(上接C1版)

202X年 xx 月 xx 日东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》,内容包括东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金修改运作方式、终止上市、修改投资范围、投资策略、投资组合比例、投资限制及修订基金合同等,并同意将变更注册后基金更名为"东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金",上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。依据基金份额持有人大会决议,基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市,并正式进行转型。

自202x 年 xx 月 xx 日起,《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效,《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

第五部分　基金的存续

一、基金份额的变更登记

根据原《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效当日登记在册的基金份额持有人名册,进行基金份额更名及必要的信息变更。

二、基金存续期内的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,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。

第六部分　基金份额的申购、赎回与转换

一、基金的运作方式

契约型开放式。

除基金合同另有约定外,本基金对每份基金份额设置三年锁定持有期。锁定持有期指基金份额登记日(对基金合同生效前已经持有的份额而言,下同)、基金份额申购申请日(对基金合同生效后申购份额而言,下同)或基金份额转换转入申请日(对基金合同生效后转换转入份额而言,下同)起(即锁定持有期起始日),至基金份额登记日、基金份额申购申请日或基金份额转换转入申请日次三年的年度对日的前一日(即锁定持有期到期日)之间的区间。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期,开放持有期首日为锁定持有期起始日次三年的年度对日。每份基金份额在开放持有期的开放日可以办理赎回及转换转出业务。

二、申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将在基金管理人网站披露的销售机构名录中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在基金管理人网站公示。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。

三、申购与赎回的开放日及时间

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/或赎回,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,若该交易日为非港股通交易日,则基金管理人有权决定本基金是否开放。此外,基金管理人可根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回。

基金合同生效后,若出现新的证券、期货交易市场或证券、期货交易所交易时间变更、其他特殊情况或根据业务需要,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》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期,具体业务办理时间在开放申购业务的公告中规定。

基金管理人有权依法决定本基金开放赎回的时间,具体业务办理时间在开放赎回业务的公告中规定。对于每份基金份额,其锁定持有期结束后即进入开放持有期,但在本基金开始办理赎回前,投资者仍无法办理赎回或转换转出业务。在本基金开始办理赎回业务后,且在开放持有期的开放日,投资者可以办理赎回或转换转出业务。由红利再投资而来的基金份额不受锁定持有期的限制;基金份额持有人通过二级市场买入的基金份额在转型后,亦不受锁定持有期的限制。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应当在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规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、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

四、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、基金份额持有人赎回时,除指定赎回外,基金管理人对可赎回份额按"先进先出"进行处理,即按照基金份额持有人份额登记日期的先后次序进行顺序赎回,并确定所适用的赎回费率;

5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下,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按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

五、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,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时,其在销售机构必须有足够的基金份额余额。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;基金份额登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者赎回申请生效后,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、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他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,赎回款项顺延至前述因素消失日的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本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本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。否则,如因申请未得到基金登记机构的确认而造成的损失,由投资者自行承担。若申购不成立或无效,则申购款项退还给投资人。

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、赎回的确认以基金登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,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。

基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下,对上述业务办理时间进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购与赎回的数额限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额。具体规定请参见《招募说明书》或相关公告;

2、基金管理人可以规定投资人每个交易账户的最低基金份额余额。具体规定请参见《招募说明书》或相关公告;

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》或相关公告;

4、基金管理人可以规定单一投资者单日或单笔申购金额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告;

5、基金管理人可以规定本基金的总规模限额、当日申购金额限制和单日净申购比例上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告;

6、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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告;

7、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制,或者新增基金规模的控制措施。基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

七、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。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,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。

2、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

4、本基金的申购费用由投资人承担,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。

5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定,具体见招募说明书的规定,未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中,对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费,并全额计入基金财产。

6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。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》的有关规定在规定媒介上公告。

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,并履行相关信息披露义务。摆动定价机制的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、自律组织的规定,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

8、基金管理人及本基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人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(如需),基金管理人及本基金销售机构可以适当开展本基金的销售费率的优惠活动。

八、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,基金管理人可暂停或拒绝接受投资人的申购申请;

3、证券、期货交易场所在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、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,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形;

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,基金管理人应当暂停接受基金申购申请;

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行;

8、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,基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请;

9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资人单日或单笔申购金额上限,基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请;

10、基金参与港股通交易且港股通交易每日额度不足,或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务,或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形;

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、10、11项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

九、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可以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,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;

3、证券、期货交易场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、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,基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请;

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,基金管理人应延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请;

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,并根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回公告。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,未支付部分可延缓支付。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,并依照有关规定在规定媒介上公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

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)超过上一工作日基金总份额的10%时,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、延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停赎回。

(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工作日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占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,如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,默认采用延期赎回或取消赎回以各销售机构的具体规定为准。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。

(3)发生巨额赎回,且单个基金份额持有人赎回申请超过上一工作日基金总份额30%的情形下,对单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额30%的赎回申请,基金管理人可以延期办理赎回。对该单个基金份额持有人30%以内(含30%)的赎回申请按普通基金份额持有人(即其他赎回申请未超过上一工作日基金总份额30%的基金份额持有人)赎回程序(包括巨额赎回)办理。对于未能赎回部分,该基金份额持有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。

基金管理人在履行适当程序后,有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则,并在规定媒介上进行公告。

(4)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,并应当在规定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并采取相关措施时,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,并在两日内在规定媒介上刊登公告。

十一、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、基金管理人应于恢复开放申购或赎回日前,在规定媒介上刊登基金恢复开放申购或赎回公告,并公布最近1个工作日的基金份额净值。

十二、基金的转换

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。

十三、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基金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。

十四、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、离婚、捐赠、法人资格丧失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。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;捐赠是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;法人资格丧失是指法人股东因解散、破产、合并、分立、歇业、注销等原因,在法人资格丧失后将其持有的基金份额划转给其他自然人或机构;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。

十五、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。

十六、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。

十七、基金份额的冻结与解冻

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,被冻结部分份额仍然参与收益分配,被冻结部分产生的权益一并冻结。法律法规或监管机构另有规定的除外。

十八、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。

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:上海东方证券资产管理有限公司

住所:上海市黄浦区中山南路109号7层-11层

法定代表人:杨斌

设立日期:2010年7月28日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2010]518号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号:证监许可[2013]1131号

组织形式:有限责任公司

注册资本:3亿元人民币

存续期限:持续经营

联系电话:(021)53952888

联系人:彭轶君

(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、委托、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)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;

(14)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;

(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)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、转换等的业务规则;

(17)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,向监管机构、司法机关等有权机关及审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外;

(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最低期限;

(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;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

(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

法定代表人:吴利军

成立时间:1992年6月18日

组织形式:股份有限公司

注册资本:466.79095亿元人民币

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【2002】75号

批准设立机关和批准设立文号:国务院、国函[1992]7号

联系电话:010- 63636363

(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)以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券托管账户;

(6)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(7)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(8)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,向监管机构、司法机关等有权机关及审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外;

(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、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最低期限;

(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》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业监督管理机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》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。

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)交纳基金认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)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、除法律法规、中国证监会另有规定外,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:

(1)终止《基金合同》,《基金合同》另有约定的除外;

(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;

(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一致并履行适当程序后修改,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和其他应由基金承担的费用;

(2)调整本基金的申购费率或变更收费方式;

(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)增加新的基金份额类别或调整基金份额分类规则;

(6)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六十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、方式和会议形式;

(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,由会议召集人决定并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及投票方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见提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大会公告载明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大会公告载明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表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,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);若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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表决意见或授权他人代表出具表决意见;

(4)上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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需符合法律法规、《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关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用网络、电话、短信等其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会;在会议召开方式上,本基金亦可采用网络、电话、短信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,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

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二分之一以上(含二分之一)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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外,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,但应当计入出具表决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事项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表决意见或授权他人代表出具表决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。

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2/3以上(含2/3)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符合法律法规规定的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;

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2/3 以上(含2/3)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。新任基金托管人或者临时基金托管人应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符合法律法规规定的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。

(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当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、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。

四、新任基金管理人/临时基金管理人接收基金管理业务或新任基金托管人/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。

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、基金份额的登记业务

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,但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除。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和办理非交易过户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法定最低期限;

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

本基金在严格控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。

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及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债(含证券公司发行的短期公司债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经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)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务。

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。

本基金的投资比例为:

本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例为基金资产的60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%)。

本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金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净值的5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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,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

(一)资产配置

本基金通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票、债券和现金类大类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。

(二)股票投资策略

本基金利用基金管理人投研团队的资源,对企业内在价值进行深入细致的分析,并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好的上市公司股票(含存托凭证)进行投资。

1、个股选择

基金管理人的股票研究团队将深入调研上市公司、公司竞争对手以及产业链上下游,挑选出优质的上市公司股票进行投资。对于个股是否纳入投资组合,基金管理人会重点关注3个方面:公司素质、公司的成长空间及未来盈利增速、目前个股估值。其中公司素质是基金管理人最看重的因素,包括公司商业模式的独特性、竞争壁垒、行业地位、公司管理层的品格和能力等方面。同时本基金还会密切关注上市公司的可持续经营发展状况,从环境、社会、公司治理三个方面对上市公司进行评估。对于具有优秀基因的上市公司,如果公司成长性和股票估值相匹配,基金管理人将会纳入本基金投资组合;否则会将其放入股票库并持续跟踪。

2、港股通标的股票投资策略

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,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注:

1)具有持续领先优势或核心竞争力的企业,这类企业应具有良好成长性或为市场龙头;

2)符合内地政策和投资逻辑的行业个股;

3)与A股同类公司相比具有估值优势的公司。

3、存托凭证的投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述内地上市交易的股票投资策略执行。

(三)可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的投资策略

本基金投资可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券有两种途径,一级市场申购和二级市场参与。一级市场申购,主要考虑发行条款较好、申购收益较高、公司基本面优秀的个券。二级市场参与可采用多种投资策略,本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略,精选个券,力争实现较高的投资收益;同时,本基金也可以采用相对价值分析策略,即通过分析不同市场环境下可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券股性和债性的相对价值,把握其价值走向,选择相应券种,力争获取较高投资收益。另外,本基金将密切关注可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的套利机会和条款博弈机会。

(四)其他固定收益类证券投资策略

本基金的固定收益类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的、具有良好流动性的金融工具。固定收益投资主要用于提高非股票资产的收益率,基金管理人将坚持价值投资的理念,严格控制风险,追求合理的回报。

在债券投资方面,基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础,依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标,结合货币政策、财政政策的实施情况,以及国际金融市场基准利率水平及变化情况,预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,进行定量评价。

(五)资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率等方面来考虑,采用自下而上的项目精选策略,以资产支持证券的优先级或次优级为投资标的,精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。对不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略,在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法,以基金管理人的内部信用风险评估为主,并结合外部信用评级机构的分析报告,最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外,鉴于资产支持证券的流动性较差,本基金更倾向于配置久期较短的品种。

(六)股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理原则,以套期保值为目的,以回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约,并与股票现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作。

(七)国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理原则,以套期保值为目的,以回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约,并与债券现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作。

(八)股票期权投资策略

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。本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。

(九)信用衍生品投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以风险对冲为目的参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略,审慎开展信用衍生品投资,合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时,本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理,合理分散交易对手方、创设机构的集中度,对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。

(十)参与融资业务策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规和监管要求发生变化,本基金将从其最新规定,以符合法律法规和监管要求的变化。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新公告。

四、投资限制

(一)投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例为基金资产的60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%);

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,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。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)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;

(4)本基金持有一家公司发行的证券,其市值(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算)不超过基金资产净值的10%;

(5)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算),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;

(6)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定期开放基金)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;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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;

(12)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(13)本基金参与股指期货和/或国债期货交易时,应当遵守下列要求:

1)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%,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%。

2)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%,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%。

3)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%,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%。

4)基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。

5)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;

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;

(14)本基金参与股票期权交易的,应当符合下列要求:

1)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)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物;

3)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乘以合约乘数计算;

(15)本基金不得持有信用保护卖方属性的信用衍生品,不得持有合约类信用衍生品,持有的信用衍生品的名义本金不得超过本基金对应受保护债券面值的100%;

(16)本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的10%;

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不符合前述(15)、(16)所规定比例限制的,基金管理人应在3个月之内进行调整;

(17)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;

(18)本基金主动投资于流动性受限资产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前款所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(19)参与融资业务后,在任何交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;

(20)本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行;

(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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,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,基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在规定媒介公告。

(下转C3版)