(上接D5版)

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,并在2日内在规定媒介上刊登公告。
十、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,基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。
2、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规定媒介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。
十一、基金转换
基金管理人可以根据相关法律法规以及本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本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、基金份额的转让
在法律法规允许且条件具备的情况下,且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下,履行相关程序后,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其他方式进行基金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。
十三、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。
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。
十四、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。
十五、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在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。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。
十六、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况下的冻结与解冻。
基金份额被冻结的,被冻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。
十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回
本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。
十八、如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。
十九、基金管理人可在法律法规允许的范围内,在不影响基金份额持有人实质利益的前提下,根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

第七部分 基金合同当事人及权利义务
一、基金管理人
(一)基金管理人简况
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室
法定代表人:李文
设立日期:2005年2月3日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2005】5号
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币132,724,224元
存续期限:持续经营
联系电话:(021)28932888
(二)基金管理人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
(1)依法募集资金;
(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)按照规定召集基金份额持有人大会;
(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
(13)代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于证券投资基金所产生的权利,基金合同另有约定的除外;
(14)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
(15)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(16)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;
(17)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管和非交易过户等业务规则;
(18)在法律法规和基金合同规定的范围内决定调整各类基金份额的费率结构和收费方式;
(19)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
(1)依法募集资金,办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申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定各类基金份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度报告、中期报告和年度报告;
(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露,但根据监管机构、司法机关等有权机关的要求,或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要的情况除外;
(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不少于法定期限;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)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实施其他法律行为;
(24)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(25)建立并保存基金份额持有人名册;
(26)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
二、基金托管人
(一)基金托管人简况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
(二)基金托管人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户,为基金办理证券、期货交易资金清算;
(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:
(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
(6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
(7)保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露,但根据监管机构、司法机关等有权机关的要求,或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要的情况除外;
(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;
(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
(10)对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法定期限;
(12)从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册;
(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
(14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按照法律法规和《基金合同》及《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作;
(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;
(19)因违反《基金合同》及《托管协议》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
三、基金份额持有人
基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。
同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:
(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
(7)监督基金管理人的投资运作;
(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:
(1)认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;
(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
(4)交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
(6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
(9)提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息,以及不时的更新和补充,并保证其真实性;
(10)遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则;
(11)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第八部分 基金份额持有人大会
基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
本基金份额持有人大会不设日常机构。
一、召开事由
1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会,但法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外:
(1)终止《基金合同》;
(2)更换基金管理人;
(3)更换基金托管人;
(4)转换基金运作方式;
(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率;
(6)变更基金类别;
(7)本基金与其他基金的合并;
(8)变更基金投资目标、范围或策略;
(9)变更基金份额持有人大会程序;
(10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
(11)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
(12)对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
(13)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:
(1)法律法规要求增加的基金费用的收取;
(2)调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率、变更收费方式、调整基金份额类别设置;
(3)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
(4)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
(5)基金管理人、相关证券/期货交易所和基金登记机构等在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整或修改《业务规则》,包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等内容;
(6)基金推出新业务或服务;
(7)基金管理人调整基金收益分配原则;
(8)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
二、会议召集人及召集方式
1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集;
2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集;
3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合;
4、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开,并告知基金管理人,基金管理人应当配合;
5、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰;
6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
1、召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30日,在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:
(1)会议召开的时间、地点和会议形式;
(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;
(3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;
(4)授权委托证明的内容要求(包括但不限于代理人身份,代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
(5)会务常设联系人姓名及联系电话;
(6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
(7)召集人需要通知的其他事项。
2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。
四、基金份额持有人出席会议的方式
基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。
1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:
(1)亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;
(2)经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。
2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。
在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:
(1)会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;
(2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;
(3)本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;
(4)上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。
3、在法律法规和监管机构允许的情况下,本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。
4、在法律法规和监管机构允许的情况下,本基金的基金份额持有人也可以采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。
五、议事内容与程序
1、议事内容及提案权
议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。
基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。
基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。
2、议事程序
(1)现场开会
在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。
会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。
(2)通讯开会
在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。
六、表决
基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。
基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:
1、一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。
2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。
基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。
七、计票
1、现场开会
(1)如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。
(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。
(3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。
(4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。
2、通讯开会
在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。
八、生效与公告
基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。
基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。
基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。
基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。
九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定
若本基金实施侧袋机制,则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例:
1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上(含10%);
2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);
3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);
4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;
5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人;
6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过;
7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。
同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。
十、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。
十一、本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时,本基金的基金管理人应当代表其基金份额持有人的利益,参与所持有基金的基金份额持有人大会,并在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见,并将表决意见在定期报告中予以披露。

第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序
一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形
(一)基金管理人职责终止的情形
有下列情形之一的,基金管理人职责终止:
1、被依法取消基金管理资格;
2、被基金份额持有人大会解任;
3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产;
4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。
(二)基金托管人职责终止的情形
有下列情形之一的,基金托管人职责终止:
1、被依法取消基金托管资格;
2、被基金份额持有人大会解任;
3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产;
4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。
二、基金管理人和基金托管人的更换程序
(一)基金管理人的更换程序
1、提名:新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人提名;
2、决议:基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议,该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)表决通过,决议自表决通过之日起生效;
3、临时基金管理人:新任基金管理人产生之前,由中国证监会指定临时基金管理人;
4、备案:基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须报中国证监会备案;
5、公告:基金管理人更换后,由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告;
6、交接:基金管理人职责终止的,基金管理人应妥善保管基金管理业务资料,及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续,临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和基金资产净值;
7、审计:基金管理人职责终止的,应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计,并将审计结果予以公告,同时报中国证监会备案,审计费用在基金财产中列支;
8、基金名称变更:基金管理人更换后,如果原任或新任基金管理人要求,应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称字样。
(二)基金托管人的更换程序
1、提名:新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人提名;
2、决议:基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议,该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)表决通过,决议自表决通过之日起生效;
3、临时基金托管人:新任基金托管人产生之前,由中国证监会指定临时基金托管人;
4、备案:基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案;
5、公告:基金托管人更换后,由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告;
6、交接:基金托管人职责终止的,应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料,及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续,新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和基金资产净值;
7、审计:基金托管人职责终止的,应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计,并将审计结果予以公告,同时报中国证监会备案,审计费用在基金财产中列支。
(三)基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序
1、提名:如果基金管理人和基金托管人同时更换,由单独或合计持有基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人;
2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行;
3、公告:新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介上联合公告。
三、新任基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务,或新任基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前,原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责,并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原基金管理人或原基金托管人在继续履行相关职责期间,仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。
四、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对相应内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

第十部分 基金的托管
基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议。
订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责,确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。

第十一部分 基金份额的登记
一、基金份额登记业务
本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。
二、基金登记业务办理机构
本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的,应与代理人签订委托代理协议,以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务,保护基金份额持有人的合法权益。
三、基金登记机构的权利
基金登记机构享有以下权利:
1、取得登记费;
2、建立和管理投资者基金账户;
3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等;
4、在法律法规允许的范围内,对登记业务的办理时间进行调整,并依照有关规定于开始实施前在规定媒介上公告;
5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
四、基金登记机构的义务
基金登记机构承担以下义务:
1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务;
2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务;
3、妥善保存登记数据,并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年;
4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失,须承担相应的赔偿责任,但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外;
5、按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务;
6、接受基金管理人的监督;
7、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第十二部分 基金的投资
一、投资目标
在保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值。
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(含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(以下简称"证券投资基金",不可投资于QDII基金、香港互认基金、货币市场基金、基金中基金、其他可投资基金的基金、非同一基金管理人管理的基金(境内股票型ETF除外)、同一基金经理管理的其他基金;对于上市基金,本基金仅投资于境内股票型ETF;对于非上市基金,本基金仅投资于同一基金管理人旗下的股票型基金、偏股混合型基金)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相关规定)。本基金所指偏股混合型基金包含以下两类:第一类是在基金合同中约定投资于股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例在60%以上的混合型证券投资基金;第二类是过去最近4个季度定期报告中披露的股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例均在60%以上的混合型证券投资基金。
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:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、股票型基金、偏股混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券的比例不超过基金资产的20%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%);投资于证券投资基金的比例不超过基金资产净值的10%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
如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。
三、投资策略
本基金采取稳健的投资策略,通过债券等固定收益类资产的投资力争平稳收益,并适度参与股票等权益类资产及基金的投资增强回报,在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上,力争实现基金资产的持续稳定增值。
1、资产配置策略
本基金80%以上的基金资产投资于债券资产,并在严格控制风险的基础上,综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素(其中,基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据;政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策;市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场P/E与历史平均水平的偏离程度等),结合全球宏观经济形势,研判国内外经济的发展趋势,并在严格控制投资组合风险的前提下,确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。
2、债券投资策略
(1)利率策略
本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构,结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判,从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上,结合期限利差与凸度综合分析,制定出具体的利率策略。
具体而言,本基金将首先采用"自上而下"的研究方法,综合研究主要经济变量指标,分析宏观经济情况,建立经济前景的场景模拟,进而预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势与结构,对影响资金面的因素进行详细分析与预判,建立资金面的场景模拟。
在此基础上,本基金将结合历史与经验数据,区分当前利率债收益率曲线的期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位,判断收益率曲线参数变动的程度与概率,即对收益率曲线平移的方向、陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析,以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现正向平移的概率较大时,即市场利率将上升,本基金将降低组合久期以规避损失;如出现负向平移的概率较大时,则提高组合久期;如收益率曲线过于陡峭时,则采用骑乘策略获取超额收益。
(2)信用策略
信用债券收益率是与其具有相同期限的无风险收益率加上反映信用风险收益的信用利差之和。基准收益率主要受宏观经济环境的影响,信用利差收益率主要受对应的信用利差曲线以及该信用债券本身的信用变化的影响,因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本身信用变化的策略。
本基金投资信用债(包括资产支持证券,下同)的信用评级应在AA级及以上。其中,投资于AA级债券的比例合计不超过信用债资产的20%,投资于AA+级债券的比例合计不超过信用债资产的50%,投资于AAA级债券的比例合计不低于信用债资产的50%。
上述信用评级指债项评级,若无债项评级的,参照主体评级。因证券/期货市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合以上比例限制的,基金管理人不主动新增投资。如因评级下调不满足上述要求的,将在评级报告发布之日起3个月内卖出调整至符合约定。
1)基于信用利差曲线变化的策略
本基金将以下两方面分析信用利差的变化情况,并采取相应的投资策略:
宏观经济环境对信用利差的影响:当宏观经济向好时,信用利差可能由于发债主体盈利能力改善而收窄;反之,信用利差可能扩大。本基金将根据宏观经济的变化情况,加大对信用利差收窄的债券的投资比例。
市场供求关系对信用利差的影响:信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给,而政策的变化、其他类属资产的收益率等也将影响投资者对信用债券的需求,从而对信用利差产生影响。本基金将综合分析信用债券市场容量、市场形势预期、流动性等因素,在具有不同信用利差的品种间进行动态调整。
2)基于本身信用变化的策略
本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。
为了准确评估发债主体的信用风险,本基金采用了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从"行业风险"-"公司风险"(包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况、及企业财务状况)-"外部支持"(外部流动性支持能力及债务担保增信)-"得到评分"的评级过程。其中,定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析,主要包括四个方面:盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究,它是对定量分析的重要补充,能够有效提高定量分析的准确性。
本基金内部的信用评级体系定位为即期评级,侧重于评级的准确性,从而为信用产品的实时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪,发掘相对价值被低估的债券,以便及时有效地抓住信用债券本身信用变化带来的市场交易机会。
3)个券选择策略
本基金将根据信用债券市场的收益率水平,在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上,建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型,并通过这些模型进行估值,重点选择具备以下特征的信用债券:较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善,以及价值尚未被市场充分发现的个券。
(3)可转债及可交换债投资策略
对于本基金中可转债的投资,本基金主要采用可转债相对价值分析策略。
由于可转债兼具债性和股性,其投资风险和收益介于股票和债券之间,可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值,把握可转债的价值走向,选择相应券种,从而获取较高投资收益。
其次,在进行可转债筛选时,本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析,这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等,形成对基础股票的价值评估。本基金将可转债自身的基本面分析和其基础股票的基本面分析结合在一起,最终确定投资的品种。
可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票,而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有债券属性和权益属性,其中债券属性与可转换债券相同,即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息;而对于权益属性的分析则需关注目标公司的股票价值以及发行人作为股东的换股意愿等。本基金将通过对目标公司股票的投资价值、可交换债券的债券价值、以及条款带来的期权价值等综合分析,进行投资决策。
3、国债期货投资策略
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,参与国债期货交易。本基金将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。
基金管理人在进行国债期货投资前将建立国债期货投资决策小组,负责国债期货投资管理的相关事项。
4、股票投资策略
(1)股票精选策略
在股票投资中,本基金主要采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势且估值有吸引力的股票,精心科学构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得当期的较高投资收益。
本基金精选组合成份股的过程具体分为二个层次进行:第一层次,企业竞争优势评估。通过深入的案头分析和实地调研,发现在经营中具有一个或多个方面的持续竞争优势(如公司治理优势、管理层优势、生产优势、市场优势、技术优势、政策性优势等),管理出色且财务透明稳健的企业;第二层次,估值精选。基于定性定量分析、动态静态指标相结合的原则,采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的估值方法,选择股价没有充分反映价值的股票进行投资及组合管理。
(2)港股通标的股票的投资策略
本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。考虑到香港股票市场与A股股票市场的差异,对于港股通标的股票,本基金除按照上述"自下而上"的个股精选策略,还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为,以及世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素,精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。
(3)存托凭证投资策略
本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。
5、基金投资策略
(1)对于非上市证券投资基金,本基金仅投资于同一基金管理人旗下的股票型基金、偏股混合型基金。其中偏股混合型基金包含以下两类:第一类是在基金合同中约定投资于股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例在60%以上的混合型证券投资基金;第二类是过去最近4个季度定期报告中披露的股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例均在60%以上的混合型证券投资基金。基金管理人基于对市场中长期投资趋势的判断,采用定量和定性分析相结合的方法(根据历史业绩、风险调整后的收益、基金规模和流动性、基金评级等一系列量化指标对基金进行分析;运用基金分析评价体系,对基金进行表现分析、归因分析、稳定性分析、个股分析和风险分析),聚焦基金管理人旗下中长期业绩持续稳定、风格清晰,且具备竞争优势的证券投资基金,精选基金构建投资组合,进行中长期持有。
(2)对于上市证券投资基金,本基金仅投资于境内股票型ETF基金。本基金将重点分析基金的长期表现和跟踪效率、基金所跟踪指数和市场的代表性、基金的流动性以及基金的费率。基于上述分析,本基金将在全市场范围中精选出代表性强、跟踪效果好、流动性高、费率低的境内股票型ETF基金。
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)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、股票型基金、偏股混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券的比例不超过基金资产的20%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%);投资于证券投资基金的比例不超过基金资产净值的10%;
(2)每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等;
(3)本基金持有一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额),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(不含本基金所投资的基金份额),不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;
(5)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%;
(6)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%;
(7)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%;
(8)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%;
(9)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;
(10)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%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
(11)本基金参与国债期货交易,应当遵守下列要求:
本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;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的债券总市值的30%;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30%;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、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;
(12)本基金管理人管理的全部开放式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%;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%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;
(13)本基金主动投资于流动性受限资产(含封闭运作基金、定期开放基金等)的市值合计不得超过本基金资产净值的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;
(14)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;
(15)本基金资产总值不超过基金资产净值的140%;
(16)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;
(17)本基金管理人管理的全部基金(ETF联接基金除外)持有单只基金不得超过被投资基金净资产的20%,被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准;
(18)本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额;
(19)本基金投资其他基金时,被投资基金的运作期限应当不少于1年,最近定期报告披露的基金净资产应当不低于1亿元;
(20)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。
因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(17)规定的投资比例的,基金管理人应当在20个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第(2)、(13)、(14)、(17)情形之外,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本基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更以后的规定为准。
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)向其基金管理人、基金托管人出资;
(5)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;
(6)投资其基金中基金、其他可投资基金的基金和本基金基金经理管理的其他基金;
(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其他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。
本基金投资基金管理人或基金管理人关联方管理基金的情况,不属于前述重大关联交易,但是应当按照法律法规或监管规定的要求履行信息披露义务。
法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,则基金管理人在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。
五、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中债新综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%。
中债新综合财富(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,为中国全市场债券指数;样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成份债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,能较好地反映债券市场的整体收益,具有广泛的市场代表性;
沪深300指数由中证指数有限公司编制并发布,指数样本覆盖了沪深两地大部分流通市值,成份股均为A股市场中代表性强且流动性高的主流投资股票,能够反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况,适合作为本基金境内权益类资产投资的业绩比较基准。
如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、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,或者市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准的指数时,经与基金托管人协商一致,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
本基金为债券型基金,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。
本基金除了投资A股以外,还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票,将面临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。
七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法
基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使所投资证券、基金项下的权利,保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使所投资证券、基金项下权利时应遵守以下原则:
1、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;
2、不谋求对上市公司的控股;
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任何不当利益。
八、侧袋机制的实施和投资运作安排
当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,无需召开基金份额持有人大会审议。
侧袋机制实施期间,本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。
侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

第十三部分 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、基金份额、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。
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。
基金管理人、基金托管人因依法解散、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债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

第十四部分 基金资产估值
一、估值日
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、债券、基金份额、国债期货合约、资产支持证券、银行存款本息、应收款项和其它投资等资产及负债。
三、估值原则
基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。
(一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。
与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。
(二)对不存在活跃市场的投资品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。
(三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。
四、估值方法
1、证券交易所上市的有价证券的估值
(1)交易所上市的有价证券(包括股票等),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,最近交易日后经济环境未发生重大变化且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)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,调整最近交易市价,确定公允价格;
(2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(本基金合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;
(3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;
(4)对交易所上市交易的可转换债券,以每日收盘价作为估值全价;
(5)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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,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、转增股、配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,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;
(3)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整,确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则采用估值技术确定公允价值;
(4)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。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,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。
4、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。
5、基金投资同业存单,按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值;选定的第三方估值机构未提供估值价格的,按成本估值。
6、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。
7、本基金持有的回购以成本列示,按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。
8、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示,按相应利率逐日计提利息。
9、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。
10、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。
11、本基金投资存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票进行。
12、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准:当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价,或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。
13、证券投资基金的估值
(1)上市证券投资基金的估值
本基金投资的ETF基金,以其估值日收盘价估值。
(2)非上市证券投资基金的估值
本基金投资的境内非货币市场基金,以其估值日基金份额净值估值。
(3)如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况,本基金根据以下原则进行估值:
1)以所投资基金的基金份额净值估值的,若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值,按其最新公布的基金份额净值为基础估值;
2)以所投资基金的收盘价估值的,若估值日无交易,且最近交易日后市场环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后市场环境发生了重大变化的,可使用最新的基金份额净值为基础或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,确定公允价值;
3)所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分,本基金根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。
(4)当本基金管理人认为所投资基金按前述(1)-(3)项进行估值存在不公允时,应与基金托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。
14、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。
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,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。
五、估值程序
1、各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后,各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,均精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。
基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值,并按规定公告。
2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将各类基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按约定对外公布。
六、估值错误的处理
基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时,视为该类基金份额净值错误。
本基金合同的当事人应按照以下约定处理:
1、估值错误类型
本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人("受损方")的直接损失按下述"估值错误处理原则"给予赔偿,承担赔偿责任。
上述估值错误的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。
2、估值错误处理原则
(1)估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。
(2)估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责。
(3)因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失("受损方"),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已获得的赔偿额加上已获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。
(4)估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。
3、估值错误处理程序
估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:
(1)查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;
(2)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;
(3)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;
(4)根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。
4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:
(1)任一类基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。
(2)错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案,同时进行公告。
(3)前述内容如法律法规或监管机构另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。
七、暂停估值的情形
1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;
4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
八、基金净值的确认
用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值按约定予以公布。
九、特殊情况的处理方法
1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
2、由于不可抗力原因,或由于证券/期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任,但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
十、实施侧袋机制期间的基金资产估值
本基金实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息,暂停披露侧袋账户份额净值。

第十五部分 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、C类基金份额收取的销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用(除法律法规、中国证监会另有规定外);
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、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/期货等交易结算费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的账户开户费用、账户维护费用;
10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用,包括证券组合费、交易征费、股份交收费、交易系统使用费、交易费等;
11、基金投资其他基金产生的其他基金的销售费用,但基金合同另有约定的除外;
12、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
本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额(若为负数,则取0)的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$H=E\times0.5\%\div$当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额,若为负数,则取0
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、休息日等,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。
2、基金托管人的托管费
本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的基金资产净值后余额(若为负数,则取0)的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
$H=E\times0.15\%\div$当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的基金资产净值后余额,若为负数,则取0
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、休息日等,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。
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按前一日C类基金份额资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:
$H=E\times0.4\%\div$当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计提,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、休息日等,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。
4、基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的(ETF除外),应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费(按照相关法律法规、被投资基金招募说明书约定应当收取,并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务费等销售费用。
上述"一、基金费用的种类"中第4-12项费用,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。

(下转D7版)