(上接B85版)

1、本基金管理人将根据基金合同的规定,根据招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、基金管理人承诺不从事违反《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《证券法》行为的发生。

3、基金管理人不从事违反《基金法》及其他法律法规的行为,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(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)不公平地对待管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产或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)用基金财产承销证券;
(6)用基金财产违反规定向他人贷款或提供担保;
(7)用基金财产从事承担无限责任的投资;
(8)用基金财产买卖其他基金份额,但中国证监会另有规定的除外;
(9)以基金财产向基金管理人、基金托管人出资;
(10)用基金财产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(11)违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定;
(12)法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

4、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,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;
(2)违反基金合同或托管协议及有关法律法规;
(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
(4)在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
(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、滥用职权;
(7)泄露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;
(8)除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票投资;协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
(9)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(10)贬损同行,以提高自己;
(11)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
(12)以不正当手段谋求业务发展;
(13)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
(14)参与洗钱或为洗钱活动提供协助;
(15)法律法规禁止的其他行为

5、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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取利益。

(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。

(4)不得从事损害基金资产的行为。

(5)不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五)基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的目标

(1)保证公司经营运作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、规范运作的经营思想和经营理念。

(2)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3)确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2、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。公司内部部门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方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是各项基本管理制度的纲要和总揽,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司制定内部控制制度遵循了以下原则:

(1)合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2)全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节,不得留有制度上的空白或漏洞。

(3)审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4)适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制系统

公司的内部控制系统是一个分工明确、相互牵制、完备严密的系统。公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任,各个业务部门负责本部门的内部控制,督察长和稽核风控部负责检查公司的内部控制措施的执行情况。具体而言,包括如下组成部分:

(1)董事会

负责制定公司的内部控制大纲,对公司内部控制负完全的和最终的责任。

(2)督察长

负责公司及其业务运作的监察稽核工作,对公司内部控制的执行情况进行监督检查。督察长对董事会负责,将定期和不定期向董事会报告公司内部控制的执行情况,并定期向中国证监会呈送督察长评估报告。

(3)稽核风控部

稽核风控部负责对公司各部门内部控制的执行情况进行监督。稽核风控部对总经理负责,将定期和不定期对各业务部门内部控制制度的执行情况和遵守国家法律法规及其他规定的执行情况进行检查,适时提出修改建议,并定期向中国证监会呈送监察稽核报告。

(4)业务部门

内部控制是每一个业务部门的责任。各部门总监对本部门的内部控制负直接责任,负责履行公司的内部控制制度,并负责建立、执行和维护本部门的内部控制措施。

5、基金管理人关于内部控制的声明

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董事会及管理层的责任,董事会承担最终责任;基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确,并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

(一)基金托管人概况

名称:中国光大银行股份有限公司
住所及办公地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
成立日期:1992年6月18日
批准设立机关和批准设立文号:国务院、国函[1992]7号
组织形式:股份有限公司
注册资本:466.79095亿元人民币
法定代表人:李晓鹏
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[2002]75号
投资与托管部总经理:张博
电话:(010)63636363
传真:(010)63639132
网址:www.cebbank.com

(二)主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生,曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长,中国工商银行总行营业部总经理,中国工商银行四川省分行党委书记、行长,中国华融资产管理公司党委委员、副总裁,中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行行长,中国工商银行党委委员、副行长,中国工商银行股份有限公司党委委员、副行长、执行董事;中国投资有限责任公司党委副书记、监事长;招商局集团副董事长、总经理、党委副书记。曾兼任工银国际控股有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、工银瑞信基金管理公司董事长,招商银行股份有限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事会主席,招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长,兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长,中国光大集团有限公司董事长,中国旅游协会副会长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生,经济学博士,高级经济师。

张博先生,曾任中国光大银行厦门分行副行长,西安分行行长,乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长,青岛分行行长,光大消费金融公司筹备组组长。曾兼任中国光大银行电子银行部副总经理(总经理级),负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

(三)基金托管业务经营情况

截至2018年6月30日,中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共103只证券投资基金,托管基金资产规模2777.81亿元。同时,开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

(四)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行;确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行;确保基金财产安全;保证基金托管业务稳健运行;保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

(1)全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节,覆盖所有的岗位,不留任何死角。

(2)预防性原则。树立"预防为主"的管理理念,从风险发生的源头加强内部控制,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(3)及时性原则。建立健全各项规章制度,采取有效措施加强内部控制。发现问题,及时处理,堵塞漏洞。

(4)独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构,业务操作人员和内控人员分开,以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会,委员会委员由相关部门的负责人担任,工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调,建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施,建立纵向的内控管理制约体制。投资与托管业务部建立了严密的内控督察体系,设立了风险管理处,负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求,并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》等十余项规章制度和实施细则,将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行投资与托管业务部以控制和防范基金托管业务风险为主线,在重要岗位(基金清算、基金核算、监督稽核)还建立了安全保密区,安装了录像监视系统和录音监听系统,以保障基金信息的安全。

(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

根据法律、法规和基金合同等的要求,基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法,对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督;同时,对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为,及时以书面或电话形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。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,基金托管人应报告中国证监会。

五、相关服务机构

(一)基金销售机构:

1、直销机构

名称:诺德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号18层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼18层
法定代表人:潘福祥
客户服务电话:400-888-0009 021-68604888
传真:021-68985121
联系人:许晶晶
网址:www.nuodefund.com

2、代销机构

(1)中国光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
法定代表人:李晓鹏
客服电话:95595
公司网站:www.cebbank.com

(2)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
客服电话:4008096096
公司网站:www.swsc.com.cn

(3)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:王连志
客服电话:4008001001
公司网站:www.essence.com.cn

(4)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场群楼8楼
法定代表人:詹露阳
联系电话:4008866338
公司网站:http://www.PINGAN.com

(5)东北证券股份有限公司
地址:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法人代表:李福春
客服电话:4006-000686
公司网站:www.nesc.cn

(6)东海证券股份有限公司
注册地址:常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:赵俊
客服电话:400-888-8588
公司网站:http://www.longone.com.cn

(7)国都证券股份有限公司
注册住所: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
法定代表人:王少华
客服电话:400-818-8118
公司网站:www.guodu.com

(8)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:杨德红
客户服务电话:95521
公司网站:www.gtja.com

(9)华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯洋
客服电话:4008888818
网址:http://www.hx168.com.cn

(10)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人:凌顺平
网站:www.ijijin.cn
客服电话:95105885

(11)上海中正达广投资管理有限公司
注册住所:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人:黄欣
客服电话:400-6767-523
公司网站:www.zzwealth.cn

(12)北京广源达信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
客服电话:4006236060
网址:www.niuniufund.com

(13)北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:于龙
客服电话:4006-802-123
网址:www.zhixin-inv.com

(14)鼎信汇金(北京)投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路1号院8号楼1701室
办公地址:北京市海淀区清华科技园科技大厦C座17层1701室
法定代表人:齐凌峰
客服电话:400-158-5050
公司网站:www.9ifund.com

(15)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
注册住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:程刚
客服电话:400-810-5919
公司网站:www.fengfd.com

(16)海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区东方路1217号16楼B单元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号6楼
法定代表人:刘惠
客服电话:400-808-1016
公司网站:www.fundhaiyin.com

(17)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
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
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com

(18)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层
法定代表人:周斌
客服电话:4007-868-868
网址:www.chtfund.com

(19)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#(仅限办公)
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:张勇
客服电话:400-166-1188
公司网站:http://8.jrj.com.cn/

(20)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:李兴春
联系人:赵沛然
客户服务电话:400-921-7755
公司网站:www.leadbank.com.cn

(21)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:鲍东华
客服电话:4008-219-031
公司网址:www.lufunds.com

(22)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法定代表人:高锋
客服电话:400-804-8688
网址:www.keynesasset.com

(23)上海挖财金融信息服务有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:胡燕亮
客服电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com

(24)深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山1910 A3-1
法定代表人:苗宏升
客服电话:4007-903-688
网址:www.fundying.com

(25)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人:薛峰
客服电话:400-678-8887
网址:http://www.zlfund.cn 及 http://www.jjmmw.com

(26)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
客服电话:400-6411-999
网址:www.taichengcaifu.com

(27)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn

(28)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
客服电话:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn

(29)天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修辞
客服电话:010-59013895
网址:www.wanjiawealth.com

(30)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208室
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通大厦A座2208
法定代表人:吴雪秀
客服电话:400-001-1566
公司网址:www.yilucaifu.com

(31)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:戎兵
客服电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com

(32)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn

(33)民商基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
法定代表人:贲惠琴
客服电话:021-50206003
网址:http://www.msftec.com/

(34)北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室楼
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法定代表人:张冠宇
客服电话:4008199868
网址:www.tdyhfund.com

(35)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

(36)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn

(37)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
客服电话:95523或4008895523
网址:www.swhysc.com

(38)北京恒宇天泽基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋883室
办公地址:北京市东城区东滨河路乙1号航星园8号楼9层
法定代表人:梁越
客服电话:400-188-8848
网址:www.1314fund.com

(39)山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
客户服务电话:400-666-1618、95573
网址:www.i618.com.cn

(40)中国银行股份有限公司
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:陈四清
客户服务统一咨询电话:95566
网址:http://www.boc.cn

(41)平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人:孙建一
客户服务电话:95511-3
网址:bank.pingan.com

(42)大同证券有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人:董祥
客服电话:400-712-1212
公司网站:http://www.dtsbc.com.cn

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人届时发布的调整销售机构的相关公告。基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构:

名称:诺德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号18层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼18层
法定代表人:潘福祥
客户服务电话:400-888-0009 021-68604888
传真:021-68985121
联系人:孟晓君
网址:www.nuodefund.com

(三)律师事务所与经办律师:

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
联系电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:刘佳、徐莘

(四)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)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:都晓燕
经办注册会计师:许康玮、都晓燕

六、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》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同,经2018年7月23日中国证监会证监许可[2018]1170号文件准予募集注册。

(二)基金存续期间

不定期

(三)基金类型、运作方式

混合型证券投资基金、契约型开放式

(四)募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售,具体情况和联系方法详见基金份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。

(五)募集期限

本基金募集期限自本基金发售之日起不超过3个月。具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及基金合同的规定确定,并在基金份额发售公告中披露。具体募集方案以基金份额发售公告为准,请投资者就发售和认购事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

(六)募集对象

本基金份额的发售对象为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、合格境外机构投资者和人民币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)募集场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售,详情见基金份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。

(八)基金份额的类别

本基金根据是否收取认购/申购费用及销售服务费,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,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、赎回时收取赎回费用的,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值和基金资产净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,根据基金实际运作情况,在履行适当程序后,基金管理人可停止某类基金份额的销售、调整现有基金份额类别的费率水平(基金管理费及基金托管费除外)、变更收费方式或者增加新的基金份额类别,或调整基金份额分类办法及规则等,调整实施前基金管理人及时公告并报中国证监会备案,而无需召开基金份额持有人大会。

(九)基金份额发售面值、费用及认购份额计算公式

1、基金份额发售面值:1.00元人民币。

2、认购价格

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

本基金基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。投资人认购A类基金份额在认购时支付认购费用,认购C类基金份额不支付认购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

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,具体费率结构见下表:

认购金额(M)	认购费率
M<50万元	1.20%
50万元≤M<200万元	0.80%
200万元≤M<500万元	0.20%
500万元≤M	1000元/笔

本基金A类基金份额认购费由A类基金份额的认购人承担,不列入基金财产。认购费用用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。投资人可以多次认购本基金,A类基金份额的认购费用按每笔认购金额确定认购费率,以每笔A类基金份额的认购申请单独计算费用。

4、认购份额的计算公式

(1)本基金A类基金份额的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式如下:

当认购金额(含认购费)适用比例费率时:
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)/基金份额发售面值
当认购金额(含认购费)适用固定费率时:
认购费用 = 固定金额
净认购金额 =认购金额-认购费用
认购份额=(净认购金额+认购期间的利息)/基金份额发售面值

认购费用以人民币元为单位,计算结果保留到小数点后2位,第3位四舍五入。认购份额的计算保留到小数点后2位,第3位四舍五入,由此计算误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

例一:某投资人投资100,000.00元认购本基金A类基金份额,对应费率为1.20%,假设认购期间的利息为1.98元,则其可得到的A类基金份额计算如下:

净认购金额=100,000.00/(1+1.20%)=98,814.23元
认购费用=100,000.00-98,814.23=1,185.77元
认购份额=(98,814.23+1.98)/1.00=98,816.21份

即该投资人投资100,000.00元认购本基金A类基金份额,若该笔资金在募集期间的利息为1.98元,则可得到98,816.21份A类基金份额。

(2)C类基金份额的认购

如果投资者选择认购本基金的C类基金份额,则认购份额的计算方式如下:

认购份额=(认购总金额+认购期间的利息)÷基金份额发售面值

例二:某投资人投资5,000,000.00元认购本基金的C类基金份额,认购金额在募集期产生的利息为50.00元,则可认购C类基金份额为:

认购份额=(5,000,000.00+50.00)÷1.00=5,000,050.00份

即投资人投资5,000,000.00元认购本基金的C类基金份额,认购金额在募集期产生的利息为50.00元,可得到5,000,050.00份C类基金份额。

(十)投资人对基金份额的认购

1、认购时间安排

本基金募集期自基金份额发售之日起最长不超过3个月。具体认购时间安排请见本基金基金份额发售公告。基金管理人可根据基金份额发售的实际情况提前结束或延长募集期,具体安排另行公告。

2、投资人认购应提交的文件和办理的手续

基金投资人可在募集期间到基金销售网点认购本基金,按照销售机构的规定办理基金认购手续,填写认购申请书,并足额缴纳认购款(具体请参见基金份额发售公告)。首次认购之前必须持有效证件开立诺德基金管理有限公司基金账户和销售机构交易账户。

3、认购的方式及确认

投资人在募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T日规定时间内提交的认购申请,可于T+2日后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申请是否被成功受理。

基金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。认购的确认以登记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。

投资人可于基金合同生效后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、认购限额

在本基金募集期内,投资人通过直销机构、其他销售机构或基金管理人网上直销系统(目前仅对个人投资者开通)首次认购的单笔最低限额为人民币1元[含认购费(如有)],追加认购单笔最低金额为人民币1元[含认购费(如有)]。投资人在募集期内多次认购的,按单笔认购金额对应的费率档次分别计费。认购申请一经销售机构受理,则不可撤销。

单一投资者持有本基金份额集中度不得达到或者超过50%,对于可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形,基金管理人有权采取控制措施。

(十一)募集资金利息的处理方式

有效认购款项在基金募集期产生的利息将折合成基金份额,归基金份额持有人所有。认购利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

(十二)基金募集行为结束前,投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户,任何人不得动用。

七、基金合同的生效

(一)基金合同的生效

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2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或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日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

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

如果募集期限届满,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后30日内返还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自承担。

(三)基金存续期内基金份额持有人数量和资产规模

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人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在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,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。

八、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。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。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)申购和赎回开放日及时间

1、开放日及开放时间

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日的交易时间,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购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券、期货交易市场、证券交易所及相关金融期货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

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、赎回或转换的价格为下一开放日各类基金份额申购、赎回或转换的价格。

(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各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。

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,若申购资金在规定时间内未全额到账,则申购不成立。投资人全额交付申购款项,申购成立;基金份额登记机构确认基金份额时,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。

投资人赎回申请生效后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时,赎回款项划付时间相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,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。若申购不成立或无效,则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回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申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行查询等各项义务,致使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。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。

4、基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,但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。

(五)申购与赎回的数额限制

1、本基金的直销网点和代销机构的首次单笔最低申购金额为人民币1元[含申购费(如有)],追加申购的单笔最低申购金额为人民币1元[含申购费(如有)]。

2、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,单笔赎回不得少于1份。某笔赎回导致基金份额持有人在某一销售机构全部交易账户的基金份额余额少于1份的,基金管理人有权强制该基金份额持有人全部赎回其在该销售机构全部交易账户持有的基金份额。

3、本基金对单个投资者累计持有的基金份额上限不作限制,法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外。

4、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。

5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成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、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,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。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述对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报中国证监会备案。

(六)申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购费率

本基金基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。投资人申购A类基金份额支付申购费用,申购C类基金份额不支付申购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A类基金份额的申购费率如下:

申购金额(M)	申购费率
M<50万元	1.50%
50万元≤M<200万元	1.00%
200万元≤M<500万元	0.30%
500万元≤M	1000元/笔

本基金A类基金份额的申购费用由A类基金份额申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费率

本基金的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。本基金的赎回费用由赎回基金份额的持有人承担。

(1)本基金A类基金份额的赎回费率如下:

持有期间(N)	赎回费率
N<7日	1.50%
7日≤N<30日	0.75%
30日≤N<180日	0.50%
180日≤N	0%

本基金A类基金份额的赎回费用由赎回A类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回A类基金份额时收取。对持续持有A类基金份额少于30日的投资人收取的赎回费,将全额计入基金财产;对持续持有A类基金份额长于30日(含)但少于90日的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有A类基金份额长于90日(含)但少于180日的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的50%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

(2)本基金C类基金份额的赎回费率如下:

持有期限(N)	赎回费率
N<7日	1.50%
7日≤N<30日	0.5%
30天≤N	0

本基金C类基金份额的赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回C类基金份额时收取,对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3、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》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违背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、基金赎回费率、销售服务费率等,并另行公告。

5、当发生大额申购或赎回情形时,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,遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

6、申购份额的计算

(1)A类基金份额的申购

A类基金份额的申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除A类基金份额的申购费用后,以申请当日A类基金份额的基金份额净值为基准计算,有效份额单位为份,各计算结果均按照四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

A类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。计算公式如下:

当申购金额(含申购费)适用于比例费率时:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额的基金份额净值
当申购金额(含申购费)适用于固定金额费用时:
申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额的基金份额净值

例一:假定T日A类基金份额的基金份额净值为1.0500元,某投资人当日申购本基金A类基金份额10万元,对应的本次申购费率为1.50%,该投资人的申购费用及可获得的A类基金份额为:

净申购金额=100,000.00/(1+1.50%)=98,522.17元
申购费用=100,000.00-98,522.17=1,477.83元
申购份额=98,522.17/1.0500=93,830.64份

即:该投资人投资10万元申购本基金A类基金份额,假定申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0500元,申购费用为1,477.83元,可获得的A类基金份额为93,830.64份。

(2)C类基金份额的申购

如果投资者选择申购C类基金份额,则申购份额的计算方法如下:

申购份额=申购总金额/申购当日C类基金份额的基金份额净值

申购份额的计算按照四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

例二:某投资者投资5,000,000.00元申购本基金的C类基金份额,假设申购当日C类基金份额净值为1.0400元,则其可得到的申购份额为:

申购份额=5,000,000.00÷1.0400=4,807,692.31份

即:投资者投资5,000,000.00元申购本基金的C类基金份额,假设申购当日C类基金份额的基金份额净值为1.0400元,则其可得到4,807,692.31份C类基金份额。

7、赎回金额的计算

本基金的赎回金额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日该类基金份额的基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的赎回费用,赎回金额单位为元。各计算结果均按照四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

例三:假定某投资人赎回10,000.00份A类基金份额,持有期为179日,对应的赎回费率为0.50%,该日A类基金份额的基金份额净值为1.2800元,则其获得的赎回金额计算如下:

赎回总额=10,000.00×1.2800=12,800.00元
赎回费用=12,800.00×0.50%=64.00元
赎回金额=12,800.00-64.00=12,736.00元

即:投资人赎回10,000.00份A类基金份额,持有期为179日,对应的赎回费率为0.50%,该日A类基金份额的基金份额净值为1.2800元,则其获得的赎回金额为12,736.00元。

例四:假定某投资人赎回其持有的C类基金份额10,000.00份,持有期长于7天但不到30天,赎回适用费率为0.5%,赎回当日的C类基金份额的基金份额净值为1.1180元,则投资人获得的赎回金额计算如下:

赎回总金额=10,000.00×1.1180=11,180.00元
赎回费用=11,180.00×0.5%=55.90元
净赎回金额=11,180.00-55.90=11,124.10元

即投资者赎回本基金10,000.00份C类基金份额,持有期限长于7天但小于30天,假设赎回当日C类基金份额净值为1.1180元,则可得到的净赎回金额为11,124.10元。

(七)基金份额净值的计算

本基金A类基金份额和C类基金份额的基金份额净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,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。遇特殊情况,基金合同另有约定或者经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(八)申购份额与赎回份额的登记

1、投资人T日申购基金份额成功后,正常情况下,基金登记机构在T+1日内为投资人增加权益并办理登记手续,投资人自T+2日起有权赎回该部分基金份额;

2、投资人T日赎回基金份额成功后,正常情况下,基金登记机构在T+1日内为投资人扣除权益并办理相应的登记手续;

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(九)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。

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。

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,或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、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的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时。

7、当前一估值日基金资产净值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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

8、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、7、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时,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,被拒绝的申购款项本金将退还给投资人,基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。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。

(十)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:

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。

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、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益时。

6、当前一估值日基金资产净值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,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一(第5项情形除外)且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时,基金管理人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;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形,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)巨额赎回的认定及处理方式

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)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。若进行上述延期办理,对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的部分,将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请,应当按单个账户非自动延期办理赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,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,将自动转入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,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延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各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,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(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。

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寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登公告。

(十二)暂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登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日,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个开放日的各类基金份额的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过1日,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。

(十三)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。

(十四)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过户登记。基金管理人拟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。

(十五)基金的非交易过户

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以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户,或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人,或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理。

继承是指基金份额持有人死亡,其持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体;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持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

(十六)基金的转托管

基金份额持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,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

(十七)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时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

(十八)基金份额的冻结、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况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结基金份额所产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配,法律法规另有规定的除外。

九、基金的投资

(一)投资目标

本基金通过量化基本面策略精选上市公司,构建核心股票池,根据个股择时策略动态调整核心股票池中个股的仓位,并用数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制,力争实现超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值,为投资人带来稳健的投资回报。

(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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、权证、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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。

本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为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不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

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,本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。

(三)投资策略

1、灵活资产配置策略

(1)战略资产配置策略

股票市场的估值水平是本基金进行战略资产配置的重要依据。在大多数市场估值水平下,本基金会坚持中高水平股票仓位,以获取股票的长期收益;然而,在少数股票市场估值很高的情况下,本基金会以低股票仓位回避市场泡沫可能带来的系统性风险。具体策略如下:

以每次年报、半年报披露结束后第一个交易日为基准日T,计算沪深300指数发布以来每日估值水平PE(TTM),该数列由低到高排序的90%分位数记作Z。当沪深300指数的估值PE(TTM)大于或等于Z值时,本基金股票投资占基金资产的比例为0%-45%;当沪深300指数的估值PE(TTM)小于Z值时,本基金股票投资占基金资产的比例为45%-95%。

在此基础上,本基金进一步通过对宏观经济(包括国内生产总值(GDP)增长率、居民消费价格指数(CPI)走势、广义货币(M2)的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)、各项国家地方政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等)、证券市场流动性、大类资产相对收益特征等因素的数量模型,分析实体经济强弱以及流动性宽松,并结合主观综合判断,确定基金组合中股票、债券、短期金融工具等大类资产的战略配置方向与范围。

(2)战术动态调整策略

结合对市场估值、流动性、投资主体行为、市场情绪等因素的综合分析对各类资产的短期趋势,进行灵活的战术调整;在严格控制投资组合风险的前提下,适当增加高性价比品种仓位、降低低性价比品种仓位,以优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。

2、股票投资策略

本基金由基本面量化策略、个股择时策略以及股票组合管理策略相结合构建股票投资策略框架。该股票投资策略框架的理念在于:一方面,股票投资收益的主要来源是上市公司的经营收益,选择好的公司是策略核心;另一方面,股票市场波动较大,通过调整个股的仓位可以控制风险获取交易收益;最后,由组合管理来控制整体的风险暴露。基本面量化策略通过分析公司基本面情况,筛选出纳入股票投资组合的股票品种;个股择时策略通过分析股票市场的流动性及短期情绪特征,判断个股仓位高低,并做出动态调整;最后,根据不同股票的相互关系进行组合优化进一步调整个股权重以控制风险暴露。

(1)基本面量化策略

1)基本面多因子模型:本基金通过基本面多因子模型(时间截面数据横向比较),针对上市公司最新的财务数据及估值水平进行比较与评判。通过定量分析,选择基本面向好、财务稳健透明、管理规范的企业组成观察股票池。

2)基本面时间序列模型:针对观察股票池的备选标的,建立个股基本面时间序列模型(历史数据纵向比较),持续跟踪、观察研究,进一步分析梳理各上市公司的商业逻辑与行业周期,寻找最优的上市公司进入核心股票池。

(2)个股择时策略

本基金通过投资者行为为基础的技术面模型、舆情分析模型、事件驱动模型等一系列量化模型,动态调整核心股票池中个股权重。以此控制个股的流动性风险暴露,并把握个股波动带来的投资机遇。

1)技术面模型:以市场交易数据为研究对象,通过分析研究投资者在市场交易中的行为特征,发掘交易机会。市场交易数据是股票市场最直接的研究对象,对其深入研究可发掘大量投资者行为特征规律。

2)舆情分析模型:以网站、股吧等公开互联网信息为研究对象,统计分析相关上市公司及其股价的市场关注度以及正负面新闻等情况,研判投资者情绪状态,捕捉交易信号。

3)事件驱动模型:以上市公司一系列事件为研究对象,主要是一些上市公司公告,如业绩预告、业绩快报、指数样本股调整、股权激励、定向增发、高管增持、高送转等。研究事件的发生对股价波动的影响,把握其规律。

(3)股票组合管理策略

本基金将通过多因子风险模型来分析股票组合在各个维度上的风险暴露(风格、行业、波动等等),并使用优化器调整股票组合中个股的相对比例,将组合风险暴露控制在合理范围内;同时,也根据一些特定的宏观类或市场类极端情况进行情景分析,检验股票组合的稳健性。

3、债券投资策略

根据本基金资产总体配置计划,债券资产投资组合的构建将通过"自上而下"的过程,即首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率趋势变化;其次,在判断利率变动趋势时,全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、债券市场政策趋势、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成合理预期。然后,在此基础上本基金将使用"自下而上"的投资策略,考虑债券的信用等级、期限、品种、流动性、交易市场等因素,依据收益率曲线、久期、凸性等指标和相对价值分析研究建立以严格控制久期、控制个券风险暴露度和控制信用风险暴露度为核心的由不同类型、不同期限债券品种构成的债券资产投资组合,并动态实施对投资组合的管理调整,以获取超出比较基准的长期稳定回报。

4、可转换债券的投资

可转换债券兼具股性和债性的双重特征,其内在价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值。同时,由于市场的流动性因素影响,可转换债券的市场交易价格相对于其内在价值会存在不同程度的溢价。本基金将通过对可转换债券内在价值的评估,选择投资价值相对低估的可转换债券。

5、资产支持证券投资

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及信用风险和提取偿还率等多种因素影响,其估值方法主要是以根据长期历史统计数据建立的数量化模型为基础。本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

6、股指期货投资策略

为更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货。本基金利用股指期货合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合的运作效率。

7、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

(四)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的采取定期开放方式运作的基金)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15%;

(6)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%;

(7)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)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%;

(13)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%;

(14)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%;

(15)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;

(16)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;

(17)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(18)本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(19)本基金投资股指期货,将遵守下述比例限制: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%;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%;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;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;

(20)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一致;

(21)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。

除上述第(2)、(7)、(15)、(20)项另有约定及法律法规另有规定外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制性规定,如适用于本基金,则在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行,但须提前公告。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,在适用于本基金的情况下,在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准,但须提前公告。

(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*60%+中证全债指数收益率*40%。

中证全债指数是中证指数有限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,中证指数有限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,为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。沪深300指数是由中证指数有限公司编制,从上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本的综合性指数,具有良好的市场代表性。本基金运用大类资产配置策略,严控下行风险,以为投资者创造稳定的较高收益为投资目标,因此选取"沪深300指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%"作为本基金的业绩比较基准。

如果上述业绩比较基准中所使用的指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开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,其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

(七)基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值;

2、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;

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

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任何不当利益。

十、基金的财产

(一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

(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。

(三)基金财产的账户

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

本基金财产独立于基金管理人、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,基金财产不得被处分。

(下转B87版)