Disclosure 信息技術 zqsb@stcn.com (0755)83501750

(上接B13版) 曹名长先生,中欧红利优享灵活配置混合型证券投资基金拟任基金经理。中国籍,上海财经大学数量经济学硕士。20年以上证券从业经验,具有基金从业资格。历任君安证券公司研究所研究员,闽发证券上海研发中心研究员,红塔证券资产管理总部投资经理。店瑞信托有限责任公司信托经理,新华基金管理公司总经理助理、基金经理。2015年6月加入中欧基金管理有限公司,现任策略组负责人,中欧价值安观混合型

证券投资基金基金经理(自2015年11月20日起至今)、中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年11月20日起至今)、中欧丰弘沪港深灵活配置混合 证券投资基金基金经理(目2015年11月20日起至今),中欧南方价值灵洁配置混合型证券投资基金基金经理(目2015年11月20日起至今),中欧南河湾港深灵洁配置混合型证券投资基金基金经理(目2016年11月3日起至今),中欧南北河洋港深灵洁配置混合型证券投资基金(目2017年11月日起至今),中欧南龙河流活配置混合型证券投资基金(目2017年11月3日起至今),中欧南龙河流活配置混合型定券投资基金(目2017年11月3日起至今),中域成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金(自2017年11月30日起至今)。中博森先生,中欧红利优享灵活配置混合型证券投资基金银任基金经理。中国籍美国部参大学化学工程专业硕士、4年以上证券从业经验,具有基金从业资格。历户中信证券高级游疗员。2016年8月加入中欧基金管理有限公司"曾任研究员"加任中欧丰富管理人投资决策系员会设务管理的最高投资决策机构,由总经理刘建平规治产业资金管理人投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构,由总经理刘建平规治、但是理规体副总经理兼编解组负责人与城市、信用评估部负责人系明、策略组负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、黄华、周玉维、赵国英、曲径、曹名长、王健、王培、吴鹏飞组成、其中经经理刘建平任投资决策委员会主席。6、上述人员之同均不存在近亲属关系。——基金管理人的职资。6、上述人员之同均不存在近亲属关系。——基金管理人的职责。1、依法繁集资金。为理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售,申询、赎回和登记事宜;2、办理基金备条条件类。

5. 讲行基金会计核算并编制基金财务会计报告:

5.近17基金於1核與升編制基金财务会扩报告; 6.编制季度、半年度和年度基金报告; 7.计算并2合基金资产净值。确定基金份额申购、赎回价格; 8.办理与基金的资管理业务活动有关的信息披露事项; 9.按照规定召集基金份额持有人大会; 10.保存基金份额持有人大会; 11.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法:

11、以基金管理人名义,代表基金份额将有人不归血门及水产经过, 律行为; 12、法律、行政法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。 四、基金管理人的承诺 1.基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健 全内部控制制度、采取有效措施、防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。 2.基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制 制度、采取有效措施。防止,可行为的发生; (1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资; (2)不公平地对特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;

(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)向基金价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)泄露段职务便利获取的未公开信息,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)玩您职守。不按照规定履行职责; (8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。 3.基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生。

1. 防止违反基金合同行为的发生。 4. 基金管理人承找加强人员管理、强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关 法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责。 5. 基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。 6. 基金经理承诺

放照有关法律、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、受雇人或任何第三人牟取利益;

(2)不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人牟取利益。 (3)不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定、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。成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.内部控制的原则 (1)健全性原则、内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员、并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。 (2)有效性原则,通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效性原则,通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效性质。

制度的有效执行。
(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司基金资产自有资产,其他资产的运作应当分离。
(4) 相互制约原则。公司运和解记和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理力法降低运作成本,提高经济效益以及合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。
2.内隔影射的体系结构。
公司的内部控制体系结构是一个分工明确。相互牵制的组织结构,各个业务部门负责本部门的风险管理情和监控。监察稽核部负责监察公司的风险管理情施的执行。具体而言。包括如于组成部分。
(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任。

(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)仅以伏宋安以公、以公司。 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 (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法,会规进行。

·规进行。 、内部控制的措施 3、1916年前3月17個 (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

工工品,从AQUU-7以及此時期的授权分上及工作职责,并编制详细的岗位说明书和业务流程。建立重要先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制衡。

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制衡。
(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。重大业务的投权应采取书面形式,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。建立外等的对价,是大量的岗位分离。重立外等的岗位分离。建立外等的岗位分离。重立外有的过近行物理隔离,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象。
(4)建立完善的资产分离制度,基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作。分别核算。
(5)建立完善的资产分离制度。基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作。分别核算。
(5)建立严密有效的风险管理系统。
风险管理系统包括两方面,是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标为核体系以及业务人员道德风险妨范体系等;二是公司灵活有效的应急,应支措标为核体系以及业务人员道德风险妨范体系等;二是公司灵活有效的应急,应支措施和低处理机制。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,及时均范和化解风险。(6)建立宗整的信息资料保全系统。真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务,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、各种信息资料效搜集实完整。
4.基金管理人所为证的和股险管理制度的声明书基金管理人所为证的和股险管理的政策结果实影整。
4.基金管理人所知识和风险管理制的被解表,维持其有效性以及有效执行内部控制制度,是基金管理人所知知风险管理制的被解表,维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人所可能控制制度的重相,不可能控制制度,是基金管理人所可能控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人的情况 (一)基金托管人的基本情况 名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行") 设立日期:1987年4月8日

托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号 电话:0/33-6317700 生責:0755-83195201

资产托管部信息披露负责人:张燕 (二)发展概况

主民元生、本行副行於、贞印银行李蚆士、高级经济卯。1991年至1995年,往中国 林技国际信托投资公司工作。1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展览 路支疗、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制都总经理。2000年10 月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长、2006年6月,至2026年6月,任北京分行 党泰书记、副行长(生持工作),2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党泰书记记 2012年6月至2013年11月,任招商银行总行行长助理北京分行行长、党泰书记记3 年11月至2014年12月,任招商银行总行行长助理。2015年1月起担任本行副行长、2016 年11月至2014年12月,任招商银行总行行长助理。2015年1月起担任本行副行长、2016

2012年6月至2013年11月,让招商银行总行行长助理兼北京分行行代、完委中记;2013年11月至建任本行董市长、2016年11月至建任本行董市长、2016年11月起兼任本行董市长、2016年11月起兼任本行董市长、2016年11月起兼任本行董市长、2016年11月起兼任本行董市长、2016年11月起兼任本行董市长、2016年11月起兼任本行董中、2016年11月20日,1月有基金托管人高级管理人员任职资格。先后使职于中国农业银行景次汇省分行。华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产任管部经理。高级经理、总经理助理等职、是国内首家推出的网上托管银行的主要设计,开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新,服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(四)基金托管业务经营情况 截至2017年9月30日. 括商银行股份有限公司累计托管316只开放式基金。 二、基金托管人的内部控制制度 (一)内部控制目标 确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营

观花运车的经营思想和经营理念。形成科学合理的决策机制、执行机制和监管机制、 防范和化解经营风险。确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整、建立有利于 查错的弊、报金漏洞、消除隐患、保证业务免稳健运行的风险控制制度、确保托管业务信息真实、准确、完整、及时、确保外控处机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不

断完善。
(二)内部控制组织结构
(二)内部控制组织结构
招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系;
—级风险防范是在总行层面对风险进行领的和控制。
—级防范是总行资产托管部设立静能监察室、负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下,独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门,对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督、及时发现内部控制缺陷。提出整次方案。跟踪密改情况。
—级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时,必须遵循内控制衡原则,监督经验的定土至市专业规定。经知论的证书工程可以。 督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

、全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位, 2. 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险,托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点,应当体现"内控优先"的要

求。
3.独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门、稽核监察室应保特高度的独立性和权威性,负责对部门内部控制工作进行评价和检查。
4.有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制

约束的权利,内部控制标子的的一种。 约束的权利,内部控制标子在的问题应当能够得到反射为反馈和纠正。 方适应性原则,内部控制标子在的问题应当能够得到反射为反馈和纠正,并能随着托管业 务经营场路。经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外

部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理会等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。 相应即修1 和完善。 6、防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室,应当在制度上和人员上适当分离,办公网和业务网分离,部门业务网和全行业务网分离,以达到风险防范的目的。 7、重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高

表现现。 8、制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程 8.制阀日原则引用近即则至3月11日 等方面形成相互制约,相互制约,相互监督,同时兼顺远营效率。 9.成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益,以适当的 成本实现有效控制。

定实現有效控制。
(四)內部控制措施
1、完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操度和是人会计核算,就位管理、档案股局和等。另外规章制度、从资产托管业务操作流程。会计核算,就位管理、档案里、保密管理和信息管理等方面、保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。探德托管资产安全和托营业务正常运作、切实维护托管业务各当事人的利益。避免营业务伦制事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理、招商银、宏制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》,并建立了灾难备份中心、土地、金融标签和贴土位式市经公山市、油产各价、确保灾难发生的、托管业、基础标准 业务数据能及时在灾难备份中心进行备份,确保灾难发生时,托管业务能迅速恢

外别、八個民意。 7人間既然、无证旨建、空報及建等 新功元經的採下於底。 有双地控制 业务运作过程中的风险。 3、业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异始同步攻各、周时、每日实时对托管业务数据标进行备份,托管业务数据每日进行备份,所有的业务信息观经过严格的授权才能进行访问。 4、客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料、租局最计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批、并做好调用登记。

开敞叶调用登记。 5、信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机 房24小时值班并设置门禁管理,电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行 业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护等,保证信息技术系统的安全。 6、人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制,有效的进行人力资

6、人力資訊企制。相同報行政学行管面型建建、民中中於並又允內良」上等川 随利制、加速人力资源控制。 (五)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 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)等有关证券法律法期的规定及基金品自约约定,对基金投资范围,投资对象、基 金投融设化的,基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选 埃奇尔银行,基金资产净值计算,基金份额净值计算,基金费用开支及收入确定、基金 收益分配。相关信息投源、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、 合规性进行监督和核查。 基金长管《大河上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反 《基金法》、《运作功法》,基金合同,托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律 法期的规定。应及时以于面形式前知监查管理人的投资指令常效,整改的时限应符合法规允 许的投资比例调整期限。基金管理人放到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金 经工作金人及时业产。在规定时间内,基金社管人有权随时对通知事项进行复查。 看促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠 正的,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同 和有关法律法规规定。应当拒绝执行。立即通知基金管理从限期放正。如基金管理人 基金全行人及规基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有各分都经济的数。基金社管人应即检查的主任人。 基金生活人发现基金管理人有的的主反《基金法》、《运作办法》、基金合同和任管协议的要求者和创度等。 基金长管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告的事项,基金管理人应积 基金全务执行核查、对基金社管人处的的市损还,基金管理人应在规定时间内答复 并改正,或就基金社管人的最全社管人是创始的市场提示,基金管理人应在规定时间内答复 并改正,或就基金社管人的规定会社等基金监督报告的事项,基金管理人应积 基金管理人规划报验书和制证等。 基金任管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监查。同时,通知 基金管理人限期纠正,并将纠正结果根告中国证监查。基金管理人正可提出。 基金管理人限期纠正,并将纠正结果根告中国证监查。是金管理人正可提出,拒绝、 显备管理人限期纠正,并将纠正结果根告中国证监查。是金托管人应报告中国证监查。 是金管理人和报告证券上的不成正的,基金社任管人应报告中国证法 金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证验金,是金托管人应报告中国证监查。 第二部分 相关服务机构

第五部分 相关服务机构 、基金份额发售机构

(一)直销机的 3000 (一)直销机的 3000 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:上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7层 法定代表人:窦玉明 联系人:表维

ミ服执线・021-68609700、400-700-9700(免长途话费) M#: www.zofund.com

[9]近:www.zotund.com (二)其他销售机构 名称:国都证券股份有限公司 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 注定代表人:王少华

股热线:400-818-8118

各版系表述的 例批: www.guodu.com 基金管理人可以根据销壳变化、增加或者减少销售机构,并另行公告。销售机构 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 验销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

(新音成为代]]] (新音成为代]] (新音成为代] (新音成为代]] (新音成为代] (新音成为代) (新音成为代) (新音成为代) (新音成为代) (新音成为代) (新音成为代) (新音成为代) (新音成为代) (新音成为代)

至理:刘建平 立日期:2006年7月19日 迁-021-68609600

联系人: 杨毅 三、出具法律意见书的律师事务所 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58 经办律师, 黎明, 肚苗 包括:021-31358666 核真:021-31358600

联系人、陆奇 四、审计基金财产的会计师事务所 名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室 办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室 执行事务合伙人:毛鞍宁 电话:610-85183000 传真:010-85188298 辟玄人, 冷酷

联系人:徐艳 经办会计师:徐艳、印艳萍 第六部分 基金的募集

· 基金辦果的环旗 抹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 非法规的有关规定,经201X年XX月XX日中国证监会证监许可[201X]XXXX号

他选律法规的有关规定, 经201X年XX月XJ 文准予募集。 二、基金类别与运作方式 本基金的类别为混合型证券投资基金。 本基金的运作方式为契约型, 开放式。 三、基金存续期限

二、基金仔等种PK不定期。 不定期。四、基金份额的类别 本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时\的政认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为本类基金份额,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,称为企类基金份额,在是公司工作,由于基金费用的不同,本基本基金份额和C类基金份额为别设置代码。由于基金费用的不同,本基金4本生金份额和C类基金份额符分别计算基金份额净值,计算公式为:

本基金条基金份额时几类基金份额对别设直代等。由于基金资用的小即、平整金类基金份额时几类基金份额特分别计算基金份额单值,计算公式为; 计算日某类基金份额单值。该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日 货售处的该类别基金份额总数。 投资者可自行选择认购。申购的基金份额等别。 在不违反法律法规则定目对自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

则的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等,而 三需召开基金份额持有人大会。调整实施前基金管理人需及时公告,并报中国证监会

五、券来力式 施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,各销售机构的具体名单见基金价额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实 接收到认购申请。认购的确认以否证机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额 的确认情况、投资人应及时查询并妥善行使合法权利。否则、由此产生的投资人任何 损失由投资人自行承担。

自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 。 的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少干人民币2亿元。

*来內家 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

本基金份额初始面值为人民币1.00元,按初始面值发售。

1、本基金份额的跨田值为人民市1.00元, 在外股田值度售。
2、认购费用
本基金A类基金价额收取认购费用。C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额在认购市收取认购费,认购费率额认购金额的增加而递减。本基金对通过直销中心认购A类基金价额的水老金客户与非养老金客户实施差别的认购费率。
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外充养老基金等,具体包括。
(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)企业年金单一计划以及集合计划。
(5)企业年金单一计划以及集合计划。
(5)企业年金等金产品。
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能由为公告将建筑人养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户销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下表。

人购金额(M))万元≤M<500万元

(中)、购金额一以购金额一以购金额一以购金额一以购货件, 认购价额(中认购金额十以购和。)/1.00元 认购价额的计算保留到小数点后2位、小数点2位以后的部分四舍五人,由此误差 26的收益或损失由基金财产养担。 例:莱投资人(非养老金客户)在认购期内投资100,000元认购本基金A类基金价 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 50.本基金份额数计算如下: (本认购金额—100,000/(1+1.20%)=98.814.23元 认购费用—100,000~98.814.23=1,185.77元 (认购金额—100,000/(8+12.39-1).1/10=98.814.73份

认购费用 = 100,000 - 98,814 23=1,185.77元 认购的额: (98,814 23+25 50) / 1,00=98,843.73份 即:投资人(非养老金客户)投资100,000元认购本基金A类基金份额,在认购期 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 类基金份额98,843.73份。 (2) 若投资者选择认购(类基金份额,则认购份额的计算公式为: 1,100公额。(1,100公额)

(27) 存仅效省还库以购、头金亚沙喇、则以购为潮的口草公式为: 认购价额(认购金额+1人顺利息)1,00元 认购价额的计算保留到小数点后2位、小数点2位以后的部分四舍五人,由此误差 住的收益或损失由基金财产赛组。 例:莱投资人在认购期投资100,000元认购本基金C类基金份额,假设这100,000元 ,顺期间产生的利息为30.00元,则其可得到的C类基金份额数计算如下: 认购份额—100,000+3000/11,00=100,030.00份 即:投资人投资100,000元认购本基金C类基金份额,在认购期结束时,假设这100, 元在认购期间产生的利息为30.00元,投资人账户登记有本基金C类基金份额100,00份。

、 、投资人对本基金的认购 、认购时间安排 上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。 及资人认购本基金应提交的文件和办理的手续 资人认购本基金应提交的文件和办理的手续见基金份额发售公告。

文於人///時學奉臺並/經天中/以上中/#以內出月了不次是的進度。 表,以順的方式及确认 投资人/,以順时、需接對自相构规定的方式全额實數。 投资人在享集期內可多次、1,與基金份額,认順申请一经受理,不得撤销。 投资人在下日规定时间內提交的认與申请,应于于+2日(包括该日)后及时在原 构点或通过基金管理人的客户服务中心查询认與申请是否被成功实理 投资人应于基金合同生效后及时在原申请阅点或通过基金管理人的客户服务中

本基金其他销售机构的销售网点每个账户单笔最低认购金额为10元(含认购费,下同);直销机构每个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

金音堆水 以次未取仁的附从守方及对该及较大的从购等间或过了限制。鉴查量堆入核 变某笔或者某些认顺申请有可能导致投资者变相规辩前述50%比例要求的。基金管理 人有权拒绝该等全都或者都分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效 后登记机协的确认为准。 十一、募集资金利息的处理 有效认购款应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。

不得动用。

第七部分 基金合同的生效

一基金备案的条件 基本百间的比效 基本百间的比较 本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日內聘请法定验贷机构验资。自收到验资报告之日起10日內,向中国证监会为理基金备案手续,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书面确认之时起,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部人文件的次日对基金合同生效。否则基金合同不生效。基金管理人在收到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。二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式如果募集的资金存人专门账户,在基金募集有为结束前,任何人不得动用。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,清迎基金备案条件,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;

期存款利息;
3. 如基金募集失败,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目承担。
三. 基金存缐期内的基金份额持有人数量和资产规模。
基金合存缐期内的基金份额持有人数量和资产规模,是全60年度,1000万元情形的。基金管理人应当在定期接由中了以披露,连续60个工作日出规则流化情形的,基金管理人应当由企业报告并提出解决方案。如转换运作自己规则流化情形的,基金管理人应当由中国证监会报告并提出解决方案。如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。 男人部分 基金份额的中购与赎回 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 相关公告中列明,基金管理人可根据指码针对某类份额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 的其他方式功理基金份额的申购与赎回。

公告。基金授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.开放日及开放日页时间 1.开放日及开放日及时间 1.开放日及开放日及时间 1.开放日及开放日场中的交易时间,基本基金参与潜股通交易且该工作日为 1. 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、深圳证券交易厅的工常交易日的交易时间,若本基金参与潜股通交易且该工作日为 1. 接收业务,具体以届时提前发布的公告为准。但基金管理人根据法律法规,中国证监 5. 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或更或其他特情的观点生产,是不是一个人工作。 2. 申购,赎回开始日及开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施目前依据《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 1. 在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 1. 在每时用开始公告中规定。基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在晚间开始公告中规定。 在每晚日开始公告中规定。 1. 在每晚日,两个人不是在金台间分定之外的日期报时间提出申购,赎回时的保照 1. "未知价"原则,即申购,赎回的格为下一开放日该类基金份额申购,赎回的价格。 2. "金额申购,则即申购,赎回的价格。1. 非购与赎回的原则 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金管理人规定的时间以内撤销。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。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. 集回 1. 是一位,1. 是一位,

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《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。 四、申购与规则的程序 1、申购有赎回的申请方式 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 版中赎回的申请。

另有约定的除外。
2.基金份鄉特有人在销售机构赎回时,每次对本基金的赎回申请不得账于分选金份额持有人在销售机构赎回时,每次对本基金的赎回申请不得账于分选金份额。若某笔份额减少类业务导致单个基金账户的基金份额余额不足5份的,登记机场有权对该基金份额持有人持有的基金份额检查部赎回处理(份额减少类业务指赎回 转换转记,非交易过户等业务,具体种类以相关业务规则为准)。
3.当接受申购申请对存量基金份额特有人利益被政潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大潮申购、暂磨基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

即中则、哲学基金中则等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益具体请参见相关公告。

4.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等数量限制。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授中国证法会备案。
六、申贩邦赎回的价格、费用及其用途。
1.本基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四会五人,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日办公告。遇特济情况。经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。本基金A类基金份额和C类基金份额沟计算基金份额净值。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。
2.申购的有效份额分净申购金额除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含五人方法、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。

(1)中咽斑用 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。 申购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非养老金客户 实施差别的申购费基金A类基金份额的养老金客户与非养老金客户

头施差别的中购资率。 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:

收益於成的外允养老卷並等。與學也的:
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)企业年金草一计划以及集合计划;
4)企业年金草车关柱的特定客户资产管理计划;
5)企业年金莽老金产品。
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。非养老金客户销除养老金客户价的其他投资者。
运马生人参班日人的首础的心。由版本基金各基金价额的养老金客户申购费率见 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)		申购费率	
M<100万元		0.15%	
100万元≤M<500万元		0.10%	
M≥500万元		每笔1000元	
非养老金客户申购本基金A类基金份额的申购费率见下表:			
申购金額(M)	申购费率		
M<100万元	1.50%		
100万元≤M<500万元	1.00%		
M≥500万元	每笔1000元		

(2)申购份额的计算 当申购货和适用比例费率时,申购份额的计算方法如下: 当申购费用自即金额(1+申购费率) 申购费用申购金额(1+申购费率) 申购货用申购金额(4申购金额 申购货制产的金额(1+申购金额) 申购份额=净申购金额(4申购金额 申购货用与固定金额时,申购份额的计算方法如下: 申购费用与固定金额 净申购费用更定金额一申购费用 即必数率。由收金额一申购费用

1947年99並約7年99並約7年99以7日 申购份額一章申购金額7年购当日A类基金份额的基金份额争值 例,某投资人(非养老金客户)投资100,000元申购本基金A类基金份额,其对应 申购费率为1.50%。假设申购当日本基金A类基金份额的基金份额争值为1.0000元, 争申购金额=100,000/(1+1.50%)=98,522.17元

申购费用=100,000-98,522.17=1,477.83元 申购价额=98,522.17(1.0000=98,522.17份) 即,投资人(非养老金条户)投资100,000元申购本基金A类基金份额,假设申购 日本基金A类基金份额的基金份额争值为1.0000元,则其可得到本基金A类基金份

8.522.17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;
申购份额。申购金额/申购当日C类基金份额的基金份额种值
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
企份额的基金份额种值进入10000元,则可得到的申购份额为;
申购份额=100.0007.10000=100.000.00份

申賜財額=180,000/1,000=100,000.00份 即:投資人投資100,000元申购本基金C类基金份额,假设申购当日本基金C类基金份額的基金份額申值为1,0000元,则其可得到本基金C类基金份額100,000.00份。 3.赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用,提回金额单位为元。上述计算结果均按四金五人方法,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。 (1)赎回费用 (1)赎回费用 1)对于本基金A类基金份额,赎回费率见下表

30∃≤N<365 0.50% 记机构的登记日开始计算。 2)对于本基金C类基金份额,赎回费率见下表

(注:赎回份额持有时间的计算,以该份额在登记机构的登记日开始计算) (2)赎回金额的计算 赎回金额—赎回份额×赎回当日该类基金份额争值

持有期限(N)

族巴並和一族巴拉爾(* 冬巴ヨコ以來悉並の66年16 膜田費用=赎回金額 - 製田費等 净赎回金額-「赎回金額。」與田費用 均,某投资人赎回本基金10,000份A类基金份額,持有期限为150日,对应的赎回 为0.50%。假设赎回本当日本基金A类基金份額的基金份額净值是1.0500元,则其可

9的淨獎回金额为: 獎回查第—10,000×1.0500=10,500.00元 獎回费用=10,500.00×0.50%=52,50元 淨獎回金額=10,500.00~52,50=10,447,50元 則:某投资人獎回持有的10,000份本基金入芝基金份额,持有期限为150日.假设 到当日本基金入类基金份额的基金份额等值是1.0500元,则其可得到的净赎回金额 /У10,44/.50元。 4.A类基金份额的申购费用由投资人承担,不列人基金财产。C类基金份额不收 取申购费用。

取申购费用。

取申购费用由赎回基金份额的基金份额特有人承担,在基金份额特有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30日的投资人,赎回费全额计入基金财产,对持续持有期长于30日(含)但少于3个月的投资人,源户保护,第6日使之额的75%计入基金财产,对持续持有期长于5个月6人资产6个月的投资人,然不低于赎回费应额的50%计入基金财产,对持续持有期长于5个月(含)的投资人、应当将不低于赎回费应额的50%计入基金财产,共归人基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。(注:1个月以30日计算)在基金局面约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于66一级全额收费方式、连通口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66的费率或收费方式、连通口以存用模型的使用分配的费率或收费方式,并最近一个600克等或收费方式、连通时依据代息息被露分法划的有关规定在销定媒介上公告。7、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制、以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循用关键律法规以及监管部门、自律规则的规定。

则的规定。 8、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,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

七、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。当前一估值日基金资产等值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场 价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确 认后,基金管理人应当暂停接受基金申申申请。 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 空海值。

5.4底分别页义勿州义勿时间非正常停仰,寻戏盛壶旨理人无法以异当口盛壶页 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。

有人利益时。

5.基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%。或者有可能导致投资者变相规趣前述50%比例要求的情形的。
6.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,或发生其他描雪现有基金份额持有人利益的情形。
7.基金管理人基金针管系统进步第运行。
第.基金管记系统或基金会计系统无进户第运行。
第.申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日单单单单的全量,提到企

8.申请超过基金管理人设定的基金总规模,单日净申购比例上限、单一投资者里 日或单笔申购企额上限的。 9.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1,23.6.7.刘贾哲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 请被部分或全部拒绝,被拒绝的申购款项率银还给投资人。在暂停申购的情况消除 时,基金管理人应及时按单职收业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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 项;

项; 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 人的赎回申请或延援支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值son以上的资产出现 无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经 与基金性管人均商确认后,基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。 3.证券/确货交易所交易时间非正常停停,市实起金管理人无法计算当日基金资

连近外朔瓜文列尔文列训码于正布评训、寻太整金首建入无法计算与日整金页等值。 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,基金管理可暂停接受投资人的赎回申请。 6. 法律法规则定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述情形之一旦基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时、基金管 大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 不能足额支付,可能期支付。若出现上述第4项所法情形、按基金合同的有关条款处 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 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。 九. 巨额赎回的情形及处理方式 1. 巨额赎回的认定

九上额赎回的认定 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练申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后 的余额,超过前一工作目的基金总份额的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。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 健回解存标行。

(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 獎回程序执行。
(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工作日基金总份额的10%的前据下,可对 其金统理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的10%的前据下,可对 其余赎回申请延期办理、对于当目的赎回申请。应当按单个账户赎回申请量上赎回申请的司人选择处期的回或放补偿应可。选择松期赎回的、将日对转入下一个开放日缴回申请 赎回。直到全部赎回为止;选择放消赎回的。选择松期赎回的,将日对转入下一个开放日继续 赎回。直到全部赎回为止;选择放消赎回的。选择松期赎回的,为日对转入下一个开放日继续 赎回,直到全部赎回为止;选择放消赎回的。选择松期赎回的,此一次投资人在提交 赎回申请时中,并放日赎回应查额,以此类准。直到全部赎回为止。如投资人在提交 赎回申请与下一开放日则应查额,以此类准。直到全部赎回为止。如投资人在提交 建期的赎回申请与不断日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有 必要,可管停接受基金的赎回申请。上经检密的赎回申请可处理。 (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,可管停接受基金的赎回申请人已经接受的赎回申请可处理。 (4)若是会发生巨额赎回,还是符公告。 (4)若是会发生更剩赎回。在出现单个基金份额待有人超过基金总份额0%的赎 同申请(广新赎回申请人》)情形下,基金管理人应当对关额赎回申请人的赎回申请 有证当期全部所认,则基金管理人在当日在经验,如小额赎回申请人的赎回申请 在当期全部所述,则基金管理人在当日在经验,如小额赎回申请人的赎回申请 在当期全部所述,则基金管理人在当日经验,如小额赎回申请人的赎回申请 前还的时报下,在仍事经受赎回申请,必须赎回申请。(多小额赎回申请人的赎回申请 前还当日本被全部所认,则对全部未确认的赎回申请(含小额赎回申请人的赎回申请 前定当日未被金部所述,则对全部未确认的赎回申请(含小额赎回申请人的赎回申请

5. 巨额原回的公告 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,传真或者招募说 持规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有实处理方法,同时 旨定媒介上刊签公告。 十、哲停申阅或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生力量等地域或使回的公司中组制7)版平均级域也的公司 1、发生力上整督等地域或模回情况的,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签暂停公告。 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等值。

□ ... 元 ... □ ..

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 记机构认可,符合法律法规的其他情态下的冻结与解冻。 基金份额被疾结的,按索结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与 收益分配,法律法规或监管机构另有规定的除外。

收益分配,法律法规则监管机场与有观处中2007年 十六、基金份额的转让 十六、基金份额的转让 中国证益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签记机构办理基 金份额的过户登记。基金管理人机受理基金份额转让的申请并由签记机构办理基 金份额的过户登记。基金管理人机受理基金份额转让业务的、将最前公告,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

一、投资目标 在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业

二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板,创业板以及其 他经中国证监会批准发行上市的股票)、港股通机制下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"港股通东的股票")、国债,地方放府债,金融 债,企业债,公司债,公开发行的次级债,中小企业私募债,可转换债券,可交换债券, 分离交易可转债的纯债部分,央行票据,中期票据,短期融资券(含租短期融资券)。 经营业经产业,此类的,经存款,和全人在工具,仅证,股本股股条。因 支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、行生工具(权证、股指期货、国货、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)。 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0%-95%(投资于港股通标的股票的比例 股票资产的0-50%),其中不低于非现金基金资产的80%投资于红利股、权证投资占 口放实现。1909、1945年1748。1749、基金资产等值的比例为996-396。每个交易目目终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后、现金(不包括结算备付金、存出保证金。应收申购款)。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单值的5%。股指期行、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的 以1。 取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 程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

6当程序局,刊以调整工程以及UBITION。 三、投资策略 1、大类资产配置策略 本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置,强调通过自 上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行削瞻性的决策。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

2.股票投資車額 (1)红用股的筛选 本基金将综合考察上市公司历史分红记录、股息率、分红预期等指标、来对A股和 港股通投资标的进行筛选。具体选股标准包括满足以下一项或多项标准的上市公司, 即符合本基金对"红和股"的选股标准。 1)过去3年内至少有2次分红、若公司上市时间不足3年的,至少有1次分红(包括 10.48年时间20.1915年的。 1.02之子,12.0 现金股利和股票股利); 2.)过去1年的股息率高于市场平均水平且不低于同期一年期定期存款的收益率; 3.)过去1年的分红率高于市场平均水平。

(2)投资价值分析。 (2)投资价值分析。 本基金将对"红利股"进行进一步的投资价值分析,精选价值被低估的优质个 股、包括。对公司的历史沿革,则多状况。盈利能力及前景、资产及权益价值等进行全 面深入的研究分析。反复推敲测算公司的合理价值,自上而下判断公司所在行业在长 周期中阶级的位置以是合对公司合理价值的评估,注重安全边际。连接能少投资等 续创造价值的股票;同时辅以合理价值发现和被市场认同的触发因素判断,提高选股

本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略,力求获取高于业绩比较基准的

6、资产支持证券投资策略 6、致广义行业序投资项格 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 产支持证券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。 一个公企业系票债投资策略

7.中小企业私券研投资率格 与传统的信用债券相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍 具有高风险和高收益的显著特点。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 8. KULICK 近來哈 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 材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 个券的流动性,谨慎进行投资。

9. 股票期权投资资格 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。 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。 基金将在有效控制风险的前提,并结合股票期权定价模型,选择估值合理的期权合 到。 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。
10. 可转换债券及可交换债券投资策略
10. 可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值。本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估。选择具有较高投资价值的可转换债券,可交换债券进行投资。此外,本基金可根据新发可转债和可交换债券新券的申购。
四. 投资限制

票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%,同一家公司在境内和香港同时上市的A和H

不呼起起尽上的名字。 (6) 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%; (7) 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%; (8) 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

(9)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 争值的10%; (10)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争值的20%; (11)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

(11) 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期晚的10%;
(12) 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台计规模的10%;
(13) 本基金产度为产于信用级别严级为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分/月内予以全部卖出。
(14) 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;
(15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购局发会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行债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
(16) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%;
(17) 本基金主处投资干流对性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的5%;因证券市场成为、上市公司股票停牌、基金规模变为等基金管理人之外的因素致使基金不符合的款所规定比例限制的,基金管理人不得和过基金资产净值的投资。

投資。 (18)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手 开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持 。 (19)本基金参与国债期货、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,持有的买人国债期货合约价值,不得超过基金资产 净值的15%; (中国ED 15%; 3)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%; 宋黑忌而值时20%; 4)本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有 接效品有值的20%; 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

5)本基金在任何交易日內交易(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%。
6)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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50%。
7)本基金在任何交易日的交易(不包括平仓)的国债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(不含质押式回购)等。
8)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投资比例的有关约定;
9)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买人、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

元定; (20)本基金参与股票期权交易,需遵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%; 2)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

持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可产根贴规权保证金的现金等价物;

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率以合约乘数计算;
(21)本基合持有单只中小企业私募债,其市值不得超过本基金资产净值的10%;本基金持有的全部中小企业私募债息市值不得超过基金资产净值的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。除止选第(2)(17)(18)项外,因证券/期货市场成功、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达规定投资比例的,基金管理人之均的因素致使基金投资比例不符合上达规定投资比例的,基金管理人之对自专在个交易日内进行调整,但中国证监会规定的转换情形除外、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管与检查自基金合同生效之日起所,则本基金投资不再受相关限制或定的指数定的是一个企业,是是任行为为维护基金的投资的监管与检查自基金的自生效。是是任行为为维护基金的报价的企业和企业报明或按照调整后的规定执行。2、禁止行为为维护基金的报价和企业和企业报代证据,但10年期证券(1)基本证限责任的投资;
(1)其实其他基金管理人基金托管人出资;
(2)违反规定的他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金管理人基金托管人出资。(5)从事内等交易活动;(7)法律,行政法规和中国证监会规定整止的其处的证券交易活动;(7)法律,行政法规和中国证监会规定整止的其处形态。

(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 基金管理人区亚腊金顿广头卖基金管理人、基金忙官人及共免股股东。吴师轻别 人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或乘销期内承销的证券。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。遵循基金份额持有人 利益优先原则、防范利益冲突、建立健全内部审批机制和时治机制、按照市场公平台 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。 法律人行政法规或监管部门政消或调整上述限制,如适用于本基金,则本基金投 资按照政消或调整后的规定执行。 五 投资出策

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资策略组负责人、基金经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 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。

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

投资策略组负责人负责本策略组内投资管理和内外部沟通工作,并监控、审查基产的投资业绩和风险。

厂的技質型與相似區。 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, 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 然中12页1511-10/1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。

风险监控职责。 5、风险分析与绩效评估 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、跟踪误差来顺等 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 基金经理解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。 六、业绩计较基准

和调整。
六、出缴比较基准
本基金的业绩比较基准为:中证沪港深高股息精选指数收益率×80%+中债综合
指数收益率×20%
中证沪港深高股息精选指数从沪深A股以及符合港股通条件的港股中选取100只
流过性好,连续分红,股息率高,盈利持续且具有成长性的股票作为指数样本股,采用
股息率加权,以反映产路深三地市场股息率高,盈科特续且具有成长性的股票的整体
表现。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有长差性的债券市场
指数,其选择债券信用类别覆盖全面,期限构成宽泛。选用上述业绩比较基准能够忠
北后帧本基本会的风险协会经验。 有致、共逐年间劳育。相关的模型走回、则原构成见之。这用工企业或几次整年能够走 实反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,并提中国正监会各案。而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人 应在调整实施加个工作日在指定媒介上予以公告。

七、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,属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将 投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交

易规则等差异带来的特有风险。 八、基金管理人代表基金行使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、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 金分類時代人的利益: 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

第十部分 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。

任何不当利益。

基金款以及其他以近のパルルエリリローはあった。 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。 金並及「中國建程經過之」。 三基金財产的账户 主要。 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、 期货结算户以及投资所需的其地专用账户,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

四、基金财产的保管和处分本基金针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、基金投管人和基金销售机构以其自有的财产系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法结、扣押或其他权利、除依法律法规环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、被依法撤销或者被决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情权债务不得相互抵销。

- 、16個日 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、国债期货合约、股票期权合约、债券和 存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法 1、证券交易所发行的有价证券的估值 (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 2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 价人借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效定是影响证券价 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 & 你在公本份本 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

构提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净价进行估值;
(3)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,接成本价值。
2.处于未上市期间的有价证券应证分如下情况处理:
(1)送股,转槽股及股股的工增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该目无交易的,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,接放本估值。
(3)首次公开发行有用确确定期的股票,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;非公开发行有明确确定期的股票,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,同业存单、资产支持证券等品种、以第三方值机构提供的价格数据估值;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债券。 4、中小企业私房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,接成本估值。 5、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的,按债券或股票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 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

允价值。
(2) 股指期货会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。
不,国债期货合约以估值日的结算价估值。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。
经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。
8.本基金投资股票期权合约,—般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后络济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。
9.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。
10.港股通投资上市流通的股票按估值日在港交所的收盘价估值,估值目无交易的,以最近交易日的收盘价估值,港股通投资持有外币证收的价值。适便日无交易的,以最近交易日的收盘价估值,港股通投资持有外币证券资产估值的任意涉及到推价,美元、美高、股元、日元等主要货币对人民币汇率的,应当以基金估值日中国人民银行或其投权机构公布的人民币汇率中间价为准、先根据外有行情的格许算成保留两位小数的人民币估值价,再根据持仓量计算出市值。基本基金现行估值值工率环,基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率,并及时报中国证金各案、无需要有一根据实际情况调整本基金的估值汇率,并及时报中国证金各案、无需了开基金份额持有人大会。差无法取得上述汇率价格信息时,以基金社管人办证保险台里公开外汇市场交易价格为准。
11.如有储衡证据表明接上还汇率的依据。

率价格信息时,以基金托管人所提供的合理公升外汇印项又为现167/96。 11.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。 (下转815版)