广发策略优选混合型证券投资基金招募说明书

(**上接** B10 **版**)

联系人:盛云
电话:021-62476600-3019
传真:021-62474651
客户服务热线:021-962506
公司网址:www.dfzq.com.cn
(13)名称:光大证券有限责任公司
住所:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔15楼
法定代表人:王明权
联系人:刘晨
电话:021-68816000
传真:021-68815009
客户服务电话:021-68823685
公司网址:www.ebscn.com
(14)名称:国信证券有限责任公司
住所:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:何如
联系人:林建闽
电话:0755-82130833-2181
传真:0755-82133302
客户服务电话:800-810-8868
公司网址:www.guosen.com
(15)名称:海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
联系人:金芸
电话:021-53594566
传真:021-53858549
客户服务热线:021-962503
公司网址:www.htsec.com
(16)名称:中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:黎晓宏
联系人:权唐
电话:010-65186758
传真:010-65182261
咨询电话:400-8888-108
公司网址:www.csc108.com
(17)名称:联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马国强
联系人:范雪玲
电话:0755-82492000
传真:0755-82492062
客户服务热线:400-8888-555
公司网址:www.lhzq.com
(18)名称:平安证券有限责任公司
办公地址:深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:杨秀丽
联系人:苗永华
电话:0755-82440136
传真:0755-82433794
客户服务电话:95511
公司网址:www.pa18.com
(19)名称:招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层
法定代表人:宫少林
联系人:黄健
电话:0755-82943511
传真:0755-82943237
客户服务热线:400-8888-111、0755-26951111
公司网址:www.newone.com.cn
(20)名称:中银国际证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区区银城中路中银大厦39层
法定代表人:平岳
联系人:张静、金坚
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务热线:021-68604866
公司网址:www.bocichina.com
(21)名称:山西证券有限责任公司
住所:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:吴晋安
联系人:刘文康
电话:0351-8686708
传真:0351-8686709
客户服务热线:0351-8686868
公司网址:www.i618.com.cn
(22)名称:湘财证券有限责任公司
住所:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:陈学荣
联系人:陈伟
电话:021-68634818-8631
传真:021-68865938
客户服务热线:021-68865020
公司网址:www.xcsc.com www.eestart.com
(23)名称:东海证券有限责任公司
住所:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼
法定代表人:顾森贤
联系人:龙涛
电话:021-50588876
传真:021-50586660-8880
客户服务电话:010-86525005(北京)、021-62196752(上海)、0755-83154530(深圳)、0519-6634000(常州)。
公司网址:www.longone.com.cn
(24)名称:东吴证券有限责任公司
住所:苏州市十梓街298号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
公司网址:www.dwzq.com.cn

二、申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理,基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前2个工作日在至少一家指定媒体公告。

投资人应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间另行公告。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日的相应价格。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对申购、赎回时间进行调整,但此项调整应报中国证监会备案,并在实施日2日前在至少一家指定媒体公告。

三、申购与赎回的限制

1、通过代销机构或本公司网上交易系统(目前仅对个人投资者开通)每个基金账户每次最低申购金额(含申购费)为1,000元人民币(中国工商银行股份有限公司销售网点申购的最低额为人民币5,000元);投资人追加申购时最低申购限额及投资金额级差详见各代销机构网点公告。

2、直销机构网点每个账户首次申购的最低金额为50,000元人民币(含申购费);已在直销机构网点有认购记录的投资人不受申购最低金额的限制。

3、基金份额持有人赎回本基金的最低份额为100份基金份额,基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,但某笔赎回导致该基金份额持有人在一个网点的基金份额余额少于相应的最低赎回限额时,余额部分的基金份额必须一同赎回。

4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定的申购的金额和赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前2个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上公告并报中国证监会备案。

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(现定为开放日15:00)前撤销;

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施日2个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

五、申购与赎回的程序

1、申购、赎回的申请方式

基金投资人必须根据基金份额发售机构规定的手续,在开放日的业务办理时间向基金份额发售机构提出申购、赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按基金份额发售机构规定的方式备足申购资金,投资人在提交赎回申请时,必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购、赎回申请的确认与通知

T日规定时间受理的申请,正常情况下,基金注册与过户登记人在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认,在T+2日后(包括该日)投资人可向基金份额发售机构或以基金份额发售机构规定的其它方式查询申购、赎回的成交情况。

3、申购和赎回款项支付的方式与时间

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功,若申购不成功或无效,申购款项将退回投资人账户。

投资人赎回申请成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时,款项的支付办法参照本《基金合同》的有关条款处理。

六、申购费率与赎回费率

1、申购费率

(1)投资人可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资人选择在申购时交纳的称为前端申购费用,投资人选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

(2)投资人选择交纳前端申购费用时,按申购金额采用比例费率。投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

申购金额(M)	费率
M〈100万元	1.5%
100万元≤M〈500万元	0.9%
500万元≤M〈1000万元	0.3%
M≥1000万元	每笔1000元

(3)投资人选择交纳后端申购费用时,申购费率按持有时间递减.具体费率如下:

持有期限(N)	费率
N＜1年	1.8%
1年≤N＜2年	1.5%
2年≤N＜3年	1.2%
3年≤N＜4年	0.9%
4年≤N＜5年	0.5%
N≥5年	0

(4)本基金的申购费用由申购人承担,可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金资产。

(5)基金管理人对部分基金持有人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

2、赎回费率

投资人在赎回基金份额时,应交纳赎回费。赎回费总额的25%计入基金财产,扣除计入基金财产部分,赎回费的其他部分用于支付注册登记费和必要的手续费。赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减,具体费率如下:

赎回期限(N)	赎回费率
N＜1年	0.5%
1年≤N＜2年	0.3%
N≥2年	0

3、基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率和赎回费率,最新的申购费率和赎回费率在《招募说明书(更新)》中列示。费率如发生变更,基金管理人最迟应于新的费率开始实施2日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、基金申购份额的计算

如果投资人选择交纳前端申购费用,则申购份数的计算方法如下:

前端申购费用=申购金额×前端申购费率
净申购金额=申购金额-前端申购费用
申购份数=净申购金额/T日基金份额净值

例:某投资人投资10,000元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.05元,则可得到的申购份额为:

申购费用=10,000×1.5%=150元
净申购金额=10,000-150=9,850元
申购份额=9,850/1.0500=9,380.95份

即:投资人投资10,000元申购本基金,其对应费率为1.5%,假设申购当日基金份额净值为1.0500元,则其可得到9,380.95份基金份额。

如果投资人选择交纳后端申购费用,则申购份数的计算方法如下:

申购份数=申购金额/T日基金份额净值

例:某投资人投资10,000元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.0500元,则可得到的申购份额为:

申购份额=10000/1.0500=9,523.81份

即:投资人投资10,000元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.0500元,则其可得到9,523.81份基金份额。但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

2、基金赎回支付金额的计算

如果投资人在认购或申购时选择交纳前端认购或申购费用,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用

例:某投资人赎回本基金10,000份基金份额,持有时间为一年两个月,对应的赎回费率为0.3%,假设赎回当日基金份额净值是1.0500元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=10,000×1.05=10500元
赎回费用=10,500×0.3%=31.50元
赎回金额=10,500-31.50=10468.50元

即:投资人赎回本基金1万份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是1.0500元,则其可得到的赎回金额为10,468.5元。

如果投资人在认购时选择交纳后端认购费用,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值
后端认购费用=赎回份额×认购日基金份额资产净值×对应的后端认购费率
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-后端认购费用-赎回费用

例:某投资人赎回本基金10,000份基金份额,持有时间为一年两个月,对应的后端认购费率为1.5%,对应的赎回费率为0.3%,假设赎回当日基金份额净值是1.0500元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=10,000×1.0500=10500元
后端认购费用=10,000×1.0000×1.5%=150元
赎回费用=10,500×0.3%=31.50元
赎回净额=10,500-150-31.50=10,318.50元

即:投资人赎回本基金1万份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是1.0500元,则其可得到的赎回金额为10,318.50元。

如果投资人在申购时选择交纳后端申购费用,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值
后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×对应的后端申购费率
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-后端申购费用-赎回费用

例:某投资人赎回本基金10,000份基金份额,持有时间为一年两个月,对应的后端申购费率为1.5%,对应的赎回费率为0.3%,假设申购日基金份额净值为1.0200元,赎回当日基金份额净值是1.0500元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=10,000×1.05=10,500元
后端申购费用=10,000×1.02×1.5%=153元
赎回费用=10,500×0.3%=31.50元
赎回净额=10,500-153-31.50=10,315.50元

即:投资人赎回本基金1万份基金份额,假设赎回当日基金份额净值是1.0500元,则其可得到的赎回金额为10,315.50元。

3、基金份额净值计算

T日基金份额净值=T日基金资产净值/T日基金份额总数。

基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数,基金份额净值单位为元,计算结果保留在小数点后四位,小数点后第五位四舍五入。

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,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

4、申购份额的处理方式:申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算,计算结果保留到小数点后二位,第三位四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。

5、赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用,计算结果保留到小数点后二位,第三位四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。

八、申购与赎回的注册登记

投资人申购基金成功后,注册与过户登记人在T+1日自动为投资人登记权益并办理注册与过户登记手续,投资人自T+2日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金成功后,注册与过户登记人在T+1日自动为投资人办理扣除权益的注册与过户登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册与过户登记办理时间进行调整,但不得实质影响投资人的合法权益,并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理

除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请:

(1)不可抗力的原因导致基金无法正常运作;

(2)证券交易场所在交易时间非正常停市,导致当日基金资产净值无法计算;

(3)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,或可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益;

(4)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;

(5)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述(1)到(4)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家中国证监会指定的媒体刊登暂停申购公告。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项,但基金管理人有正当理由认为需要暂停基金申购,应当报中国证监会批准。经批准后,基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项:

(1)不可抗力的原因导致基金无法正常运作;

(2)证券交易场所交易时间非正常停市,导致当日基金资产净值无法计算;

(3)因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回,导致本基金的现金支付出现困难;

(4)法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应当在当日立即向中国证监会报告备案。已接受的赎回申请,基金管理人将足额支付;如暂时不能足额支付的,可支付部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时在出现上述第(3)款的情形时,对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项,最长不超过正常支付时间20个工作日,并在至少一家中国证监会指定的媒体公告。投资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。

暂停基金的赎回,基金管理人应及时在至少一家中国证监会指定的媒体上刊登暂停赎回公告。

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。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日,基金净赎回申请(净赎回申请=赎回申请总数+基金转换中转出申请份额总数-申购申请总数-基金转换中转入申请份额总数)超过上一日基金总份额的10%时,即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时,基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)部分顺延赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请可能会对基金的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日基金总份额的10%的前提下,对其余赎回申请延期予以办理。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;投资人未能赎回部分,除投资人在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外,自动转为下一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算,并以此类推,直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3)巨额赎回的公告:本基金发生巨额赎回并顺延赎回时,基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告,同时以邮寄、传真等方式通知基金份额持有人,并说明有关处理方法。

本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过正常支付时间20个工作日,并应当在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

十二、重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天,基金管理人应于重新开放日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周,暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

十三、基金转换

为方便基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,投资人可以选择在本基金和本基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定由基金管理人届时另行规定并公告。

十四、转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资人可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

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。

十六、基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式,将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为。

基金注册与过户登记人只受理继承、捐赠、司法执行等情况下的非交易过户。其中,“继承”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”只受理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的情形;“司法执行”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、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下,接受划转的主体应符合相关法律和基金合同规定的持有本基金份额的条件。办理非交易过户必须提供相关资料。

注册登记人受理上述情况下的非交易过户,其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定办理。

十七、基金的冻结与解冻

基金注册与过户登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,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与支付。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

通过综合运用多种投资策略优选股票,分享中国经济和资本市场高速增长的成果,为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

二、投资范围

本基金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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的配置比例为30%-95%,债券资产的配置比例为0-65%,权证的配置比例为0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券大于等于5%。

三、投资理念

研究创造价值,前瞻、系统、科学的研究是投资的驱动力。

四、投资策略

(一)资产配置策略

本基金将主要根据下述因素的判断,确定资产配置策略:

(1)宏观经济因素

宏观经济形势从两个方面影响股市,一是对上市公司的业绩产生影响,二是改变投资人的投资行为。由于股市往往对宏观经济进行提前反映,因此,本基金管理人将重点关注一些宏观先行指标。

(2)政策因素

我国政府对经济体系的宏观调控能力很强,可以说,政策是影响股市运行的核心因素之一。本基金管理人将重点关注的政策因素包括:财政政策、货币政策和证券市场宏观管理政策。

(3)资金供求因素

资金供求是决定我国证券市场运行的重要因素。

(4)市场波动周期

市场脉动节奏呈现明显的周期特征,投资进出时机的把握对提高投资收益有着极为重要的作用。

(二)股票投资策略

本基金股票投资策略主要通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票构建股票投资组合。

具体的投资策略包括:

1、主题投资策略:此种投资策略就是通过对宏观经济中制度性、结构性或周期性的发展趋势或发展动力进行前瞻性的研究与分析,挖掘并投资于集中代表整个市场阶段发展趋势的上市公司。

本基金使用主题投资分析框架(Thematic Investing Analysis Frame)进行主题投资的分析研究,所遵循的步骤如下:

(1)首先寻找经济社会发展变化的趋势:即明确经济结构或产业即将发生的根本性变化,分析这些根本性变化的内涵和寓意。

(2)继而认清使该种趋势产生和持续的内在驱动因素:即有效分析经济运行中真正起作用的驱动因素,客观清楚的认识证券市场的发展规律与发展趋势。

(3)最后将能够从这种趋势中受惠的公司纳入投资范围:即找出充分代表或体现该投资主题的公司,经过全方位的周密调查研究后建立主题投资组合。

(4)重复以上过程,不断的寻找、发现、研究新的主题投资机会。

2、买入持有策略:此种投资策略主要投资的对象为相对价值被低估的成长型股票,通过长期持有分享高成长性所带来的收益。具体应用GARP(Growth at Reasonable Price)选股法进行股票选择。

GARP选股法重视股票投资价值与成长潜力的平衡,既规避投资标的价格高企的风险,又具备高速成长的优势。应用GARP选股法选择出的股票,会有潜在的两个收益渠道:没有考虑成长潜力下,价值回归中的投资收益;成长潜力释放带来的价值增长。

3、逆向投资策略:此种投资策略主要投资的对象为相对价值被低估的价值型股票,待其价值回归后沽出获利。主要通过以下两方面因素的考察来选取股票:

(1)低市盈率或市净率

首先采用定量工具定期计算库中个股的市盈率和市净率,找出市盈率或市净率较低的公司股票。造成股票市盈率(市净率)较低可能有宏观、微观、产业三个方面的原因,因此需要进一步分析其基本面是否存在某些向好因素以支撑公司价值回归,并挖掘其投资机会。

(2)定性分析

然后基金管理人将对选出股票的“低价因素”进行合理分析,从中找到基本面素质较好,股价可望在短时间内回归的公司。

(三)债券投资策略

1、利率预测

债券投资策略的关键是对未来利率走向的预测,并及时调整债券组合使其保持对利率波动的合理敏感性。本基金将在利率合理预期的基础上,通过久期管理,稳健地进行债券投资,控制债券投资风险。尤其是在预期利率上升的时候,严格控制,保持债券投资组合较短的久期,降低债券投资风险。

2、收益曲线策略

收益曲线策略是以对收益率曲线形状变动的预期为依据建立或改变组合头寸。要运用收益曲线策略,必须先确定收益曲线变动的类型以及各种变动对组合收益率变动的影响。

3、债券类别配置

(1)一、二级市场配置

随着国债发行市场化的增强,本基金管理人将充分考量一级、二级市场的风险收益,并拟订配置策略。

(2)银行间债券市场和交易所市场配置

就目前而言,银行间债券市场流动性不如交易所市场。本基金将在均衡流动性和收益性的基础上合理配置两个市场的投资比例。

(3)债券品种配置

我国债券市场目前发展较为成熟且流动性较好的是国债与金融债市场,这将是本基金债券投资的主要品种;随着未来企业债与可转债市场的发展,本基金将在控制投资风险的基础上合理增加其投资比重。

(四)权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。根据有关规定,本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制:

1、本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。

2、本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的百分之三。

3、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制,履行适当程序后,不受上述条款限制。

五、投资决策依据和决策程序

1、决策依据

以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

(1)投资决策委员会制定整体投资战略。

(2)研究发展部根据自身或者其他研究机构的研究成果,构建股票备选库,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供个股、债券决策支持。

(3)基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,在研究部门研究报告的指引下,结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、行业配置、重仓个股投资方案。

(4)投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

(5)根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易室执行。

(6)中央交易室按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理小组。

(7)金融工程小组定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

(8)风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;金融工程小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

六、投资限制

(一)禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

1、承销证券;

2、向他人贷款或提供担保;

3、从事可能使基金承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但国务院另有规定的除外;

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者其基金管理人、基金托管人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;

7、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

8、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

(二)投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

1、本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;

2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;

3、本基金不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;

4、基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

5、本基金的建仓期为6个月;

6、《证券投资基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例,基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

七、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华雷曼中国全债指数。

如果新华富时指数有限公司停止计算编制这些指数或更改指数名称,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。

如果今后法律法规发生变化,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,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。

采用该比较基准主要基于如下考虑:

1、作为专业指数提供商提供的指数,新华富时指数体系具有一定的优势和市场影响力;

2、在新华富时指数体系中,新华富时A600指数的市场代表性比较强,比较适合作为股票投资的比较基准;而新华雷曼中国全债指数能够较好的反映债券市场变动的全貌,比较适合作为本基金债券投资的比较基准。

八、风险收益特征

较高风险、较高收益

九、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、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;

2、有利于基金资产的安全与增值;

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金投资人的利益。

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金投资人的利益。

十、基金的融资

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资。

十一、基金管理人和基金经理的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

(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)不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本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;

(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(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)违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,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;

(8)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;

(9)贬损同行,以抬高自己;

(10)以不正当手段谋求业务发展;

(11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

(13)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

(3)不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,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)不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

第十部分 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、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。

其构成主要有:

1、银行存款及其应计利息;

2、清算备付金及其应收利息;

3、根据有关规定缴纳的保证金;

4、应收证券交易清算款;

5、应收申购款;

6、股票投资及其估值调整;

7、债券投资及其估值调整和应计利息;

8、其他投资及其估值调整;

9、其他资产等。

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

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务,并以基金托管人和“广发策略优选混合型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“广发策略优选混合型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人和基金注册与过户登记人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代理人的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产;基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益,归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记人和基金销售代理人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消;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消。

第十一部分 基金资产的估值

一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值,依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值,是计算基金申购与赎回价格的基础。

二、估值日和定价时点

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日。

三、估值方法

本基金按以下方式进行估值:

1、已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票,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,以最近交易日的市价(收盘价)估值;

在证券交易所市场流通的债券,按如下估值方式处理:

(1)实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值。

(2)未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

(3)已上市流通的权证,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,以最近交易日的市价(收盘价)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、配股和增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行的股票,按成本估值;

(3)处于未上市期间的权证,例如权证发行至上市日之间、权证停牌日等情况,可应用B-S模型等估值技术确定其公允价值。

3、银行间债券市场债券按成本估值。

4、配股权证,从配股除权日起到配股确认日止,如果收盘价高于配股价,按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

5、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。

6、债券利息收入、存款利息收入、买入返售证券收入等固定收益的确认采用权责发生制原则。

7、股利收入的确认采用权责发生制原则。

8、如有新增事项,按国家最新规定估值。

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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资产净值的计算结果对外予以公布。

四、估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息等资产。

五、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后,将估值结果加盖业务公章以书面形式传真至基金托管人,基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核;基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人;月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

六、基金份额净值的确认和估值错误的处理

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。当基金估值出现影响基金份额净值的错误时,基金管理人应当立即纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;估值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资人造成损失的,应先由基金管理人承担,基金管理人对不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。

关于差错处理,本合同的当事人按照以下约定处理:

1、差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或注册与过户登记人、或代理销售机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错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;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

(1)差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的由差错责任方承担;若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

(2)差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3)因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责,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”),则差错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经获得的赔偿额加上已经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差错责任方。

(4)差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金资产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金资产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1)查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4)根据差错处理的方法,需要修改基金注册与过户登记人的交易数据的,由基金注册与过户登记人进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认;

(5)基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

七、暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所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无法准确评估基金资产价值时;

3、中国证监会认定的其他情形。

八、特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第4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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,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,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

第十二部分 基金的收益分配

一、基金收益的构成

基金收益包括:基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,分配比例不低于可分配收益的50%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

4、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

6、每一基金份额享有同等分配权;

7、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金净收益、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,提前2个工作日在至少一家中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

六、基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记人可将投资人的现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照广发基金管理有限公司开放式基金有关业务规定执行。

第十三部分 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、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费和律师费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、银行汇划费用;

9、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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

管理费的计算方法如下:

H=E×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

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

基金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×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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3、销售服务费

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

由于相关法律法规未正式颁布,本基金暂时不收取销售服务费。若相关法律法规允许本类型基金提取销售服务费或者增加销售服务费作为投资人可以选择的收费方式,则本基金可以提取销售服务费,在相关法律法规允许的费率范围内,与托管人协商一致并履行适当程序后收取。基金管理人依据本基金合同及届时有效的有关法律法规公告收取基金销售服务费或酌情降低基金销售服务费的,无须召开基金份额持有人大会。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×F÷当年天数
H为每日应支付的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值
F为销售服务费费率

基金销售服务费每日计算,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销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2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。若相关法律法规或监管机构对销售服务费的计算方法、提取方式或者其他事项另有规定,则从其规定。

上述“一、基金费用的种类”中第4-8项费用由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,从基金财产中支付。

三、本基金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财产的损失;

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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

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、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率、基金销售费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告并报中国证监会备案。

五、基金税收

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。

第十四部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方;

2、基金的会计年度为公历年度1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果基金合同生效少于3个月,可以并入下一个会计年度;

3、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

4、会计制度执行国家有关的会计制度;

5、基金独立建账、独立核算;

6、基金管理人应保留完整的会计帐目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表;

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金年度审计

1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人和基金托管人同意,并报中国证监会备案。

3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所,须经基金托管人(或基金管理人)同意,并报中国证监会备案。更换会计师事务所在2个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

第十五部分 基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露,并保证基金投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;

2、对证券投资业绩进行预测;

3、违规承诺收益或者承担损失;

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构;

5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;

6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

一、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

(1)基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后,基金管理人在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上;基金管理人在公告的15日前向其经营所在地的证监局报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

(2)基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资人重大利益的事项的法律文件。

(3)基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、基金募集情况公告

基金管理人应当就基金份额发售的结果编制基金募集情况公告,并在募集期结束的次日登载于指定报刊和网站上。

4、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

5、基金资产净值、基金份额净值

本基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

6、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

7、基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足2个月的,本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

8、临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,予以公告,并按照规定在公开披露日报中国证监会或者本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

(1)基金份额持有人大会的召开;

(2)终止《基金合同》;

(3)转换基金运作方式;

(4)更换基金管理人、基金托管人;

(5)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

(6)基金管理人股东及其出资比例发生变更;

(7)基金募集期延长;

(8)基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;

(9)基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;

(10)基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;

(11)涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;

(12)基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;

(13)基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;

(14)重大关联交易事项;

(15)基金收益分配事项;

(16)管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

(17)基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;

(18)基金改聘会计师事务所;

(19)变更基金份额发售机构;

(20)基金更换注册登记机构;

(21)本基金开始办理申购、赎回;

(22)本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;

(23)本基金发生巨额赎回并延期支付;

(24)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;

(25)本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;

(26)中国证监会规定的其他事项。

9、澄清公告

在本基金合同存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案,并予以公告。召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前40日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

(**下转** 12 **版**)