	75%
90∃≤Y<180∃	0.5%	50%
180∃ ≤Y<365∃	0.1%	25%
365日 ≤Y<730日	0.05%	25%
Y≥730∃	0%	0

Y ≥ 730日 0% 0

(三) 申购价额的计算
基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。计算公式如下:
申购费用适用比例赞率时:
申购费用申购金额(1+申购费率)
申购费用申购金额一净申购金额
申购价额=净申购金额,明购当日基金份额净值
申购费用适用固定金额(2)
申购费用适用固定金额(3)
申购费用电应密额 中购购费用
申购价额—净申购金额,申购费用
申购价额—净申购金额,申购费用

归基金财产所有。日基金份额争值为1.050元,某非养老金客户当日申购本基金10万元,对应的本次申购费率为1.20%,该投资人的申购费用及可获得的基金份额为: 净申购金额=100,000/(1+1.20%)。99.814.23元 申购费册=100,000-98.814.23元 申购费册=100,000-98.814.23元 申购份额=98,814.23/1.050=94,108.79 份 即:该非养老金客户投资10 万元申购本基金,假定申购当日基金份额争值为1.050元,申购费用为1,

可获得的基金份额为94,108.79份。 /////-/ 1/3/(1/14/1/2016) (四) 赎回金額的计算 本基金的赎回金額为赎回总额减去赎回费用。计算公式如下: 赎回总额=赎回份数×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

述计算结果均按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此产生的损失由基金财产承担,产生的收益

以自选的《中国企品》《美国·加州 归基金财产所有。 举例,便定某投资人在T日赎回10,000份基金份额,持有时间为450日,对应的赎回费率为0.05%,该日基金财产所有。 举例,便定某投资人在T日赎回10,000份基金份额,持有时间为450日,对应的赎回费率为0.05%,该日基金份额净值为1.2800、1280—12.8800.00元 赎回费用=12.800、0.05%=6.40元 净赎回查额=12.800、00—6.40=12.793.60元 (五 基金份额净值的计算公式为; T日基金份额净值的计算公式为; T日基金份额净值的计算公式为; T日基金份额净值的计算公式为; T日基金份额净值的计算公式为; T日基金份额净值的计算、保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五人,由此产生的收益或损失由基金财产系担。 基金财产系担。 通特来情况、经中国证监会问意,可以适当远迟计算或公告。 (六)基金管理人可以在法律法规和基金合同规定的法则。 式,并最迟近于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定域介上公告。 基金管理人可以在在建定规则定及基金份制度。 基金管理人可以在不是技术推注规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金便销行划。定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动,在基金促销活动,在基金促销活动,在基金促销活动,在基金促销活动,在基金促销活动,在基金管理人

基金官集人可以任个违反法律法规规定及基金管间约定的情形下根据市场情况制定基金使用订划,定期成不定期批开展基金使销活动。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。 七、申赎和赎回的登记业务 1.基金投资人当日申购和赎回申请,在基金管理人规定的时间以内可以撤销。 2.投资人丁申申制基金成功后,签记机构在T+1日为投资人增加权益并办理签记手续,投资人自T+2日为投资户2027人。

4.基金官理人引在法律法规允许印尔图内,对工企会记分维则用进行 访办法》的有关规定在指定媒介上公告。 八、拒绝或暂停申购的情形 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:

1.因不可抗力导致基金无法正常运作。
2.发生基金自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停值。
4.基金管理人接受某笔成某些申购申请会损害现有基金份额持有、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,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情况。

8. 公主共和原语究日鉴显订制的有人利益的目形。 6. 法律法规则定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1.2.3.5. G项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时,基金管理人 定当根据有关规定在指定媒介上刊餐暂停申购价宏。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款 项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 九. 哲停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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

人及生基金管口网处比的智怜基金设置自信的功,基金管理人刊智怜接受投资人的赎回申请或越坡叉代赎回款项,第一次,期债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.发生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。
 发生上处情形之一具基金管理人应定额支付,如暂时不能足额支付,应将可支付部分排化接个作用国证监会备案,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,应将可支付部分排化接个帐户申请量占申请是量的比例为盈经赎回申请人,未支付部分可能期支付。若出理上还算不现所还指来他户申请量上申请是自动比例为盈经赎回申请人来力使的分可能期支付。若出理上还算不现所还指来,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。十一巨额赎回的情况及进方式(一)巨额赎回的情况将就是数量方式。
 (一)巨额赎回的的决定方式。
 (一)巨额赎回的的人工程分配。
 (一)上额赎回的动是金份额净赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数及基金转换中转出申请份额总数方扣账申购申请价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%。
 (二)上额赎回的处理方式

(二)巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎

回。
1.全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。
2.部分延期赎回:当基金管理人认为女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。宣告处单个账户赎回申请量占晚回申请总量的比例,确定当日受避免赎回的例额,对于未能赎回部分,投资人在提受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,将日动持人下一个开放日继续赎回。直到全部赎回为止;选择取消赎回应、当日未来受理的部分赎回申请将被被借,返期的赎回申请与干开放日晚年申请处理人尤优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。
3.暂停赎回。连续之个开放日以后本本数为发生与额赎回,如继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。

、一上。1888年11月2日 1892年上述日鄉陳回并延缓支付赎回款项时,基金管理人应当在2日内在指定媒介上刊登公告,同时在 法规规定的时间内通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人,说明有关处

、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 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 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管暂停公告。
2.基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,依照《信息披露办法》的有关规定,最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。

十二、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。

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。

规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(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的其他品种、基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳人投资范围。
基金的投资组合比例.股票资产(包含投资于国内依法发行上市的股票、及投资于潍股通标的股票的总和)占基金资产的比例范围为0%~95%、权证投资比例不高于基金资产净值的3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,基金特有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 权证.股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
三.投资策略
本基金为灵活配置混合型基金,根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别,对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整,以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。
(1)大类资产配置
本基金将基于大类资产配置轮动方向,制定各阶段股票类资产投资额度,结合对股票基本面和股市趋势的研究,通过自上而下精选行业和自下而上精选个股策略,分享股票市场成长收益。
(2)行业配置策略

本基金将基丁大美效。能直线到力间,制定各阶段股票条实页产投货额股,结合对股票基本固和股巾趋势的研究,通过目上而下精选行业和目下而上精选个股额路、分享股票市场成长收益。
(2)行业配置策略
在行业选择中,本基金将根据宏观经济产业结构变化趋势。新兴技术创新方向、社会经济人口变化趋势等变化、动态分析行业发展所处阶段、筛选经济转型过程中,技术创新浪潮中未来有望受益程度较高或景气有望持续提升的行业发展所处阶段、筛选经济转型过程中,技术创新浪潮中未来有望受益程度较高或景气有望持续提升的行业;本基金也将根据宏观经济周期,上下游行业联动关系等,选择行业景气有望反转、或其在产业维中地位由弱势强或优势扩大的行业。
(3)个股精选策略:"自下而上"精选个股在个股选择中,本基金将通过定性和定量相结合的方法,依据稳健投资、风险第一的原则,在A股与包含在沪港股票市场交易互联互通机制之内的香港股票市场中精选优质个股,构建股票组合。②定性分析:包括公司战路定位,所处产业受国家产业收策的繁潮。公司的盈利模式、公司竞争力分析(包括管理者素质,市场营销能力,发术创新化力、专有技术、特许权、温牌、重零客户等,员和能力、公司治理结构设方方面的支持等方面的分析,选择未来具有广阔成长空间且具有可持续竞争优势的上市公司。②定量分析,通过定量分析于具以判断上市公司的估值高低,具体定量分析方法包括:PE、PB、PEG、PS等相对估值方法,以及企业自现金流析现,股息济和模型等绝对相值方法,以选择恰当的实人时点。会计处理,财务报告以及税务处理方式、稳妥有序的开展优先股投资。
(4)港股通标的股票投资解。本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制、遵循沪港通规定投资于香港股票市场、不使用合格境内机构投资者(QDID境外投资额度进行境外投资。工作工程分表,是处于各理价值的具备核心竞争力股票。本基金将充分发挥时机选择能力,控制股票市场下跌风险。与此同时,本基金将通过分散投资、组合投资和成分散投资、组合投资路路、,将重点投资于受惠于中国经济特别。

2.衍生品投资策略 本基金的行生品投资原则上为有利于基金资产保值增值,控制下跌风险。将严格遵守相关法律法规的 约束,合理利用股档期货,权证等衍生工具。 (1)权证投资策略 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,结合权证定价模型寻求其合理估值水

平,并积极利用正股和校证之间的不同组合来套取无观验收益。本公司将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险特征、通过资产配置。品种与类属选择、谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。 (2)股指射损投资策略 (2)股資期份投資策略
本基金將根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流过性,交易活跃的期货会约。本基金产品种服期货投资中、排通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流过性及风险特征、通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。
3、债券投资策略
本基金定位于主对管理灵活配置型基金,在股票市场投资风险和不确定性增大时,增加债券资产比例,以此降低基金组合系统性风险。本投资组合对于债券的投资主要为久期管理策略,收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略等,并择机把握市场有效性不足情况下的交易机会。四、投资决策起序
1.投资决策依据
1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
2)国内外宏观经济发展状况、微观经济运行环境和证券市场发展趋势;
3)投资品种的预期收益率和风险水平。
2.投资决策程序

(1.1/文/xm/究) 本基金管理人研究团队充分利用外部和内部的研究资源提供研究成果,挖掘投资机会,为投资决策委员会利基金经理提供决策支持。 (2) 投资决策 投资决策委员会是基金投资的最高决策机构,负责制定基金的投资原则,投资目标及整体资产配置策略和风险控制策略,并对基金经理进行授权,对基金的投资进行总体监控。如遇重大事项,投资决策委员会 及时召开临时会议做出冲议。

及时召开临时会议做出决议。
(3)组合构建
基金经理根据投资委员会确定的总体投资策略和原则以及研究团队提供的分析和建议等信息,在建守
基金合同的前提下,在投资决策委员会的授权范围内构建具体的投资组合,进行组合的日常管理。
(4)交易执行
本基金实行集中交易制度。交易团队负责执行基金经理投资指令,同时承担一线风险监控职责。
(5)风险与遗放评估
投资风险管理团队由风险管理部和监察稽核部组成。风险管理部定期或不定期地对基金投资绩效及风险进行评估,监察稽核部对基金投资统合规性进行日常监控及事后检查,风险管理委员会定期召开会议,结合市场,法律等环境的变化,对基金投资组合进行风险评估,并提出风险防范措施及意见。
(6)组合调整 6)组合调整 基金经理根据行业状况、证券市场和上市公司的发展变化、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合

与绩效评估的结果,对投资组合进行动态调整。 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资 本基金管理人在确保基金好物研引入外域的现象上,只有人的基本的程序,并在更新的招募说明书中公告。
五、业绩比较基准
沪深300指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×20%
如果今后法律法规发生变化、又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数、则基金管理人将视情况至与基金托管人协而同意后调整本基金的业比较基准,而无需召开基金份额持有人大会审议、并应及时公告并报中国证监会备案,同时在更新的招募说明书中列示。

一、风险收益特征

六、风险收益特征 本基金为混合型基金,理论上其长期平均风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场 基金。此外,相比不投资于境外市场的其他混合型基金,本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以 及境外市场的风险。

展外,有UTILLY对自欧来,因为(个百封对日任 十以了可见从时间对了大机。)以 人可证办 八八〇日业 融资产(个高度押式间则)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人、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为 99%; 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

有关规定:
(18)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;
(19)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。
因证券期货市场旅动、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。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

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 八、整计行为

昳文勿争90251甲鱼。 法律、行政法规或监管机构取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金

法律引取なび機能・自びになった。 投资不再受相关限制。 九、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 であった。

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。 於成的的信息和。 - 、基金资产等值 基金资产等值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。 - 、基金财产的账户 基金并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、证券账户以及投资所需的其他专 张户。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 其他基金财产账户相独立。 四、其全财产的保险有的4分

四、基金财产的保管和处分 基金托管人、基金经过产组立于基金管理人、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

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

9月-×29日。 二、估值对象 基金所拥有的股票、股指期货合约、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 基金所所有印成宗。成督明项管学、《社证、面券和银行存》本总、应收款项、其它投资等货产及页面。 三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 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 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 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 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

(4)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种,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.银行间市场交易的固定收益品种的估值

(2)对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种,按成本估值。
4.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理;
(1)送股、转镀股。起股和公开增收的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;
该且无交易的,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,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。第2小天发行有明确锁定期的股票,提高管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
5.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。
6.本基金投资股指期货等衍生品种合约,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。
7.持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按相应利率逐日计提利息。
8.估值计算中涉及港市对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准;当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。
9.如有确值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。

(下转B15版)

基金托管人商定后,按最能反映之允价值的价格估值。 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

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。包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及 其他经中国证监会核准发行上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的 香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")、债券(包括国债、央行票据金融债、企业债、 公司债、可转收债券(含可分离交易可转收债券)、改破债、短期赔贷券,超短期赔贷券、中期实据 证券及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法

第九部分 基金的投资 本基金采取主动管理的投资策略,在严控风险的基础上,力争为投资人获取稳健回报。

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)股票资产占基金资产的比例为0%-95%;
(2)本基金每个交易日日终在机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设合的证券,其市值(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算)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%;
(7)本基金在管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过运发证的10%;
(7)本基金在管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过速发资产单值的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0.6%;
(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,不得超过基金资产净值的0.6%;
(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,不得超过基金资产净值的0.6%;
(11)本基金营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修、不再符合投资标准。应定评级报告发布之日起3个月内于以全部实出;
(13)基金股产参上股票发行申歇,本基金所申报的金额不超过本金。产产支持证券期间如果扩展用等级了股票、不再符合投资标准。应定评级报告发布之日起3个月内于以全部实出;
(14)本基金应投资于信息和5级景景。

2)本基金在任何交易日日终,持有的买人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、买人返售金

产净值的20%;
(16)本基金投资流通受限证券。基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金 托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流 程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;
(17)基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的,应当根据风险管理的原则,并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例,应当符合中国证监会的

查自基金合同生效之日起开始。如果法律法规或监管部门对上述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

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。

7. 基金管理人代表基金行理股东及情权人权利的处理原则及万法 1. 不谋求对上市公司的经股、不参与所投资上市公司的经营管理; 2. 有利于基金财产的安全与增值; 3. 不通过关联交易为自身 雇员,接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; 4. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使储权人权利,保护基金份额持有人的利益。 第十部分 基金的财产

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。 第十一部分 基金资产的估值 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

(1)银行间市场交易的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估 (2)对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种,按成本估值。

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。 基金管理人负责基金资产净值计算和基金会计核算,并担任基金会计责任方。就与本基金有关的会计