(上接B22版)

5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

(四)投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

①投资决策委员会制定整体投资战略。

②研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果,构建股票备选库、精选库,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供个股、债券决策支持。

③基金经理根据投资决策委员会的投资战略,设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括:每日基金申购和赎回净现金流量;基金合同的投资限制和比例限制;研究员的投资建议;基金经理的独立判断;绩效与风险评估小组的建议等。

④投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

⑤根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由交易部执行。

⑥交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理。

⑦基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

⑧风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

(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×70%+中证全债指数收益率×30%。

业绩比较基准选择理由:

沪深300指数是由中证指数公司编制发布、表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束,设定本基金的基准为沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%,该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

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的指数时,本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召集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,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

(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本基金将基金资产的0%-95%投资于股票;将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种;

②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本基金持有一家上市公司的股票,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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

⑮)一只基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之三;一只基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之十五;经基金管理人和基金托管人协商,可对以上比例进行调整;

⑯)本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的10%,并且不得超过基金净值的10%;

⑰)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%;

⑱)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;

⑲)本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金管理人应当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、交易日的及对应的证券资产情况等;

⑳)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

㉑)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%;

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。

本基金在开始进行股指期货投资之前,应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、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。

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。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

①承销证券;

②违反规定向他人贷款或者提供担保;

③从事承担无限责任的投资;

④买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(八)基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1、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;

2、有利于基金资产的安全与增值;

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益;

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益。

(九)基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十)基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月8日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日(未经审计)。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	21,155,503.49	2.31
	其中:股票	21,155,503.49	2.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,115,870.00	5.04
	其中:债券	46,115,870.00	5.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	846,138,555.25	92.41
8	其他资产	2,235,904.77	0.24
9	合计	915,645,833.51	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,771,200.00	0.30
C	制造业	4,850,380.00	0.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,430,823.49	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,302,100.00	0.47
K	房地产业	6,801,000.00	0.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,155,503.49	2.31

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	深振业A	540,000	5,076,000.00	0.55
2	000630	铜陵有色	1,538,000	3,552,780.00	0.39
3	600547	山东黄金	160,000	2,771,200.00	0.30
4	601985	中国核电	268,007	2,430,823.49	0.27
5	601988	中国银行	500,000	1,860,000.00	0.20
6	601628	中国人寿	70,000	1,787,100.00	0.20
7	600376	首开股份	100,000	926,000.00	0.10
8	600038	中直股份	20,000	849,000.00	0.09
9	600048	保利地产	100,000	799,000.00	0.09
10	000776	广发证券	50,000	655,000.00	0.07

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	46,115,870.00	5.04
	其中:政策性金融债	46,115,870.00	5.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,115,870.00	5.04

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	457,000	46,115,870.00	5.04

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	188,483.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,047,421.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,235,904.77

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000630	铜陵有色	3,552,780.00	0.39	重大事项
2	600547	山东黄金	2,771,200.00	0.30	重大资产重组

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

前海开源事件驱动混合型发起式证券投资基金

阶段	净值增长率①)	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③)	业绩比较基准收益率标准差④)	①-③)	②-④)
2013.12.19-2013.12.31	0.10%	0.03%	-0.04%	0.92%	0.14%	-0.89%
2014.1.1-2014.12.31	1.60%	0.99%	38.56%	0.85%	-36.96%	0.14%
2015.1.1-2015.9.30	4.82%	0.85%	-3.68%	1.89%	8.50%	-1.04%
2013.12.19-2015.9.30	6.60%	0.92%	33.41%	1.38%	-26.81%	-0.46%

注:本基金的业绩比较准为:沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

九、基金的费用与税收用与税收

(一)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、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、证券账户开户费用、银行账户维护费用;

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。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.9%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.9%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前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、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.1%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.1%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划出,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“(一)基金费用的种类”中第4-10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。

(三)不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况,履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和和销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

(五)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。

十、其他应披露事项

(一)本基金管理人的董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理(深圳)有限公司(以下简称“前海开源资管公司”)兼职及领薪情况如下:

本基金管理人总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长、法定代表人;

本基金管理人首席运营官、董事会秘书李志祥先生兼任前海开源资管公司董事;

本基金管理人汤力女士兼任前海开源资管公司监事;

本基金管理人联席投资总监付柏瑞先生兼任前海开源资管公司联席总经理、投资经理;

本基金管理人专户投资部员工龚自勇、吴彦、李隽、张洋兼任前海开源资管公司投资经理。

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。

本基金管理人除上述人员以外未有其他董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

(二)2015年6月19日至2015年12月19日披露的公告:

日期	公告
2015-12-16	关于前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金恢复申购等业务并暂停大额申购、定投及转换转入业务的公告
2015-12-04	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金C类份额在直销柜台开通转换业务并开展申购补差费率优惠活动的公告
2015-12-01	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加长量基金费率优惠活动的公告
2015-11-27	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-11-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加天风证券为代销机构并开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-11-19	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加天风证券为代销机构并开通定投和转换业务的公告
2015-11-16	关于前海开源事件驱动混合基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告
2015-11-13	关于前海开源事件驱动混合基金恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告
2015-11-11	关于前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告
2015-10-24	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年第3季度报告
2015-10-23	关于前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告
2015-10-23	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中国邮政储蓄银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加北京微动利为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加积木盒子为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加大通证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中经北证为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加国金证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-10-15	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-25	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加陆金所资管为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-23	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加新浪仓石为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-09	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-09	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加德安基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加渤海证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-08-25	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年半年度报告摘要
2015-08-25	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年半年度报告
2015-08-18	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中金公司费率优惠活动的公告
2015-08-13	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与泰诚财富费率优惠活动的公告
2015-08-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加天天基金费率优惠活动的公告
2015-08-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加数米基金费率优惠活动的公告
2015-08-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加钱景财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-08-03	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加长城证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-08-01	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2015年第1号)
2015-07-20	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告
2015-07-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在安信证券开通转换业务的公告
2015-07-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加恒天明泽为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-16	关于前海开源事件驱动混合基金恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告
2015-07-14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江德为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-04	关于前海开源事件驱动混合基金继续暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告
2015-07-03	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中期资产为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-01	前海开源基金管理有限公司旗下基金2015年半年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告
2015-06-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行申购费率优惠活动的公告
2015-06-26	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加泰诚财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-24	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加汇付金融为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

十一、备查文件

(一)备查文件包括:

1、中国证监会准予注册前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件

2、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

3、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二)备查文件的存放地点和投资人查阅方式:

1、存放地点:《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式:投资人可在营业时间免费到存放地点查阅,也可按工本费购买复印件。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《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》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“释义”部分增加名词释义,包括基金份额分类、A类基金份额、C类基金份额、销售服务费等。

2、对“基金管理人”相关信息进行了更新,包括董监高人员信息等。

3、对“基金托管人”相关信息进行了更新。

4、在“相关服务机构”部分,对代销机构名单进行了更新。

5、对“基金份额的申购与赎回”相关信息进行了更新,增加了C类份额的申购赎回费率等。

6、在“基金的投资”部分,更新了“(十)基金的投资组合报告”、“(十一)基金的业绩”相关信息。

7、在“基金的费用与税收”部分,增加了C类份额计提销售服务费的相关信息。

8、在“基金合同的内容摘要”部分,增加了有关C类份额计提销售服务费的相关信息。

9、在“基金托管协议的内容摘要”部分,更新了基金托管人的相关信息等。

10、在“其他应披露事项”部分,披露了本基金管理人董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理(深圳)有限公司兼职及领薪情况;披露了2015年6月19日至2015年12月19日期间涉及本基金的公告。

11、对增加C类份额后的相关表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司
二〇一六年二月一日

证券代码:000838　证券简称:财信发展　公告编号:2016-013

财信国兴地产发展股份有限公司关于召开2015年度股东大会的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

经财信国兴地产发展股份有限公司(以下简称“公司”)董事会决定,公司拟于2016年2月5日召开2015年度股东大会,现将有关事项通知如下:

一、召开会议基本情况

(一)召开时间:

现场会议召开时间:2016年2月5日下午14:00时

网络投票时间:2016年2月4日至2月5日

其中:通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为:2016年2月5日上午9:30-11:30、下午13:00-15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为:2016年2月4日15:00至2月5日15:00的任意时间。

(二)召开地点:北京市朝阳区建国路91号院8号楼金地中心A座2808室,公司会议室。

(三)召集人:公司董事会。

(四)股权登记日:2016年1月29日

(五)召开方式:现场投票和网络投票相结合的方式。公司将通过深圳证券交易所系统向公司股东提供网络投票平台,公司股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

(六)出席对象:

1、本公司董事、监事及高级管理人员;

2、截止2016年1月29日下午交易结束后,中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的持有本公司股票的全体股东;

3、公司聘请的会议见证律师;

4、因故不能出席会议的股东可委托代理人出席(授权委托书附后)。

(七)投票规则

本次股东大会提供现场投票和网络投票两种投票表决方式,同一股份只能选择现场投票或网络投票中的一种表决方式,不能重复投票。股东可以在网络投票时间内通过深圳证券交易所的交易系统行使表决权。同一股份通过现场方式和网络方式重复进行投票的,以第一次投票结果为准。

二、会议审议的议案

(一)会议主要议题:

1、审议《公司2015年年度报告及摘要》;

2、审议《公司2015年度董事会工作报告》;

3、审议《公司2015年度监事会工作报告》;

4、审议《2015年度独立董事述职报告》;

5、审议《公司2015年度财务决算报告》;

6、审议《公司2015年度利润分配方案》;

7、审议《关于公司2016年度向金融机构申请综合授信的议案》;

8、审议《关于预计新增对控股子公司(含全资子公司)担保额度的议案》;

9、审议《关于公司2016年度取得开发用地总体授权的议案》;

10、审议《关于授权公司及控股子公司(含全资子公司)购买保本型理财产品的议案》;

11、审议《选举刘长华为公司第九届董事会独立董事的议案》。

(二)议案披露情况:以上审议事项的议案内容详见2016年1月16日的《证券时报》和巨潮网。

三、会议登记办法

(一)登记方式:现场登记、通过信函或传真方式登记。

(二)登记时间:2016年2月3日9:00—17:00

(三)登记地点:公司董事会办公室。

(四)登记手续:

1、社会公众股东持本人身份证、股东账户卡和持股凭证,该股东委托他人出席会议的,受托人持本人身份证、授权委托书、委托人股东账户卡、持股凭证和委托人身份证。

2、法人股东持营业执照复印件、法定代表人身份证、法人股东单位的持股凭证;法人股东委托代理人出席会议的,代理人应出示本人身份证、法人股东单位的营业执照复印件、授权委托书和持股凭证。

3、异地股东可将本人身份证、持股凭证通过信函或传真方式登记。

4、网络投票登记注意事项

证券投资基金参与公司股东大会网络投票的,应在股权登记日后两个工作日内向深圳证券交易所信息网络有限公司报送用于网络投票的股东账户;公司其他股东利用交易系统可以直接进行网络投票,不需要提前进行参会登记。

(五)授权委托书

兹全权委托(先生/女士)代表本人/本公司出席财信国兴地产发展股份有限公司2015年度股东大会,并代为行使表决权。

委托人姓名(名称):　委托人身份证号码/营业执照注册号:

委托人股东账号:　委托人持股数:

受托人姓名:　受托人身份证号码:

委托人签名(盖章):

受托人签名:　委托日期:

四、通过网络投票的投票程序

(一)通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的程序

1、本次临时股东大会通过深圳证券交易系统进行网络投票的时间为2016年2月5日上午9:30-11:30、下午13:00-15:00,投票程序比照深圳证券交易所新股申购业务操作。

2、投票代码与股票简称

投票代码	投票简称	表决议案数量	说明
360838	财信投票	11	A股

3、股东投票的具体程序为:

(1)买卖方向为买入投票;

(2)在“委托价格”项下填报本次临时股东大会需要表决的议案事项顺序号,100元代表总议案,1.00元代表第1个需要表决的议案事项,以2.00元代表第2个需要表决的议案事项,以此类推。每一议案应以相应的委托价格分别申报。

本次年度股东大会需要表决的议案事项的顺序号及对应的申报价格如下表:

议案序号	议案内容	对应申报价格
100	总议案	100元
1	审议《公司2015年年度报告及摘要》	1.00元
2	审议《公司2015年度董事会工作报告》	2.00元
3	审议《公司2015年度监事会工作报告》	3.00元
4	审议《2015年度独立董事述职报告》	4.00元
5	审议《公司2015年度财务决算报告》	5.00元
6	审议《公司2015年度利润分配方案》	6.00元
7	审议《关于公司2016年度向金融机构申请综合授信的议案》	7.00元
8	审议《关于预计新增对控股子公司(含全资子公司)担保额度的议案》	8.00元
9	审议《关于公司2016年度取得开发用地总体授权的议案》	9.00元
10	审议《关于授权公司及控股子公司(含全资子公司)购买保本型理财产品的议案》	10.00元
11	审议《选举刘长华为公司第九届董事会独立董事的议案》	11.00元

在“委托股数”项下填报表决意见,1股代表同意,2股代表反对,3股代表弃权。

表决意见种类	同意	反对	弃权
对应的申报股数	1股	2股	3股

(4)股东对总议案进行投票,视为对其他所有议案表达相同意见。

在股东对同一议案出现总议案与分议案重复投票时,以第一次有效投票为准。如股东先对分议案投票表决,再对总议案投票表决,则以已投票表决的分议案的表决意见为准,其他未表决的议案以总议案的表决意见为准;如先对总议案投票表决,再对分议案投票表决,则以总议案的表决意见为准。

(5)对同一议案的投票以第一次有效申报为准,不得撤单。

4、投票举例

(1)股权登记日持有“财信发展”A股的股东,对公司议案1投同意票,其申报如下:

投票代码	投票简称	买卖方向	申报价格	申报股数
360838	财信投票	买入	1.00元	1股

(2)如某股东对议案1投反对票,只要将申报股数改为2股,其他申报内容相同:

投票代码	投票简称	买卖方向	申报价格	申报股数
360838	财信投票	买入	1.00元	2股

5、本次股东大会设置总议案