(上接B5版) (1)董事会:负责制定公司的内部控制政策,对内部控制负完全的和最终的责

(2)监事会:对公司的经营情况进行检查,并对董事会和管理层履行职责的情况 进行监督。 (3) 督察长,独立行使督察权利,直接对董事会负责,就内部控制制度和执行情况独立地履行检查,评价、报告,建议职能;向董事会和中国证监会进行定期,不定期报告。

(4)投资决策委员会:负责指导基金财产的运作,对基金投资的所有重大问题进

(4)投资决策委员会:负责指导基金财产的运作,对基金投资的所有重大问题进行决策。 (5)风险控制委员会:协助确立公司风险控制的原则,目标和策略,并就风险控制重要事项进行讨论和决策。 (6)监察稽核部 独立于其他部门和业务活动,对内部控制制度的执行情况进行全面及专项的检查和反馈,使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。 (7)业务部门,具体执行公司各项内部控制制度及政策,确保各项业务活动合独非行。

(7)业务部]; 具体外介公可在"契约"的国际现金人。 法、合规进行。 3、内部控制的措施 (1)部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。 各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责,并编制详细的岗位说明书和 业务流程,建立重要凭据传递及信息沟通制度,实现相关部门、相关岗位之间的监督

(2)严格授权控制。 授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程,确保 授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式,明确授权内容和实效,对已 获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。 (3)实行恰当的岗位分离制度,各业多部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分 窗。重要业务和岗位进行物理隔离,投资与交易,交易与清算、基金会计与公司会计等 等即始位了增加。是不是

寫。重要业务和岗位进行物理隔离,投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等
重要岗位不得有人员重卷。
(4)建立完善的资产分离制度。
建立完善的资产分离制度。
建立完善的资产分离制度。
走立产医有效的风险管理系统。
风险管理系统包括两方面;一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等;二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统,对公司内外部风险进行识别,评估和分析、及时防范和化解风险。
(6)建立完整的信息资料保全系统。

(6)1種以元餘的信息於何怀至於死。 真实、全面、及时、推确地记载車一笔业务,及时准确地进行会计核算和业务记录:完整妥善地保管好会计,统计和各项业务资料档案,确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。 4.基金管理人关于内部控制制度的声明书 基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度 是基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度 是基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度 是基金管理人的知能和制度和风险管理的披露真实、准确,并承诺根据市场的变化和基金 管理人的性理人所被控制制度和风险管理和抗效验制制度 管理人的发展不断完善风险管理和

第四部分 基金托管人

、基金托管人的情况 一、基金計(1年)化財育化 1、基金計管人的基本情况 名称:中国工商银行股份有限公司 住所:北京市西城区复兴门内大街55号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号 成立时间:1984年1月1日

放近时间:1984年1711日 法定代表人:易会满 注册资本:人民币35,640,625.71万元

3、内部风险控制原则 (1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯 穿于托管业务经营管理活动的始终。 (2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应参透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗

位和人员。
(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照"内控优先"的原则。新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。
(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险。审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。
(3)有效性原则。内控制度应根据国家政策,法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间。训师及人人的例外。
(6)独立性原则。这立专门履行社管、职责的管理部门,直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

和执行部门。 4.内部风险控制措施实施 (1)严格的隔窝制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离、建立了明确的岗位职责。科学的业务流程、详细的操作手册。严格的人员行为规范等一系列规章制度。 并采取了良好的防火墙隔窝制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度

开水和 J 及写面则为《栅烟商则尽,他罗明时以及 至此》(2008年上)、八公路上,从2008年有管理处,风络独立。 (2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的 制定者和管理者。要求下级和「及时报告经营管理情况,以检查资产托管 部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立"自控防线"、"互控防 (3)人事控制。资产社官部广格落头同位页社制,建立"目砼的较、"互及的 线、"监控的线"一道控制的线,健全域效考核和微励机制,树立"以人为本"的协定 文化、增强员工的责任心和荣誉感、培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定 向的业务与职业道德培训、签订承访书,使员工树立风险防范与控制理念。 (4)经管控制、资产性管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活 动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源、达到资源利用和效益最大化目 约2000年

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管

(5)内离风险管理、资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理、定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控、指导业务部门进行风险识别、评估、制定并实施风险控制措施、排查风险稳患。
(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来限额据安全。
(7)应急准备与响应、资产托管业务建立专门的灾难恢复中心、制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案、并组织员工定期强练。为使演练更加接近实战、资产托管部不断提高演练标准、从最初的按照预订时间消练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看、资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。
5.资产托管部内部风险控制情况。
(1)资产托管部内部风险控制情况。
(1)资产托管部内部风险控制情况。在总经理的直接领导下、依照有关法律规章、全面贯彻落实全程监控思视、确保资产托管部实施全是风险管理、稳定地发展。
(2)完善组织结构、实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与、具有这样、风险控制制度和计算不会全面、有效、资产托管部实施全员风险管理、将风险控制责任落实到具体业务部门和少多岗位、每位员工对自己岗位职责党部内的风险负责、通过建立级的双人制、横向多部门制的内部组织结构、形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。。
(3)建设使全规章制度、资产任管部十分重视内控制度的建设、一贯坚持把风险防荒和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年务力、资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括(过取责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等、覆盖所有部门、和讨位、渗透各项业务过程、形成各个业务环节之间的相互制验机制。

而宗师仪、记念级帝时处、中、使血疗行用的,所以止、序及往今近方及驻、办及行。业为 东节之间的相互制约机时。 (4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产 托管业务是商业银行新兴的中间业务、资产托管部从成立之日起就特别强调规范运 作。一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境 的变化和托管业务的快速发展、新问题、新情况不断出现、资产任管部股给转风险管 理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生

理成任与业务发展问寺重要的辽直,代风险奶尼和控制力托官业务生存私发展的生命线。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和相呼根据《基金法》基金合同,基金托管人与基金管理人签署的《中欧消费主题股票型证券投资基金托管协议》和有关基金法规的规定。基金托管人对基金的投资对象、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、基金管理人报酬的计提和文付、基金费用的文付、基金申购实金的到账和账间资金的对价、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性。合规性进行监督和核查,其中对基金的投资监督和检查,基金托管人及现基金管理人也更优惠。基金托管人及现基金管理人取到通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知无证应及时核对,并以市面形式对基金杆管人发出回路确心。在限期内、基金杆管人有权随时对通知事项进行复查。管理基金管理人取出。基金管理人对基金杆管人有权随时对通知事项进行复查。管理基金管理人及出回路确心。在限期内、基金杆管人有规则对通知事项进行复查。管理基金管理人定正。基金管理人对基金杆管人通知的法规事项并依在限期内以正的、基金样管人应报告中国证监会。基金杆管人及现基金管理人有重大速规行为,应立即报告生国证监会。基金杆管人及现基金管理人有重大速规行为,应立即报告中国证法金、基金任管人发现基金管理人有重大速规行为,应立即报告中国国证法金、通时通知基金管理人限期纠正。

第五部分 相关服务机构

1.直第6/内 名称:中欧基金管理有限公司 住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层 办公地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

客服热线:021-68609700,400-700-9700(免长途话费)

网址:www.zofund.com 2、其他销售机构

2.其他销售机构 (1)中国工商银行股份有限公司 住所:北京市西城区复兴门内大街 55 号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号 法定代表人: 易会满 联系人:刘秀宇

网址:www.guodu.com

(5)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;北京市朝阳区党马 路48号中信证券大厦 法定代表人:孫佑君 联系人·侯粹红 电话:010-60836031;0755-23835383 传真:010-60836031;0755-23835525 客服热线:95558 网址:www.citcs.com (6)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20层 技定代表人:杨宝林

阀址: www.zxvt.com.cn (7)中信期货有限公司 住所: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301–1305室、

14/kg 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场 (二期) 北座13层1301-1305 室、14层 法定代表人:张皓 联系人:洪城

电话:0755-23953913 字户热线:400-990-8826 例址:www.citicsf.com (8)上海好买基金销售有限公司 住所:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼 法定代表人:杨文斌 れポス: 水知 电话:021-20613999 客服热线:400-700-9665

网址:www.howbuy.com (9)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

传真:0571-26698533 客服热线:4000-766-123 伊斯:上海市徐汇区龙田路190号2号楼 办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

我系人:李广宇 电话:021-54509998-7019 传真:021-64385308 之服执线・400-1818-188 网址:www.1234567.com.cn (11)浙江同花顺基金销售有限公司

电离:9371-86800423
客服热线,400-877-3772
网址:www.sfinnd.com
(12)上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家哪环路1333号14楼
办公地址:上海市浦东新区陆家哪环路1333号14楼
法定代表人,郭坚
联系人;宁博宇
电话:021-20665952
传真,021-2206653
客户热线:400-821-9031
网址:www.lufinds.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,提供请咨询各销售机构。

| 背馬股争川能和70年311/11。 二、登记机的 占称:中欧基金管理有限公司 注所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层 办公地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层 法定代表人: 襄玉明 一公邓田、州建平

电话:021-68609600 专真:021-68609601 日葵3.0.2 0800000 联系人(曾志斌 三.出县法律意见书的律师事务所 名称:上海市镇加律师事务所 住所:上海市镇城中路68号时代金融中心19楼 为公地址:上海市镇城中路68号时代金融中心19楼 负责人。俞卫锋

电话:021-31358666 专真:021-31358600

[資訊(21-31:35000) 取:系人:貼洽 四:東计基金財产的会计师事务所 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哪环路1318号星展银行大厦6楼 办公地址:上海市湖东路202号普华永道中心11楼 执行事务合伙人:李丹

专真:021-23238800

(人: 俞伟敏) 经办会计师: 单峰 俞伟敏 第六部分 基金的募集

一、基金募集的依据 本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其 他法律法规的有关规定,经2016年3月30日中国证监会证监许可[2016]631号文准予募

二、基金类别与运作方式 本基金的类别为股票型证券投资基金。 本基金的运作方式为契约型、开放式。 三、基金存续期限

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不

本基金依值以例7年购资户、销售服务资户积以取万元的不问。将基金货油0万万个 向的类别。在投资者以购中率的费用、使用水量、使用。有量的,并以及工程的。 销售服务费的,称为A类基金份额,在投资者认购,申购时不收取认购,申购费用,而是 从本类别基金资产中计提销售服务费的。称为C类基金份额。 本基金本类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基 金A类基金份额和C类基金份额的分别计算基金份额价值,计算公式为; 计算日类类基金份额的等值。该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日 发售在外的该类别基金份额总数。 投资类型口包含类容别的企用的数量。

投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不

得互伯特學。 在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况 下,基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类 别的申购费率,调饭赎回费率或变更收费方式,停止填着基金份额类别的销售等,调 整实施前基金管理人需及时公告,并报中国证监会备案。

通过各销售机构的基金销售网点或指定的其他方式公开发售,各销售机构的具 単见基金份额发售公告以及其全管理人口は一个本の記述をはないます。

白基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公 七、基金的最低募集份额总额和金额 本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于人民币2亿元。

公认购预用 本基金A类基金份额在认购的收取认购费。C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率随认购金额的增加而递减。基金认购费用不列入基金财产。本基金对通过直销中心认购A类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资人。2位6年2006年18月20日。

累说明书更新叶或发介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人。 通过基金管理人的直销中心认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率见

认购金额 (M) M<100万元 100万元≤M<500万: 、购本基金A类基金份额的认购费率见下 100万元≤M<500万 M≥500万元 每笔1000

(1)若投资者选择认购A类基金份额,则认购份额的计算公式为: 当认购费用适用比例费率时,认购份额的计算公式为 净认购金额=认购金额/(1+认购费率) 认购份额=(净认购金额+认购利息)/1.00元 当认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下:

(中D)(明显 mir D)(明显 mir D)(明显 mir D)(明显 mir D)(明定 mir D)(则定 mir D)(

额,认购费率为1.20%(假设这100,000元在认购期间产生的利息为29.50元,则其可得到的基金份额数计算如下: 净认购金额=100,000/(1+1.20%)=98,814.23元

(中)(例:金)(中)(2000/01/11/22/01/2009/03,614/23年1,185.77元 认购的類 (198,814.23年1,185.77元 认购的额 (198,814.23+29.50)/1.00=98,843.73份 即,投资人(非养老金A产)投资(100,000元认购期 结束时,假设这100,000元在认购期间产生的利息为29.50元,投资人账户登记有本基

0份。 十、投资人对本基金的认购 1、认版时间安排

1.认规时间全排 投资人认购本基金的具体业务办理时间见基金份额发售公告。 2.投资人认购本基金应提交的文件和办理的手续 投资人人人则本基金应提交的文件和办理的手续见基金份额发售公告。 3.认购的方式及确认 投资人人以财工需按销售机构规定的方式全额缴款。 投资人在享集期内可多次认购基金份额、认购申请一经受理,不得撤销。 投资人在可日规定时间内提及的认购申请。应于T+2日(包括该日)后及时在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心。适似规审请是各被应办受理。 投资人应于基金合同生效后及时在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中 心查询认购确认份额。 4.认购的限额

本基金共能销售机构的销售网点每个基金账户单笔最低认购金额为10元;直销机构每个基金账户的首次最低认购金额为10,000元,追加认购单笔最低认购金额为10,000元,不设级差限制(通过基金管理人网上交易系统认购本基金暂不受此限制,

具体规定请至基金管理人网站查询)。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计儿购金额不设限制。各销售机构对最低儿购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。 基金管理人可根据市场情况、调整认购金额的数量限制并提前公告。 十一、募集资金利息的处理 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以登记机构的记录为准。 十二、基金募集期间募集的资金存入专门账户,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 - 、基金备案的条件

决。 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** 一,申购和赎回场所 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在 其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况针对某类份额变更或增减销售机构,并 予以公告。基金投资人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 提供的其他方式为理基金份额的申购与赎回。 二,申购和赎回的开放日及时间

15.77放日及77放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,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百的交易时间。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收,赎回时除外。 基金合同中级后,活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。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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 恒在申购开始公告中规定。 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京都时间办理基份额的申购,赎 回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期京时间提出申购,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该类基金份额申购,赎回的价格。 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该类基金份额净

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

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 规则开始实施前依职(信息披露办法)的有关规定在指定媒介上公告。 四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式

四、申购与映归的产时, 1、申购用赎回的申请方式 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。 2、申购年赎回的款项支付 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 含记机协商癿基金份额时,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。投资 人赎回申请政功后、基金管理人将在干+7日包括该日内内支付赎回款项。在发生巨额 赎回时,款项的支付为法参联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(下日)、在正常情况下、本基金登记机构在下+1日内对该交易的有效性进行确 认。下日提交的有效申请,投资人应在下+2日后包括该日)及时到销售网点柜合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。

人。 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,申购取赎回的数量限制 1.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10元。各销售机构 对本基金单笔最低申购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为 准

直销机构每个账户首次申购的最低金额为10,000元,追加申购的最低金额为单笔

直轉机构每个账户首次申购的最低金额为10,000元,這加申购的最低金额为单笔 10,000元。其他销售机构的销售网点的投资者欲转入直销机构进行交易须受直销机构最低申购金额的限制,投资者当期外危的基金收益转为基金的额时,不受最低申购金额的限制,具体现定请至基金管理人网上交易系统办理基金申购业务的不受直销机构单笔申购最低金额的限制,具体现定请至基金管理人网当首询。基金管理人可根据市场情况、调整本基金首次申购的最低金额和追加申购的最低金额。投资者可多不申购,对单个投资者的累计持有份额不过上限限制。2.基金份额持有人在销售机构操证时,每次对本基金的赎回申请不得低于5份基金份额。若某笔份额减少类业务4。每个数量的大量的发出,有效对该基金份额持有人并有的基金份额做全部赎回处理(份额减少类业务指赎回,转换转出、非交易过户等业务,具体种类以相关业务规则为储)。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将使用显远会备案。

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採中国证监会备案。 六,申竣和赎回的价格、费用及其用途 1、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位四舍五人,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。退特架情况。经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。本基金A类基金份额净和、类基金份额净值,有效份额是公决定。申购的有效份额为净申购金额等以当日的该类基金份额净值,有效份额单位分份,上述计算结果均按四舍五人方法、保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。 投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。 (1)由坡费用

(1)甲购资用 本基金A类基金份额在投资人申购时收取申购费,C类基金份额不收取申购费。 ·费用不列人基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。 本基金对通过直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户与除此之外的其

INDIX 风八头爬车即即甲则双手。 养老金客户包括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等,具体包括:

形成的补充系老基金章,共中也回:
1)全国社会保障基金;
2)可以投资基金的地方社会保障基金;
3)企业年金单一计划以及集合计划;
4)企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;

2)1/15/41+ 本苏不至亚广印。 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 阴书更新时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 。非养金金客户/的排除养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A类基金份额的养老金客户申购费率见

	申购金额 (M)		费率
申购费率	M<100万元		0.45%
	100万元≤M<500万元		0.30%
	M≥500万元		每笔1000元
其他投资人申	购本基金A类基金份额的申购费率	见下	表:
申购费率	申购金额 (M)	费率	
	M<100万元	1.50%	
	100万元≤M<500万元	1.00%	
	M≥500万元	每笔1000元	
)由贮份额的计算	=		

得到的申购份额为: 净申购金额=100,000/(1+1.50%)=98,522.17元

申购费用=100,000-98,522.17=1,477.83元 申购份额=98,522.17/1.000-98,522.17份 即:投资人(非养老金名户)投资10,0000元申购本基金A类基金份额,假设申购 当日本基金A类基金份额的基金份额争值为1.000元,则其可得到本基金A类基金份额 分额98,522.17份。 2)若投资者选择申购C类基金份额,则申购份额的计算公式为:

申助份额--申助金额-中助当日C类基金份额的基金份额单值 例:某投资人投资100,000 元申购本基金C类基金份额,假设申购当日本基金C类基金份额的基金份额净值为1.00元,则可得到约申购份额为:

(1)原凹页用 本基金A类基金份额和C类基金份额的赎回费率一致,具体见下表; 持有期限(1) 费率 7∃ ≤N<30 365 ⊟ ≤ N<730 E 0.25% 有时间的计算,以该份额在登记机构的登记日开始计算。)

|金额=||赎回份额×||赎回当日基金份额净值 赎回费=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值×赎回费率 净赎回金额=赎回金额—赎回费 例:某投资人赎回本基金10.000份A类基金份额,持有期限为5个月,对应的赎回 70.50%,假设赎回当日本基金A类基金份额的基金份额净值是1.050元,则其可

总金额=10.000×1.050=10.500.00元 赎回费用=10.500.00×0.50%=52.50元 ■赎回金額=10.500,00-52.50=10.447.50元 即:某投资人赎回持有的10,000份本基金A类基金份额,持有期限为5个月,假设 当日本基金A类基金份额的基金份额争值是1.050元,则其可得到的净赎回金额

、A类基金份额的申购费用由投资人承担,不列入基金财产。C类基金份额不收 坟中晚费用。 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。在基金份额持有人赎回基 企份额小收取。对持续持有期少于30日的投资人,赎回费金额计入基金财产。对持续 存有期不少于30日但少于3个月的投资人,将不低于赎回费总额的578%计人基金财产。 对接续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人,将不低于赎回费总额的528%计人基金 验财产;对持续持有期长于6个月的投资人、应当将不低于赎回费总额的25%计人基金

/算) 6.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 药弊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。 7、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 则定基金促销计划,定期成不定期他开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按 经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 引费率,并进行公告。 上,开进行公告。 拒绝或暂停申购的情形

1、12:1930年的平明的1月形 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 1980日连 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。

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,或发生其他拥害现有基金份额特有人利益的情形。 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。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。 八、暂停晚回政延缓交付赎回款项的情形 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 顶,

项:
1.因不可抗力导致基金管理人可倡导接受投资人的赎回申请或建策支付赎回影项:
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单值。
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,基金管理人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从定的其他情形。
发生上述情形之一旦基金管理人灾宣暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人可监查台下。
发生上述情形之一旦基金管理人灾宣转停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应产当报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应是额支付,如暂时不能是额支付,应将可支付部分接单个账户申请量占申请总量的比例分赔赔赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上还第4项所还情形,按基金台间的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未发理部分予以撤销。在暂停赎回的情况得除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。九、巨额赎回的情况及处理方式

7.1三细映回的认定 1.巨额映回的认定 若本基金单个开放日内的基金份额争映回申请《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,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)今额赎回。基东全管理人认为有能力变化检查人的全额赎回由请时,按正常

(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

(1)全额映凹:当基金管理人认为支付投资人的全地吸凹中调印、按止常 赎回程序执行。 (2)都分延期赎回: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等值造成较大波动时, 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是赎回申 请总量的比例,确定当日至理的赎回的潮,对于未能晚间部分,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;选择取消赎回的。当日未获受理的形分赎回申请将被撤销。 证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该类 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,投资人未能应即密外作自动处理期赎回处理。 (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,可暂停接至基金的赎回申请,已经接受的赎回申请可以延缴支付赎回款项,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 当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮客、传真或者其他方 式在3个及用口通知基金份额转用人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登

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、哲停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告
1、发生上述哲停申购或赎回情况的、基金管理人应及时向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒介上刊登哲停公告。
2、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1个工作日各类基金份额的基金份额争值。
十一、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 管理八管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以収取一定的转换费,相关规则由基金管理人配申根用样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,十二、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是行业的人工。其特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性、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特有人持有的基金份额确调制的综合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两项,提供的相关资料、对于符合条件的非交易过户。可以是被决定的基金分额持有人特有的基金份额持有人特有的基金份额,则被给某人他人不要求,并将在金金企业机构规定的标准收费。十三、基金的转托管基金企业机构规定的标准收取转托管费。十三、基金的转托管基金份额存有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机何以按照规定的标准收取转托管费。十三、基金的转托管基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机何以按照规定的标准收取转托管费。十四、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另行规定。投资人在办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划的主持,其金价额的定线和概定的标准。

最低申购金额。
十五、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,以及登记机构以可,符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。
十六、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上户登记。基金管理人以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。
第九部分 基金的投资

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。创业板以及其他终中国证监会批准发行上市的股票)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,中小企业私募债,可转换资券)、资产支持证券,质押及买断式债券回购,银行存款及现金等)、行生工具(权证,股指财债,股票期权等)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)。 加计律处注册或监查的相关规定)。 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

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80%-95%,其中投资于消费主题相关行业股票的资产不低于非现金基金资产的80%: 权证投资占基金资产单值的比例为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%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

1、大类资产配置策略 1、大类资产配置策略
本基金持续跟踪法观经济面、政策面等重要指标、进行自上而下宏观分析,并有
机结合市场环境趋势分析。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要
求等因素、制定本基金资产的大类资产配置比例。本基金为股票型基金、长期来看整
体将积极配置于股票类资产、并根据市场环境动态。调整。
1)宏观经济面的主要指标、包括但不限于国民生产总值、居民消费价值指数、工业增加值、固定资产投资总量及增速、社会消费品零售总额及增长率、进出口额及增长率、发电量、PMI等主要宏观经济统计数据;
2)政策面的主要指标:包括但不限于货币政策、财政政策、资本市场相关的各项
政策、经济各领域中改革、转型推进等相关政策等;
3)市场术境趋势分析的主要指标。包括但不限于市场资金面趋势、市场估值水平、市场情绪、开户数、市场仓位水平等;
2、股票投资策略
(1)消费主题相关行业的界定

2.版京校页來哈 (1)消费主题相关行业的界定 本基金将消费主题划分为三类:必需消费、可选消费以及其他消费、

产基金特得员主题划分为二关:它需有员、可是有员以及共同有员。 必需消费指居民基本生活中必不可少的商品和服务,例如农林牧渔、食品饮料、 主物等。 可选消费指居民用于改善生活质量的商品和服务,例如餐饮旅游、纺织服装、家 可透消費指居民用丁収壽生活加運的同面がW版力,PJSAUTE LARKett、5075/08-28、9 用电器。商业贸易、信息服务、文化娱乐、汽车等。 其他消费指居民日常生活中直接或间接使用的其他商品或服务,这类商品或服 务拉动一系列与消费相关的产业发展。升级、对于拉动消费形成直接或间接作用。例 如消费电子、建筑装饰、消费轻工、交通运输、消费制造、消费金融服务、日用化工品

等。 消费主题股票池,按照申万行业分类口径,具体包含食品饮料、家用电器、农林牧 渔,纺织服装,医药生物,轻工制造、交通运输、公用事业、汽车、休闲服务、商业贸易、 电子、通信、传媒、建筑材料、建筑装饰、计算机、综合等18个申万一级行业,日用化学 产品等1个申万三级行业。

电子、通信、传媒、建筑材料、建筑装饰、计算机、综合等18个申万一级行业,日用化学产品等小中页三级行业、 未来随着政策或市场环境发生变化导致本基金对消费主题相关行业的界定范围 发生变动,本基金可调整对上述主题界定的标准,并在更新的招募说明中进行公 告。如未来由于行业分类标准体系术能及时反映公司主营业务或非主营业务中的潜 力核心业务的迁移、则本基金将在审慎研究的基础上根据公司真实状况将其纳入股 票库。如未来申万宏颜证券研究所不再发布行业分类标准、本基金将根据对消费主题 相关行业的界定。选择符合相应主题范畴的上价低于非现金基金资产的80%,本基金将根据对消费主题 相关行业的界定。选择符合相应主题范畴的上市公司股票进行投资。因上述原因使得 本基金持有的消费主题相关股票的比例低于非现金基金资产的80%,本基金将在二十 个工作日之内进行调整。 (2)行业配置策略 消费主题相关行业根据所提供的产品、服务类别不同,可划分为不同的细分子行 定性分析、深度询随所等方法、精选出估值水平较为台课、在所处于行业以及未来经济 发展趋势下具有较强的核心竞争力,且未来具备较好成长着力的优质公司,以分享企 业成长发展过程中带来的资产增值。 1)产业分析

1)产业分析 本基金重视对于各消费主题子行业的产业发展趋势的研究,综合考虑宏观经济 环境、国家产业发展政策、产业周期、产业格局、上下游供需情况、海内外状况与趋势、 技术发展趋势、社会需求、社会发展趋势等因素、力图把握较长周期内的行业轮动节 奏与未来趋势、筛选出具有较高成长潜力、未来空间较大的行业。

英马木和包牙,彻远山共有农间取饮商7.5木来已间收入的71业。
2)公司分析
本基金在产业分析的基础上,"自下而上"精选优质上市公司构建组合。本基金
为股票型基金,投资干消费主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。对所选的
行业和公司进行密切服除的方法来控制个股风险。
本基金将重点考察这些公司是否具有坚实的商业基础。良好的公司治理结构、优
秀的管理层、出色的管理水平、独特的盈利模式、良好的资产质量和财务状况、在行业
中具备较强的核心竞争力,具备较好的成长潜力,同时结合市盈增长比率(PEG)、市
盈率(P/E)、市净率(P/B)等一系列收置指标、判断估值是否相对合理。选择安全边
际相对较高的标的品种。择机构建组合并动态调整,以获得相对较长的收益为主。
3. 债券投资策略

3、债券投资策略 本基金将采取人期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略, 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。

本基金特限据对利率走势,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) 突隅贮厚 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

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-定期限下的债券品种的过程。 4、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

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券未來观显流和9聚學,讓與12以以20人之內112以 6.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。 版》,分为30点以注:操成红门1次分 7、股票期权投资策略 本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。 本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好,交易活跃的期权合约进行投资。 本基金将基于对证券市场的预判,并结合股指期权定价模型,选择估值合理的期权合

基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求 金型自在八万平5時中與原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作。确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。 时30A082。 8、中小企业私募债投资策略 具有高风险和商收益的显著特点。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

少于UTULX 实施、IP WITT 和以及以广坝 重导 信息, 1位 异私 券 债 寿 安 行 人 的 走 约 举 纷 损失 率; ② 考察 债 券 发 行 人 的 增 信 措 施 , 如 担 保 , 抵 押 、 银 行 授 信 、 偿 债 基 金 、 有 序 偿 (安排等: (多综合上述分析结果、确定信用利差的合理水平、利用市场的相对失衡、选择具

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80%-95%,其中投资于消费主题相关 处理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)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,本基金持有 观金或者到则日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;
(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

; (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)本基金管理从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人权证的总金额,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(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 停值的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

(1) 本基金持有的同一信同。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,不得超过该资产支持证券和模的10%;
(12) 本基金证投资于信用级别评级为BBB以上含BBB的资产支持证券,在基金的投资于信用级别评级为BBB以上含BBB的资产支持证券期间,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个月内下以全部卖出;
(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规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等值的40%。本基金在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等值的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)本基金者参与限指期货交易,需遵守下列投资比例限制;
1) 本基金在任何交易日日终,持有的买人股指期货合约价值,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

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%。
4)本基金在任何交易日日终,持有的买人股指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、买人返售金融资产(不含贵押式回购)等。
5)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)应当符合基金合同关于股票股份的的有关约定;
(17)本基金否参与股票期收交易、需进守下列投资比例限制:
1)本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%。

10 本基金开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价 3)本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%,其中,合约面值

3)本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%,其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;
(18)本基金特有单只中小企业私募债,其市值不得超过基金资产净值的20%;
本基金特有自免部中小企业私募债总市值不得超过基金资产净值的20%;
(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,期货市场级动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素效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。但中国监监会规定的种界情形整件。法律让规户有规定的,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2集时后,则本基金投资不用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)乘销证券;

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、基金杆管人出资;
(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 基金杆管人及其挖股股东,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承销期内承销的证券,或者从事其他也大关联交易的,应当各个各基金的投资目标和投资路。遵循基金份额持有人和技术优先规则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和时序估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必项事先得到基金杆管人的同意,并按法律法规可以被需。重大关策交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之一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调整上宏限制,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上宏限制,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上的规制,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。
五投资决策依据包括:国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定;宏观经济投展趋势,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 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

一、投资目标 本基金主要投资于消费主题相关的具有持续增长潜力的优质上市公司,在有效 投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准 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本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

条和投资运行流程: (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,基金投资投权方案等重大投资决策事项进行深入分析,讨论并 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

(4) 中久入之。 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 一、4年入4年存缔绩效评估,并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略,

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 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 本基金的业绩比较基准为:中证内地消费主题指数收益率×85%+中证综合债券

本基金的业项汇轮基准列:中亚约亚月四工程到基本40-20-14数收益率×15%。 中亚内地消费主题指数由中证指数有限公司编制,成份股包括中证800 指数样本股中属于消费主题行业的上市公司,可以较好地反映沪深两市消费相关领域上市公司股票的整体表现;中证综合债券指数选样债券信用类别覆盖全面,期限核成宽泛。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,合理地反达14年64位237%上经上线上 映本基金的风险收益特征。 如果今后法律法规发生变化,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法 权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基 金托管人同意,并限中国证金含案。而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人 应在调整实施前个工作日在指定媒介上予以公告。

本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金

中基金为财宗至基金,共成别代证及顶别风险小干间和混合型基金,属于高预期收益风险水平的投资品种。 八、基金管理人代表基金行使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的 金份额持有人的利益; 4、1月刊] 整定则广的女全与增值; 3、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。

第十部分 基金的财产

一、基金資产总值 基金資产企值是捐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。

二、基金软产中国是指基金资产总值或去基金负债后的价值。
三、基金财产的账户
基金针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
本基金财产的公于基金管理人、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,并且其自身的法律费压、其债权人不得对本基金财产行使请求承结、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、基金托管人人因依法解款、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。不得相互抵销。

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、股票期权合约、债券和银行存款本息、

)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 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)交易所发行实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种

种当日的估值全价减去估值全价中所多的训质努力证值日第三分汇值例构度供购和应加 种当日的估值全价减去估值全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、按最近交易日第三方估值 机构握供的相应品种当日的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的 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,按时本格值。

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,接成本估值。
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,转键股,起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,接成本估值;
(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。

术确定公允价值。 4.中小企业私募债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。 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.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 量。 (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

10.相关法律法规以及监管部 1 有强而观论中以,仍实不必定。 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, 如经相关多方在平等基础上充分计论后,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 生命份额海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

口、店值程序 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位四舍五人。国家另有规定的,从其规定。 本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。