

(上接 D25 版)

(51)北京肯特瑞财富管理基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:程超
客服电话:95118
联系人:赵德赛
电话:18600280556
传真:010-89188000
网址: fund.jd.com
(52)姜丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
客服电话:400-684-0500
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
网址: www.jifunds.com.cn
(53)上海云湾投资管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
法定代表人:戴蒙
客服电话:400-820-1515
联系人:范泽杰
电话:021-20530186
传真:021-20538999
网址: www.zhengtongfunds.com
(54)上海汇付金融服务股份有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人:金浩
客服电话:400-820-2819
联系人:陈云卉
电话:18616024775
传真:021-33323837
网址: http://tvy.chinapnr.com
(55)中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
联系人:许曼华
电话:021-20315290
传真:021-20315137
网址: www.zts.com.cn
(56)信誉善泽投资顾问(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18层1809
法定代表人:戎兵
客服电话:400-6099-200
联系人:张得仙
电话:010-52413390
传真:010-85894285
网址: www.yixinfund.com
(57)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(上海东沪经济开发区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号的太平洋金融大厦1503-1504室
法定代表人:王翔
客服电话:400-820-5369
联系人:俞申莉
电话:021-65370077
传真:021-55085991
网址: www.jiyufund.com.cn
(58)东莞证券股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区公园南路一号
办公地址:广东省东莞市莞城区公园南路一号金源中心22楼
法定代表人:张运勇
电话:0769-22115712
传真:0769-22115712
邮编: 523000
(59)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:杨磊
电话:027-87107535
传真:027-87618863
邮编:430000
(60)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:周一涵
电话:021-38637436
传真:021-58991896
客服电话:95511-8
公司网址: http://stock.pingan.com/
(61)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人:毛准平
联系人:朴祚研
电话:010-88066632
传真:010-88066214
邮编:100032
(62)天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津市自贸区(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A座5层
法定代表人:李修辞
联系人:褚琦
电话:010-59013828
传真:010-59013703
邮编:100052
(63)武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:武汉市江浦区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 幢 23 层 1 号 4 号
办公地址:武汉市江浦区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 幢 23 层 1 号 4 号
法定代表人:陶捷
电话:027-83863772
传真:027-83862682
邮编:430000
公司网站: www.buyfunds.cn
(64)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区虹曲路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区阳江路1687号2号楼
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
联系人:余翼飞
电话:021-80358749
传真:021-38509777
网址: www.noah-fund.com
(65)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中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:秦雄
客服电话:4008-980-618
联系人:张静
电话:010-53096044
传真:010-58845306
公司网站: www.chtfund.com
(66)上海大智慧财富管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103
法定代表人:申健
客服电话:021-20219931
联系人:施燕华
电话:021-20219988
传真:021-20219988
网址: www.gw.com.cn
(67)中国农业银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:李蔚
联系人:唐雨晴
电话:01085106055/15810356657
客服电话:95599
网址: www.abchina.com.cn/
(68)万联证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19号
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层
法定代表人:张建军
客服电话:95322

网址: www.kysec.cn
(70)中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40-43层
法定代表人:邢志军
客服电话:40088-95618
联系人:胡剑
电话:010-59355807
传真:010-56437030
网址: http://www.c518.com/
(71)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘江路二段36号华远中心4.5号楼3701-3717
办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层
法定代表人:施华
客服电话:95571
联系人:王斌
电话:010-59355997
传真:010-57398130
网址: www.foundersc.com
(72)大通证券股份有限公司
注册地址:大连市中山区人民路24号
办公地址:大连市沙河湾会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人:张智勇
客服电话:400-816-9169
联系人:谢立军
电话:0411-39673202
传真:0411-39673219
网址: www.daton.com.cn
(73)湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:孙永祥
联系人:江晨前
电话:021-38784580-8920
传真:021-68865680
(74)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:俞萍
联系人:杨莉娟
电话:021-54967252
传真:021-54967293
(75)北京唐瑞耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院2号楼236室
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
电话:010-85932810
传真:010-59200800
(76)北京董董基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院2号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院2号楼2单元21层222507
联系人:侯芳芳
电话:010-61840688
传真:010-61840699
客服电话:400-159-9288
网址: https://dandanapp.com/
(77)上海攀赢基金销售有限公司
注册地址:上海市闸北区广中西路1207号306室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号太平洋金融大厦603室
法人:沈煜
联系人:吴卫东
电话:13918302493
客服电话:021-68889082
网址: http://www.pytz.cn/
(78)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼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楼01、02、03室
法定代表人:冷飞
联系人:孙琦
电话:18652009539
传真:021-50810687
(79)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海金中心办公楼2期53层5312-15单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系人:李雯
电话:010-60842306
传真:010-85712195
(80)其他场外销售机构具体名单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。

3. 场内发售机构
本基金通过深圳证券交易所上网定价发售,基金份额发售机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位。
(1)已经具有基金销售业务资格的深交所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。
(2)本基金募集期间获得基金销售资格并具有深交所会员单位资格的证券公司经深交所确认后也可代理场内基金份额发售。具体名单可在深交所网站查询,本基金管理人将不就此事项进行公告。
(3)尚未取得基金销售资格,但属于深交所会员的其他机构,可在本基金上市交易后,代理投资人通过深交所交易系统参与本基金的买卖。
(二)登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系电话:010-50938782
联系人:赵亦清
(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19楼
办公地址:上海市银城中路68号19楼
负责人:前卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛
(四)审计本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)
法定代表人:魏华
住所:中国北京东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址:中国北京东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
邮政编码:100738
公司电话:010-58153000
公司传真:010-85188298
签字会计师:陈露、鞠育化
业务联系人:鞠育化
四、基金的名称
德邦量化新锐股票型证券投资基金(LOF)
五、基金的类型
本基金类型:上市契约开放式(LOF):股票型证券投资基金
六、基金的投资目标
在力求严格控制投资风险的前提下,通过数量化的方法进行积极的投资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。
七、基金的投资范围
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(包括主板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券及其他经中国证监会允许的债券)、证券投资基金、股指期货、上市交易权证的申购、赎回、转融通等金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
基金的投资组合比例为:本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的80%;扣除股指期货合约和股指期货合约需缴缴的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
八、基金的投资策略
本基金利用量化投资模型,在严格控制投资风险的前提下,力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。
1. 股票投资策略
本基金以中证500指数为业绩比较基准权重部分的标的指数,基金股票投资组合将主要采用量化投资组合,选取并持有预期收益较好的标的指数成分股及其他股票构成投资组合,在严格控制投资风险的前提下,力求实现超越业绩比较基准的超额收益。
量化投资组合的主要依据国内外成熟的量化投资策略,在对标的指数成分股及其他股票的基本面等信息的基础上,运用多因子分析模型构建投资组合,同时对投资组合进行动态调整并严格控制组合风险,实现超额收益。
(1)多因子 Alpha 模型
本基金的多因子 Alpha 模型以中国股票市场的宏观环境、行业及个股特性为分析框架,综合测试各类因子在股票长期表现上所产生的超额收益,包括基本面趋势因子、盈利质量因子、价值因子、分析师预期因子、动量等市场因子、事件驱动因子等几大类因子,每类因子分别由多因子组合而成。在实际管理运作中,公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化,紧密跟踪模型各个因子的有效性和市场环境,并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。
多因子 Alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库,科学地考虑了大量的各类信息,包括来自市场各类投资者、公司各类报告、分析师预测等等多方面的信息,并根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,适当调整各类因子的具体组成及权重。
(2)风险控制与利用
本基金还将利用风险预测模型进行投资组合进行事前控制,力求实现的风险在可控的范围之内,另外本基金利用交易成本模型考虑交易费用等固定成本,也将其纳入模型考虑。
(3)投资组合优化与调整
本基金在 Alpha 模型、风险控制及交易成本模型的基础上,进行投资组合优化,构建实现预期投资收益最大化的投资组合。本基金将根据所考虑各

种信息的变化情况,对投资组合进行优化调整,并根据市场情况适当控制和调整投资组合的换手率。
2. 固定收益投资策略
债投资组合方面,本基金亦采取“自上而下”的投资策略,通过深入分析宏观经济、货币政策和利率变化等趋势,从而确定债券的配置策略。同时,通过考察不同券种的收益率水平、流动性、信用风险等因素配置债券的核心内在价值,运用久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等投资策略进行债券组合的灵活配置。
3. 衍生品投资策略
(1)股指期货投资策略
本基金将根据股指期货管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,选择流动性好、交易活跃的股票期货合约。
(2)权证投资策略
本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中以权证的市值价格分析为基础,以主动式的科学投资管理为手段,综合考虑股票合理价值、标的股票价格,结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证合理价值,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求基金资产稳定的当期收益。
4. 中小企业私募债券投资策略
对于中小企业私募债券而言,由于其采取非公开方式发行和交易,并限制投资者数量上限,会存在一定的流动性风险。同时,中小企业私募债券的发行主体资产规模较小,经营波动性较大,信用基本面稳定性较差,进而整体的信用风险相对较高。因此,本基金在投资中小企业私募债券时将主要从两个方面控制投资风险。首先,本基金将仔细甄别发行人资质,建立风险预警机制;其次,将严格控制中小企业私募债券的投资比例上限。第三,将对拟投资或已投资的品种进行流动性分析和监测,尽量选择流动性相对较好的品种进行投资;
5. 资产支持证券的投资策略
本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产证券化产品的质量及构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方位分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的投资收益。
6. 国债期货投资策略
本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适度参与国债期货交易。
今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
中证500指数是中证指数有限公司为反映市场上不同规模特征股票的整体表现,以沪深300指数为基础,构建的包括大盘、中盘、小盘、大中盘、中小盘和大小盘指数在内的规模指数体系中的组成部分。中证500指数全称“中证小盘500指数”,它的样本选自沪深两个证券市场,其成份股包含了500只中证500指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票,综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。本基金认为,该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。
随着法律法规和市场环境发生变化,如果中证指数有限公司变更或停止中证500指数的编制及发布,或中证500指数由其他指数替代,或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致上述业绩比较基准不适用本基金,或者推出更具权威能够更好代表本基金风险收益特征的指数,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。调整业绩比较基准须经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前2个工作日在指定媒介上予以公告。
十、基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险及收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2018年12月31日,本报告所列财务数据未经审计。
1. 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 111,148,588.12 92.39
其中:股票 111,148,588.12 92.39
2 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
资产支持证券 -- --
4 贵金属投资 -- --
5 金融衍生品投资 -- --
6 买入返售金融资产 -- --
其中:买断式回购的买入返售金融资产 -- --
7 银行存款和结算备付金合计 9,219,087.12 7.66
8 其他资产 51,420.87 0.04
9 合计 120,419,096.11 100.00
2. 期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
金额单位:人民币元
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业 2,896,376.00 2.43
B 采矿业 6,330,221.00 5.31
C 制造业 72,578,447.22 60.85
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 770,859.09 0.65
E 建筑业 3,587,131.20 3.01
F 批发和零售业 2,468,273.92 2.07
G 交通运输、仓储和邮政业 594,209.00 0.50
H 住宿和餐饮业 255,012.00 0.21
I 信息技术、软件和信息技术服务业 7,082,998.88 5.94
J 金融业 1,436,460.00 1.20
K 房地产业 6,780,099.89 5.68
L 租赁和商务服务业 236,128.00 0.20
M 科学研究和技术服务业 709,995.00 0.60
N 水利、环境和公共设施管理业 2,970,736.00 2.49
O 国民服务、修理和其他服务业 -- --
P 教育 -- --
Q 卫生和社会工作 151,904.00 0.13
R 文化、体育和娱乐业 1,962,434.00 1.65
S 综合 336,733.00 0.28
合计 111,148,588.12 93.19
2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未有通过沪港通交易机制投资的港股。
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
金额单位:人民币元
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 002215 三维通信 300,400 2,964,948.00 2.49
2 600997 开滦股份 500,400 2,837,268.00 2.38
3 300559 佳发教育 78,000 2,687,100.00 2.25
4 002507 涪陵榨菜 119,500 2,581,200.00 2.16
5 300122 智飞生物 63,600 2,465,136.00 2.07
6 601717 郑煤机 444,200 2,456,426.00 2.06
7 002383 合众思壮 205,700 2,433,431.00 2.04
8 600801 华新水泥 145,400 2,431,088.00 2.04
9 002541 汤臣倍健 343,300 2,409,966.00 2.02
10 300467 通廊科技 102,100 2,341,153.00 1.96
4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
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
注:本基金本报告期末未持有债券。
6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。
10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
11. 投资组合报告附注
11.1 投资期间, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。
11.2 本基金投资的前十名股票没有超过基金合同规定的备选股票库。
11.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 45,653.10
2 应收证券清算款 --
3 应收利息 --
4 其他应收款 4,379.87
5 应收申购款 1,387.90
6 其他应收款 --
7 预付账款 --
8 其他 --
9 合计 51,420.87

本报告因四舍五入原因,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。
十一、基金的投资组合
本基金管理人依照恪守诚信、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。
1. 本基金合同生效日为2018年4月4日,基金合同生效以来(截至2018年12月31日)历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:
量化新锐:
阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
2018年04月04日至2018年12月31日 -25.63% 1.46% -29.84% 1.44% 4.21% 0.02%
新锐C:
阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
2018年04月04日至2018年12月31日 -25.79% 1.46% -29.84% 1.44% 4.05% 0.02%
注:本基金业绩比较基准:95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益的历史走势对比图
B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益的历史走势对比图
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益的历史走势对比图
注:本基金的基金合同生效日为2018年4月4日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满1年。本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置符合本基金基金合同规定。图示日期为2018年4月4日至2018年12月31日。
十三、基金费用与税收
(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费;
4、(基金合同)生效后与基金相关的信息披露费用;
5、(基金合同)生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费、诉讼费和仲裁费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的相关账户的开立及维护费用;
10、基金上市初费和上市费用;
11、按照国家有关规定和(基金合同)约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.0%×当年天数
H为每日应计提的管理费
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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.2%×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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
3、基金销售服务费
本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.25%×当年天数
H为基金销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构或基金管理人,并由登记机构支付或基金管理人代付给各基金份额持有人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用,由基金管理人及基金托管人根据有关法律法规及相应协议约定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人根据基金管理人的指令从基金财产中支付。
(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、(基金合同)生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(四)费用调整
基金管理人和基金托管人可按照基金发展情况,在履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率和C类基金份额的销售费率等相关费率。降低C类基金份额销售费率,无需召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。
(五)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
十四、对招募说明书更新部分的说明
本招募说明书依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下:
1、“重要提示”部分:明确了本基金的成立日期、更新招募说明书内容的截止日期及有关事项的截止日期。
2、“更新”第三部分“基金管理人”中基金管理人相关信息。
3、“更新”第四部分“基金托管人”中基金托管人相关信息。
4、“更新”第五部分“相关服务机构”中代销机构和登记机构的基本信息。
5、新增“第六部分 基金的募集”中基金的募集情况,删除了发行期募集的基本要素内容,如募集方式、场所、期限、对象等部分。
6、新增“第七部分 基金合同生效”中基金合同生效的相关信息,删除了基金募集的条件及基金不能生效时募集资产的处理方式。
7、“更新”第十部分“基金的投资”中最近一期截至2018年12月31日投资组合报告内容。
8、“更新”第十一部分“基金的业绩”,说明了德邦量化新锐和新锐C自2018年04月04日(基金合同生效日)至2018年12月31日的基金业绩。
9、“更新”第十二部分“对基金份额持有人的服务”中资料寄送服务的相关信息。
10、“更新”第二十三部分“其他应披露事项”,列示了自2018年10月4日至2019年4月3日涉及公司及本基金的信息披露事项。
德邦基金管理有限责任公司
二〇一九年五月十六日