

(上接D61版)

三、律师事务所与经办律师
律师事务所名称：上海市海华永泰律师事务所
注册地址：上海浦东东方路69号裕景国际商务广场A座15层
负责人：颜学海
电话：021-58773177
传真：021-58773268
经办律师：张兰、梁丽金
联系人：张兰
五、会计师事务所和经办注册会计师
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(办公地址)：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
执行事务合伙人：李丹
电话：021-2323 6714
传真：021-2323 8800
经办会计师：薛竟、陈燕
联系人：陈薇瑶

四、基金名称

金信量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

五、基金类型

混合型证券投资基金

六、投资目标

本基金主要关注具有良好盈利能力和高成长性的股票,通过积极主动的量化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,力争为基金持有人提供长期稳定的投资回报。

七、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)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、公司债、次级债、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(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)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。

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%,权证投资占基金资产净值的比例为0%—3%;本基金每个交易日终,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。

八、投资策略

(一)资产配置策略

本基金实行在公司投资决策委员会统一指导下的资产配置机制。投资决策委员会定期或针对特定事件临时召开,讨论、确定具体的基金资产未来一段时期内在权益类资产及固定收益类资产之间的配置比例范围,形成资产配置相关决议。基金经理根据投资决策委员会关于资产配置的具体决议具体执行并实施资产配置方案。

量化投资策略是本基金的主要投资策略,为了有效实施量化投资策略,本基金将在投资决策委员会关于资产配置决议的允许范围内,采取相对稳定的股票持仓比例控制措施,降低由于股票持仓比例波动过于频繁影响到量化投资策略的效果。

本基金资产配置采取“自上而下”的多因素分析决策支持,以量化分析为主,结合对宏观和行业的判断和研究,对资产的风险收益特征进行分析预测,确定中长期的资产配置方案。

(二)多因子量化选股策略

1.多因子阿尔法选股模型
本基金使用的数量化模型是国际上广泛使用的多因子阿尔法模型(Multi-Factor Alpha Model),该模型认为,金融资产的预期收益可以模拟为多个因子的函数,每个因子可以部分地解释金融资产的收益和风险特性。在应用这个模型进行选股的时候,本基金充分考虑了中国资本市场的实际情况,对中国资本市场更具针对性和实用性。本基金以量化模型为驱动的选股策略包括以下几个步骤:

(1)筛选有效因子

通过深入研究传统投资理论、总结分析投资团队多年积累的选股经验,本公司金融工程团队提出适应中国市场的选股逻辑,再经过全面而细致的实证检验,挑选出相对稳定的逻辑,并具体体现为通过量化因子选股。这些量化因子总共分为三类:宏观因子、统计因子以及基本面因子。宏观因子包括通胀、GDP、利率曲线中的异常变化等;统计因子由PCA等统计方法识别;基本面因子包括价值、增长、动量等。对于公司的盈利能力,我们持续关注公司多个季度的盈利及增长,对于公司的成长性,我们主要从公司二级市场的历史数据中挖掘。每一个因子的提炼都经过金融工程团队的反复验证,具备一定的选股能力。

(2)因子的权重

每一个因子都代表了一种选股逻辑。在不同的市场环境下,选股逻辑会有不同的侧重点。例如,当市场关注价值投资时,反映公司价值的因子重要性要大一些;当市场更关注企业成长时,反映公司成长速度的因子重要性要大一些。我们会给不同因子配以不同的权重,以反映当时市场的侧重点。

(3)因子的更替及权重的调整

金融工程团队将定期回顾所有因子的表现情况,适时剔除失效因子、酌情纳入重新发挥作用的有效因子或者由市场上新出现投资逻辑归纳而来的有效因子。此外,我们还将采用OLS、信息比率等方法,评价因子的重要性,定期调整因子权重。

2.严格的风险控制

本基金通过风险控制模型衡量和控制包含行业风险、风格风险和个股风险在内的各种形式的风险,从而力争避免在某些市场环境较大幅落后于市场;同时,本基金通过风险控制技术使得基金的投资集中在量化模型擅长的领域,避免承担模型无法识别的风险。

3.使用先进技术减少交易成本

本基金在组合构建时将分析个股的流动性,在此基础上限制个股的权重;本基金在组合调整时将综合比较组合调整带来的潜在收益和组合调整的成本,避免不必要的交易;本基金在交易中还将利用交易技术尽可能减少市场冲击,降低交易成本。

4.综合衡量获利机会、风险因素、交易成本、动态构造组合
除了在价格发现、风险控制、交易技术等方面进行深入挖掘外,本基金将综合这些因素之间的相互联系,结合各行业的特性,在进行整体考虑后动态构造组合。

(三)债券投资策略

在大类资产配置的基础上,本基金将依托基金经理人固定收益团队的研究成果,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略,把握债券市场投资机会,实施积极主动的组合管理,以获取稳健的投资收益。

1.久期管理

本基金将在对国内宏观经济要素变化趋势进行分析和判断的基础上,通过有效控制风险,基于对利率水平的预测和混合型债券中债券投资相对被动的特点,进行以“目标久期”为中心的资产配置,以收益性和安全性为导向配置债券组合。

2.期限结构配置

由于期限不同,债券对市场利率的敏感程度也不同,本基金将结合对收益率曲线变化的预测,采取下面的几种策略进行期限结构配置:首先采取主动型策略,直接进行期限结构配置,通过分析和情景测试,确定长期、中期、短期三种债券的投资比例。然后与数量化方法相结合,结合对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用不同投资组合中债券的期限结构配置。

3.确定类属配置

收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等因素基础上,进行类属的配置,优化组合收益。

4.个债选择

本基金在综合考虑上述配置原则基础上,通过对个体券种的价值分析,重点考察各券种的收益率、流动性、信用等级,选择相应的最优投资对象。本基金还将采取积极主动的策略,针对市场定价失误和回购套利机会等,在确定存在超额收益的情况下,积极把握市场机会。

本基金已在已有组合基础上,根据对未来市场预期的变化,持续运用上述策略对债券组合进行动态调整。

(四)中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的小型民营企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市中小企业,企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司,信息披露情况相对滞后,对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司,且定向发行方式限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险,因此本基金中小企业私募债券的投资将重点关注信用风险和流动性风险。本基金采取自下而上的方法建立适合中小企业私募债券的信用评级体系,对个券进行信用分析,在信用风险可控的前提下,追求合理回报。本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用以结构化模型为基础的量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良,估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。@ (五)资产支持证券投资策略
资产支持证券,定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、违约率等。本基金将深入分析上述基本因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。

(六)衍生品投资策略

1.股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置和品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

2.权证投资策略

权证为基金辅助性投资工具。在进行权证投资时,基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性,通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。

基金管理人将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,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(七)投资决策程序

本基金严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。投资程序包括以下几个部分:

1.研究

本基金股票投资研究依托公司整体的研究平台,同时整合了外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果。公司研究员按行业分工,负责对各行业以及行业内个股进行跟踪研究。在财务指标分析、实地调研和估值评估的基础上,研究员对所研究的股票、行业提交投资建议报告,供投资决策参考。固定收益相关人员负责债券投资研究。

2.资产配置决策

投资决策委员会判断一段时间内证券市场的基本走势,决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围。基金经理在投资决策委员会确定的资产配置比例范围内,决定基金的具体资产配置。

3.组合构建

基金经理在研究员的研究基础上,结合自身的研究判断,决定具体的投资品种并决定买卖时机。

4.交易执行

交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

5.风险与绩效评估

公司金融工程部定期和不定期对基金进行风险和绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期,组合收益的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据以检讨投资策略,进而调整投资组合。

6.组合监控与调整

基金经理将跟踪经济状况、证券市场 and 上市公司的发展变化,结合基金申购和赎回的现金流量情况,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,使之不断得到优化。

基金管理人可以根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整,并在基金招募说明书更新中公告。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是:

创业板指数收益率×35%+沪深300指数收益率×35%+中证综合债指数收益率×30%

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑:

1.创业板指数由深圳证券交易所以于2010年6月1日起正式编制和发布。该指数也称为“加权平均指数”,就是以起始日为一个基准点,按照创业板所有股票的流通市值,一个一个计算当天的股价,再加权平均,与开板之日的“基准点”比较,能够全面地反映创业板的走势。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数,由中证指数公司编制和维护,是在上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高,具有良好的市场代表性,同时,该指数编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关性,且指数历史表现强于市场平均收益水平,适合作为本基金的权益投资部分业绩基准。

2.中证综合债指数综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,具有良好的债券市场代表性。

3.作为混合型基金,选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

如果今后上述基准指数停止计算编制或更改名称,或法律法规发生变化,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,或市场中出现更适用于本基金业绩比较基准的指数,本基金可以在征得基金托管人同意后报中国证监会备案后变更业绩比较基准,并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中长期收益产品。

十一、基金投资组合报告

基金管理人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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了下文中的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。

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请仔细阅读本基金的招募说明书。
本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日(未经审计)。

11.1 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 | 78,491,738.03 | 35.89 |
| | 其中:股票 | 78,491,738.03 | 35.89 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 110,886,740.00 | 50.70 |
| | 其中:债券 | 110,886,740.00 | 50.70 |
| | 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 | 5,090,000.00 | 2.29 |
| | 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 | 22,290,111.00 | 10.19 |
| 8 | 其他资产 | 2,024,464.31 | 0.93 |
| 9 | 合计 | 218,693,053.34 | 100.00 |

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 67,043,728.78 | 32.20 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,955,050.00 | 0.94 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 508,164.00 | 0.24 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息技术、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 7,084,584.00 | 3.40 |
| K | 房地产业 | 1,900,211.25 | 0.91 |
| 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 | 78,491,738.03 | 37.70 |

11.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

11.3 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 | 601688 | 华泰证券 | 313,200 | 7,084,584.00 | 3.40 |
| 2 | 600522 | 中天科技 | 477,329 | 6,821,031.41 | 3.28 |
| 3 | 000902 | 新洋丰 | 516,091 | 5,217,680.01 | 2.51 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 198,700 | 4,961,539.00 | 2.38 |
| 5 | 002206 | 海利得 | 693,475 | 4,729,499.50 | 2.27 |
| 6 | 600104 | 上汽集团 | 149,994 | 4,528,318.86 | 2.17 |
| 7 | 000887 | 中顺股份 | 212,800 | 4,436,880.00 | 2.13 |
| 8 | 002444 | 巨星科技 | 256,197 | 3,850,640.91 | 1.85 |
| 9 | 002680 | 长生生物 | 245,036 | 3,741,699.72 | 1.80 |
| 10 | 300097 | 智云股份 | 114,418 | 3,369,610.10 | 1.62 |

11.4 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 | 国债债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 109,428,000.00 | 52.56 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转换(可交换)债 | 1,458,740.00 | 0.70 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 110,886,740.00 | 53.26 |

11.5 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 | 1280346 | 12国债信增 | 200,000 | 20,268,000.00 | 9.73 |
| 2 | 1780257 | 17湖浙新城02 | 200,000 | 20,038,000.00 | 9.62 |
| 3 | 143182 | 17建材1 | 200,000 | 19,840,000.00 | 9.53 |
| 4 | 136416 | 16南油03 | 200,000 | 19,676,000.00 | 9.45 |
| 5 | 136133 | 16国电01 | 200,000 | 19,628,000.00 | 9.43 |

11.6 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。

11.7 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。

11.8 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。

11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

11.9.1 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。

11.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

11.11 投资组合报告附注

11.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除华泰证券(证券代码601688)、新洋丰(证券代码000902)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

华泰证券于2016年11月25日因未按照法律规定对客户身份进行审查和了解,受到中国证监会公开处罚。新洋丰于2016年11月29日因短线交易及未按照法律规定进行信息披露,受到深圳证券交易所公开谴责。

本基金于华泰证券受处罚后持仓的原因为该公司为证券市场龙头,估值处于历史低位,预期环比业绩将明显改善,且该次公开处罚主要是监管部门对当时证券公司经营中普遍存在的问题进行整改处罚,而非单一公司治理及风险控制。本基金于新洋丰公开谴责后持仓的原因是该公司为国内复合肥龙头企业,且行业政策利空因素已出尽,相关产品价格均已企稳回升,公司的估值水平将进一步提升。因此,本基金对上述受处罚发行主体进行了充分调研和论证,履行了必要的投资决策程序,并经投资决策委员会决策的基础上,将华泰证券、新洋丰纳入了本基金的备选股票库。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

11.11.2 本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。

11.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 94,097.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,929,368.17 |
| 5 | 应收申购款 | 998.50 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,024,464.31 |

11.11.4 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。

11.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.11.6 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。

十二、基金业绩

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。

| 阶段 | 份额净值收益率(1) | 份额净值收益率标准差(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) |
|------------------------------|------------|---------------|--------------|-----------------|---------|---------|
| 2016.7.1(基金合同生效日)-2016.12.31 | -14.00% | 0.78% | -2.28% | 0.62% | -11.72% | 0.16% |
| 2017.1.1-2017.6.30 | 6.74% | 0.56% | 1.24% | 0.47% | 5.50% | 0.09% |
| 2017.1.1-2017.9.30 | 7.56% | 0.47% | 4.10% | 0.49% | 3.46% | -0.02% |
| 2016.7.1(基金合同生效日)-2017.9.30 | -7.50% | 0.62% | 2.29% | 0.54% | -9.79% | 0.08% |

十三、基金的费用概况

13.1 与基金运作有关的费用
13.1.1、基金费用的种类
(一)基金管理人的管理费;
(二)基金托管人的托管费;
(三)基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
(四)基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和仲裁费;
(五)基金份额持有人大会费用;
(六)基金的相关账户的开户及维护费用;
(七)基金的证券、期货交易费用;
(八)基金的银行汇划费用;
(九)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。

13.1.2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(一)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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
 $H = E \times 1.5\%$ = 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假期等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。
(二)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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
 $H = E \times 0.25\%$ = 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”,由基金管理人和本基金托管人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。

13.1.3、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
(一)基金管理人及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;

(二)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;
(三)基金合同生效前的相关费用;
(四)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。
13.2 与基金销售有关的费用
13.2.1、申购费率
申购金额(含申购费,元) 申购费率 || 100万以下 | 1.50% |
| 100万(含)-250万 | 1.00% |
| 250万(含)-500万 | 0.60% |
| 500万(含)以上 | 按笔收取,每笔1000元 |

注:上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台及代销机构申购的养老金客户以外的其他投资者。部分代销机构如实行优惠费率,请投资者参见代销机构公告。
13.2.2、特定申购费率
申购金额(含申购费,元) 申购费率 || 100万以下 | 0.375% |
| 100万(含)-250万 | 0.25% |
| 250万(含)-500万 | 0.15% |
| 500万(含)以上 | 按笔收取,每笔1000元 |

注:上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台及代销机构申购本基金份额的养老金客户,包括基本养老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:全国社会保障基金;可以投资基金的地方社会保障基金;企业年金单一计划及集合计划;企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;企业年金养老金产品。如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司在法律法规允许的范围内可将其纳入养老金客户范围。本基金申购费由申购者承担,不列入基金财产。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。