富国天博创新主题股票型证券投资基金招募说明书

(上接 A25 版)

公司网站:www.xyzq.com

(22)国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路 46 号
办公地址:广西南宁市滨湖路 46 号
法定代表人:张雅锋
电话:(0771)5539262
传真:(0771)5539033
联系人:覃清芳
客服热线:4008888100(全国)、96100(广西)
公司网站:www.ghzq.com.cn

(23)国信证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16－26 层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16－26 层
法定代表人:何如
联系电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133302
联系人:林建闽
客户服务统一咨询电话:800-810-8868
公司网站:www.guosen.com.cn

(24)国元证券有限责任公司
注册地址:合肥市寿春路 179 号
办公地址:合肥市寿春路 179 号
法定代表人:凤良志
联系人:李蔡
传真:(0551)2634400-1171
开放式基金咨询电话:安徽地区:96888;全国:400-8888-777
公司网站:www.gyzq.com.cn

(25)华泰证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系电话:(025)84457777-721
传真:(025)84579879
联系人:李金龙
客户咨询电话:(025)84579897
公司网站:www.htsc.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格,并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员(以下简称"有资格的上证所会员"),名单详见上海证券交易所网站:

http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjjt.jsp

(二)注册登记机构:
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
办公地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
法定代表人:陈耀先
电话:(010)58598839
传真:(010)58598834
联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
注册地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
负责人:廖海
联系电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
联系人:廖海
经办律师:廖海、吕红

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永大华会计师事务所有限责任公司
注册地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼
办公地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼
法定代表人:沈钰文
联系电话:(021)24052000
传真:(021)54075507
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

六、基金的历史沿革

本基金由汉博证券投资基金(下称"基金汉博")转型而成。

基金汉博由"淄博基金"、"通发基金"和"三峡基金"经重组规范、合并而来。三基金全称分别为"淄博乡镇企业投资基金公司"、"通发有价证券投资基金"、"三峡投资基金"。其历史沿革如下:

"淄博基金"是经中国人民银行银复(1992)424 号批准成立的公司型、封闭式信托投资基金,由原中国农村发展信托投资公司(现已被中国建银投资有限责任公司托管)、淄博市信托投资公司、交通银行淄博支行(后转为海通证券有限公司)、山东证券有限责任公司、中国工商银行山东信托投资股份公司(后转为山东省齐鲁信托投资有限公司)为基金发起人,基金发行规模为 1 亿元。经上海证券交易所上证上(93)第 2053 号文批准,1993 年 8 月 20 日,淄博基金在上海证券交易所上市交易。淄博投资基金管理公司担任基金管理人,中国农业银行淄博分行为该基金托管人。

"通发基金"是经中国人民银行沈阳市分行沈银金字(1992)108 号批准,由原沈阳证券公司发起设立的,并经中国人民银行沈阳市分行沈银金字 (1992)241 号文件批准于 1992 年 9 月 8 日在沈阳证券交易中心上市交易, 并于 1994 年 3 月 7 日,在上海证券交易所联网交易。基金发行规模为 5000 万元,1993 年红利转"基金"850 万元,实有基金 5850 万元。后因银证分离政策的要求,经中国人民银行非银司[1995]105 号文批复,沈阳证券公司改建为海通证券有限公司沈阳分公司。基金管理人为海通证券有限公司沈阳分公司,基金名义托管人为交通银行沈阳分行。

"三峡基金"是经中国人民银行重庆市分行重人行复(92)字第 223 号批准,于 1993 年 3 月由重庆有价证券公司、重庆国际信托投资公司、工商银行重庆信托投资公司、建设银行重庆信托投资公司和交通银行重庆市分行共同发起设立。基金发行规模 5000 万元,三峡基金的管理人为重庆投资基金管理公司。基金名义托管人为重庆市商业银行。

根据原有投资基金清理规范的有关要求,三基金经规范重组合并后,更名为"汉博证券投资基金",规范后,基金汉博由海通证券有限公司和山东证券有限责任公司共同发起,基金管理人更换为富国基金管理有限公司。基金托管人更换为中国建设银行。

2000 年 10 月 17 日,基金汉博在上海证券交易所挂牌上市,总份额为 221,692,894 份。2000 年 11 月 24 日基金汉博完成扩募,基金总份额增至 5 亿份,基金存续期延长 5 年至 2007 年 5 月 29 日。

2007 年 4 月 5 日,汉博证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开,大会讨论通过了基金汉博转型议案,内容包括基金汉博由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市以及修订基金合同等。经中国证监会 2007 年 4 月 18 日证监基金字[2007]108 号文核准,基金份额持有人大会决议生效。依据持有人大会决议,基金管理人向上海证券交易所申请基金终止上市,自 2007 年 4 月 27 日基金汉博终止上市之日起,原《汉博证券投资基金基金合同》失效,《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》生效,基金正式转型为开放式基金,存续期限调整为无限期,同时基金更名为"富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同"。

七、基金的存续

(一)基金份额的变更登记

基金汉博终止在上海证券交易所上市交易后,基金管理人将进行基金份额更名以及必要的信息变更;中国证券登记结算有限责任公司将为投资者办理基金份额的初始登记。在基金开放赎回业务后,原基金份额持有人可通过场内上海证券交易所开放式基金销售系统(以下简称"上证基金通")或在办理相关手续后通过场外代销机构办理基金份额的赎回。

(二)集中申购结束后的验资

集中申购款项在集中申购期间存入专门账户,在集中申购期结束前任何人不得动用,期间产生的利息在集中申购期结束后折算为基金份额归投资者所有。集中申购期结束后,基金管理人应在 10 日内聘请法定验资机构进行集中申购款项的验资,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会提交验资报告。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内,如连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金财产净值低于 5,000 万元,基金管理人应当及时向中国证监会报告,说明出现上述情况的原因以及解决方案。

八、基金的集中申购

(一)集中申购期

本基金自 2007 年 5 月 9 日至 2007 年 5 月 18 日的集中申购期开放申购,期间不开放赎回。

基金管理人可根据基金销售情况适当延长或缩短集中申购期,但最长不超过 1 个月。

(二)销售方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资者公开发售。

(三)销售对象

个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(四)销售场所

投资者应当在基金管理人、代销机构办理基金销售业务的营业场所或按基金管理人、代销机构提供的其他方式办理基金的集中申购。

基金管理人、代销机构办理基金集中申购业务的地区、网点的具体情况和联系方法,请参见本基金集中申购公告以及当地销售机构的公告。

(五)基金的最高销售规模

本基金设定销售目标上限为 100 亿份。具体控制措施见基金份额发售公告。

(六)集中申购安排

1、本次基金集中申购期为 2007 年 5 月 9 日至 2007 年 5 月 18 日,在此期间每天具体业务办理时间由本基金集中申购期基金份额发售公告或各销售机构的相关公告规定。

2、集中申购方式

集中申购将通过场外集中申购的方式进行,本次集中申购将暂不开通场内集中申购方式。场外集中申购不使用上海证券交易所开放式基金销售系统,通过基金管理人的直销网点、场外代销机构的代销网点办理;

投资者集中申购所需提交的文件和办理的具体手续由基金管理人和销售机构约定,请投资者参阅本基金集中申购期基金份额发售公告。

3、场外集中申购方式和限制

(1)场外集中申购采用金额申购方式。

(2)场外集中申购基金份额采用全额缴款的申购方式。

(3)投资人在集中申购期内可以多次申购基金份额,已经正式受理的申购申请不得撤销。

(4)直销机构接受首次申购申请的最低金额为单笔 50,000 元(含申购费),追加申购的最低金额为单笔 20,000 元(含申购费);各代销机构接受申购申请的最低金额为单笔 1,000 元(含申购费)。

(5)集中申购期间单个投资人的累计申购规模没有限制。

4、集中申购价格、申购费用及申购份额的计算公式

(1)集中申购价格:本基金份额的集中申购价格为 1.00 元 / 份。

(2)集中申购费率

本基金对场外集中申购提供两种申购费用的支付模式。投资人可以选择前端收费模式,即在申购时支付申购费用;也可以选择后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用随基金份额的持有时间递减。

本基金场外集中申购费率如下表:

集中申购金额(含申购费)	前端集中申购费率
100万元以下	1.0%
100万元(含)—500 万元	0.8%
500万元(含)以上	1000元 / 笔

持有时间	后端集中申购费率
1年以内(含)	1.6%
1年—3 年(含)	0.8%
3年—5 年(含)	0.4%
5年以上	0

(3)集中申购份额的计算公式

A、场外集中申购前端收费模式

净集中申购金额＝集中申购金额 /(1＋前端集中申购费率)

前端集中申购费用＝集中申购金额－净集中申购金额

集中申购份额＝(净集中申购金额＋集中申购期间利息)/ 集中申购验资结束当日基金份额净值

场外集中申购份额的计算保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

B、场外集中申购后端收费模式

集中申购份额＝(集中申购总金额＋集中申购期利息)/ 集中申购验资结束当日基金份额净值

场外集中申购份额的计算保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

当投资人提出赎回时,后端申购费用的计算方法为:

后端集中申购费用＝赎回份额×1.00 元×后端集中申购费率

例一:某投资者在集中申购期投资 5,000 元申购富国天博创新主题股票型证券投资基金,集中申购期产生利息为 2 元,如果其选择交纳前端集中申购费用,则其可得到的基金份额计算如下:

净集中申购金额＝5,000/(1＋1.0%)＝4,950.49 元

前端集中申购费用＝5,000－4,950.49＝49.51 元

集中申购份额＝(4,950.49＋2)/1.00＝4,952.49 份

即投资者在集中申购期投资 5,000 元申购富国天博创新主题股票型证券投资基金,如果选择交纳前端集中申购费用,可得到 4,952.49 份基金份额。

例二:某投资者在集中申购期投资 5,000 元申购富国天博创新主题股票型证券投资基金,集中申购期产生利息为 2 元,如果其选择交纳后端集中申购费用,则其可得到的基金份额计算如下:

集中申购份额＝(5,000＋2)/1.00＝5,002 份

即投资者在集中申购期投资 5,000 元申购富国天博创新主题股票型证券投资基金,如果选择交纳后端集中申购费用,可得到 5,002 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集中申购费率交纳后端申购费用。

(4)集中申购申请的确认

对于 T 日交易时间内受理的集中申购申请,登记结算机构将在 T＋1 日就申请的有效性进行确认。但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资者的集中申购申请,集中申购份额的计算需按下述程序进行,由登记结算机构在集中申购期结束后确认,投资者可以在基金集中申购期结束后,到其办理集中申购业务的销售网点打印确认单。

(5)集中申购份额的确认

集中申购款项在集中申购期间存入专门账户,在集中申购期结束前任何人不得动用,期间产生的利息在集中申购期结束后折算为基金份额归投资者所有。集中申购期结束后,基金管理人应在 3 日内聘请法定验资机构进行集中申购款项的验资。验资结束后,基金管理人将根据当日基金份额净值计算投资者集中申购应获得的基金份额,并由登记结算机构根据基金管理人提供的明细数据进行投资者集中申购份额的登记确认。基金管理人将通过基金份额折算,使得验资结束当日基金份额净值为 1.000 元。基金管理人将就集中申购的验资和份额确认情况进行公告。

5、"末日比例确认"的处理方式

为了基金平稳投资运作的需要,本基金管理人在集中申购期内对基金集中申购总规模实行限量 100 亿份。

(1)集中申购期内申购申请不超过 100 亿份(含 100 亿份)的情形:若集中申购期内申购申请全部确认后本基金集中申购的总份额不超过 100 亿份(含 100 亿份),则所有的有效申购申请全部予以确认。

(2)集中申购期内申购申请高于 100 亿份的情形:若集中申购期内申购申请全部确认后本基金集中申购的总份额超过 100 亿份,将对集中申购期内最后一个申购日之前的有效申购申请全部予以确认,对最后一个申购日有效申购申请采用"末日比例确认"的原则给予部分确认,未确认部分的申购款项退还给投资者。

末日申购申请确认比例的计算如下:

集中申购期末日申购申请确认比例 ＝(100 亿元－集中申购期内申购末日之前有效申购申请金额)/ 末日有效申购申请金额

按照上式计算的确认比例,投资者在集中申购期末日提交的有效申购申请将部分予以确认。

计算结果以四舍五入的方法保留到小数点后 2 位。

投资者集中申购期内申购费按照按比例确认后的有效确认申购申请金额对应的费率计算。

集中申购期申购申请确认比例将于集中申购期结束日起的 2 个工作日内予以公告。

举例如下:

例三: 某投资者投资 10,000 元申购本基金。假设集中申购期内有效申购金额不足 100 亿元, 该笔申购将按照 100%比例全部确认,对应申购费率为 1%,在集中申购期间产生利息 3.00 元,基金集中申购价格每份为 1.000 元。则其可得到的申购份额为:

净申购金额＝10000/(1＋1.0%)＝9900.99 元

申购费用＝10000－9900.99＝99.01 元

申购份额＝(9900.99＋3.00)/1.000＝9,903.99 份

即:投资者投资 10,000 元申购本基金,可得到 9,903.99 份基金份额(含利息折份额部分)。

例四:某投资者投资 10,000 元申购本基金,假设集中申购期内有效申购申请金额超过 100 亿元。若该笔申购申请发生在集中申购末日之前,该笔申购将按照 100%比例予以确认,投资者得到的申购份额同例一。

若该笔申购申请发生在集中申购末日,且本次集中申购末日之前有效申购申请金额达到 80 亿元,申购末日的有效申购申请金额为 30 亿元,投资者得到的申购份额确认比例为(100－80)/30＝66.6667%,对应申购费率为 1.0%,申购末日产生利息 2 元,基金集中申购价格每份为 1.000 元。则其可得到的申购份额为:

有效申购申请确认金额＝10,000×66.6667%＝6,666.67 元

净申购金额＝6,666.67/(1＋1.0%)＝6,600.66 元

申购费用＝6,666.67－6,600.66＝66.01 元

申购份额＝(6,600.66＋2)/1.000＝6,602.66 份

未确认金额＝10,000－6,666.67＝3,333.33 元

即:投资者投资 10,000 元申购本基金,可得到 6,602.66 份基金份额。未确认金额 3,333.33 元将于本基金集中申购结束后退回投资者账户。

若投资者在集中申购期间多次申购该基金,其有效申购申请将按照单笔有效申请确认比例计算单笔有效申购申请份额。

九、基金份额的申购与赎回

(一)申购和赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

本基金的销售机构包括富国基金管理有限公司及其委托的代销机构。目前的代销机构为中国建设银行股份有限公司、中国农业银行、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海银行、中国邮政储蓄银行、海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、中信金通证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司的代销网点以及通过上海证券交易所交易系统办理相关业务的上海证券交易所会员单位。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。

(二)基金份额持有人可通过销售机构赎回原汉博基金基金份额。

1、原汉博基金基金份额持有人指定交易在本基金场内代销机构的,基金份额由中国证券登记结算有限责任公司统一变更登记至中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统。基金开放赎回后,基金份额持有人可通过其指定交易的本基金场内代销机构办理基金份额的赎回。

2、原汉博基金基金份额持有人未办理指定交易或指定交易在非本基金场内代销机构的,基金管理人在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统开设富国天博创新主题股票型证券投资基金临时账户(以下简称"临时账户"),用于归集该部分基金份额。基金开放赎回后,基金份额持有人可通过中国建设银行代销网点、代销证券公司或基金管理人直销网点向基金管理人提供确认其权益的相关信息,基金管理人核对无误后报中国证券登记结算有限责任公司,中国证券登记结算有限责任公司据此办理基金份额登记,将基金份额从临时账户扣减,同时记增持有人基金账户基金份额。此后,投资者可通过相关销售机构办理基金份额的申购、赎回业务。确认权益的具体流程和要求,详见基金管理人有关公告。

(三)申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日申请办理基金份额的申购和赎回,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,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,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》的有关规定在指定媒体上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始和赎回开始的时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体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、赎回或转换申请的,其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

(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、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回;

4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(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。

投资人在提交申购申请时须按销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须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、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申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日),正常情况下,本基金注册登记机构在 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,投资人可在 T＋2 日(包括该日)后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。

3、申购和赎回的款项支付

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,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后,基金管理人将在 T＋7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

(六)申购和赎回的数额和价格

1、场外代销网点每次申购本基金的最低金额为 1,000 元(含申购费)。直销网点首次申购基金的最低金额为 50,000 元(含申购费),追加申购的最低金额为 20,000 元,已在直销网点有该基金持有记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时,不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整本基金首次申购的最低金额。

场内申购时,每笔申购金额最低为 1,000 元,同时每笔申购必须是 100 元的整数倍,并且单笔申购最高不超过 99,999,900 元。

2、基金份额持有人进行场外赎回时,每次对本基金的赎回申请不得低于 1,000 份基金份额。场内赎回时,赎回的最低份额为 1,000 份基金份额,同时赎回份额必须是整数份额,并且单笔赎回最多不超过 99,999,999 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 50 份的,在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可以根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

4、本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,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。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,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

5、申购份额的计算及余额的处理方式:场外申购时,申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购时,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,以申请当日基金份额净值为基准计算,保留到整数位,剩余部分按每份基金份额申购价格折回金额返回投资人,折回金额的计算保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

6、赎回金额的计算及余额的处理方式: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,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

7、申购费用由投资人承担,并应在投资人申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

8、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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(七)申购费率和赎回费率

1、申购费

(1)投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。目前场内交易只支持前端收费模式的基金申购。

(2)投资者选择交纳前端申购费用时,按申购金额采用比例费率。投资者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(含申购费)	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)—500 万元	1.2%
500万元(含)以上	1000元 / 笔

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

(3)投资者选择交纳后端申购费用时,按申购金额采用比例费率,费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有时间	后端申购费率
1年以内(含)	1.8%
1年—3 年(含)	1.2%
3年—5 年(含)	0.6%
5年以上	0

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额,不再收取后端申购费用。

2、赎回费

投资者场内赎回,适用固定的赎回费率,定为 0.5%。投资者场外赎回,根据申购方式的不同,适用不同的赎回费率。

投资者选择交纳前端申购费用时,适用的赎回费率为 0.5%。

投资者选择交纳后端申购费用时,适用变动的赎回费率。赎回费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有时间	赎回费率
2年以内(含)	0.6%
2年—3 年(含)	0.3%
3年以上	0

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定和《基金合同》约定的限额。在法律法规规定的限制内,基金管理人可决定实际执行的申购、赎回费率,并在更新的《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要变更费率时,应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,经相关监管部门核准,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(八)申购份额和赎回金额的计算

1、申购份额的计算

场外申购可以选择交纳前端申购费用和后端申购费用,场内申购目前只支持前端收费模式。

如果投资者选择交纳前端申购费用,则申购份额的计算方法如下:

净申购金额＝申购金额 /(1＋前端申购费率)

前端申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额 / 申购当日基金份额净值

如果投资者选择交纳后端申购费用,则申购份额的计算方法如下:

申购份额＝申购金额 /T 日基金份额净值

例五:假定 T 日本基金的份额净值为 1.200 元,三笔申购金额分别为 1 万元、100 万元和 500 万元,如果投资者选择交纳前端申购费用,则各笔申购负担的前端申购费用和获得的该基金份额计算如下:

	申购 1	申购 2	申购 3
申购金额(元,A)	10,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00
适用前端申购费率(B)	1.50%	1.20%	–
净申购金额 (C＝A/(1＋B))	9,852.22	988,142.29	4,999,000.00
前端申购费(D＝A－C)	147.78	11,857.71	1,000.00
申购份额(＝C/1.200)	8,210.18	823,451.91	4,165,833.33

如果该投资者选择交纳后端申购费用,各笔申购获得的基金份额计算如下:

	申购 1	申购 2	申购 3
申购金额(元,A)	10,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00
申购份额(＝A/1.200)	8,333.33	833,333.33	4,166,666.66

2、赎回金额的计算

如投资者在申购时选择交纳前端申购费用,则赎回金额计算方法如下:

赎回总额＝赎回份额×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

如果投资者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＝赎回份额×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×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

例六:假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份,该日该基金份额净值为 1.250 元,其在申购时已交纳前端申购费用,则其获得的赎回金额计算如下:

赎回金额＝赎回总额－赎回费用

＝10,000×1.250－10,000×1.250×0.5%＝12,437.5 元

例七:假定某投资者在集中申购期内申购基金份额时选择交纳后端申购费用,并分别在半年后、二年半后和三年半后赎回 10,000 份,赎回当日的基金份额净值分别为 1.025、1.080 和 1.140 元,各笔赎回扣除的后端申购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回 1	赎回 2	赎回 3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
基金份额面值(B)	1.000	1.000	1.000
赎回日基金份额净值(C)	1.025	1.080	1.140
赎回总额(D＝A×C)	10,250	10,800	11,400
适用后端申购费率(E)	1.60%	0.8%	0.4%
后端申购费(F＝A×B×E)	160	80	40
赎回费(G)	61.50	32.4	0
赎回金额(H＝D－F－G)	10,028.50	10,687.60	11,360.00

例八:假定某投资者申购基金份额当日的基金份额净值为 1.200 元,该投资者选择交纳后端申购费用,并分别在半年后、二年半后和三年半后赎回 10,000 份,赎回当日的基金份额净值分别为 1.230、1.300 和 1.360 元,各笔赎回扣除的后端申购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回 1	赎回 2	赎回 3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
申购日基金份额净值(B)	1.200	1.200	1.200
赎回日基金份额净值(C)	1.230	1.300	1.360
赎回总额(D＝A×C)	12,300	13,000	13,600
适用后端申购费率(E)	1.80%	1.2%	0.6%
后端申购费(F＝A×B×E)	216	144	72
赎回费(G)	73.8	39	0
赎回金额(H＝D－F－G)	12,010.20	12,817.00	13,528.00

3、基金份额净值的计算公式为:基金份额净值＝基金资产净值总额 / 发行在外的基金份额总数。

本基金 T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T＋1 日公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(九)拒绝或暂停申购的情形及处理方式

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、证券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的基金资产净值;

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他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,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,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。

(十)暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时,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:

1、因不可抗力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,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已接受的赎回申请,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,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额,若出现上述第 3 项所述情形,按基金合同的相关条款处理。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。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予以公告。

(十一)巨额赎回的认定及处理方式

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)超过前一开放日的基金总份额的 10%,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全部赎回申请时,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开放日基金总份额的 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。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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3)暂停赎回:连续 2 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,但不得超过正常支付时间 20 个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

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招募说明书规定的方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在通过指定媒体上刊登公告,并向中国证监会备案。

(十二)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,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 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 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周,暂停期间,基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 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 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

(十三)基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记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。

(十四)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构同意的其他非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是合格的投资人。

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注册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自申请受理日起 2 个月内办理,并按基金注册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)基金的冻结和解冻

基金注册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,以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。

十、基金的投资

(一)投资目标

本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司,在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上,力争实现资本的长期稳定增值。

(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,包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如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。

(三)投资理念

深信"创新创造财富",以基本面研究驱动投资运作,在有效控制风险的基础上追求超额收益。

(四)投资策略

本基金将采用"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。

1、资产配置

(1)本基金基于对宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度的综合分析,充分研判各类资产的风险、收益、流动性及相关性等因素,灵活配置大类资产,力求减小投资组合的系统性风险。

(2)本基金投资的资产类别包括股票、债券、权证等。其中,股票类资产包括上市公司流通股股票和未来可能出现的诸如中国预托凭证之类的股权类证券;债券类资产包括国债、金融债、企业债(包括可转债)、央行票据、资产支持证券、短期融资券、回购协议以及现金存款等。

在正常市场状况下,本基金投资组合中的股票投资比例浮动范围为:60%-95%;除股票以外的其他资产投资比例浮动范围为:5%－40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于 5%。其中,投资于创新主题类上市公司股票的比例不低于基金股票投资的 80%。本基金定义的创新主题类上市公司为符合国家产业发展方向、在企业经营管理中知识与科技的运用对其发展有重要的推动作用、具备行业领先或技术领先优势的上市公司以及经重组后将显现上述特征的上市公司。

2、股票投资策略

基金管理人认为,当今时代,人类社会已经步入了一个创新不断涌现的重要时期,也步入了一个经济结构加快调整的重要时期。生产力、生产方式、生活方式和经济社会发展观在创新的推动下发生了前所未有的深刻变革,生产要素的流动与产业转移也在因创新而不断加快:信息科技创新已经成为推动经济增长和知识传播应用进程的重要引擎;生命科学和生物技术创新在对改善和提高人类生活质量方面发挥着关键作用;能源科技创新正在为进一步化解能源与环境问题开辟新途径;材料科技创新将带来深刻的技术变革,基础研究的重大突破逐渐为人类认知客观规律、推动技术和经济发展展现新的前景。在这样的大背景下,我国作出了建设创新型国家的决策,把增强自主创新能力作为国家战略,加强国家创新体系建设。

在资本市场上,由于创新主题类公司具有着强大的竞争优势,其公司业绩在未来较长的时间内将会保持持续高速的成长,股价也将相应地持续大幅升高。因此,本基金以创新主题类上市公司作为股票投资主体,在高度重视基本面分析的基础上遵循"关注成长,合理预期企业未来价值"的选股标准精选个股,力争为投资者带来丰厚的回报。

具体而言,本基金将通过成长性评估、价值评估、现金流预测与行业环境评估等多项指标全面考量公司的基本面,关注因素包括:行业竞争趋势、公司竞争地位、公司业务发展的关键点、短期与长期内公司现金流增长的主要驱动来源、公司治理结构等,运用的的分析模型包括自由现金流折现模型(DCF)、经济价值模型(EV/EBITDA)、杜邦财务分析模型(DuPont Analysis)等。在创新属性评估方面,本基金将重点考量创新的预期效果,并判断创新是否已经或者将会驱动企业的成长。本基金对创新的认定涵盖制度创新、技术创新、产品创新、服务创新、流程创新、管理模式创新、商业模式创新、需求创新等多个角度。其中,对于公司的具体创新项目,本基金将重点评价基于项目的预期投资回报率,具体衡量指标包括:销售收入边际增长率、毛利率边际增长率、净利率边际增长率、投入资本回报率等。

2、债券投资策略

在目前中国债券市场处于制度与规则快速调整的阶段,本基金将采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上,根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架;对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。

(1)久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险;

(2)期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利;

(3)市场转换是指管理人将针对债券子市场间不同运行规律和风险－收益特性构建和调整组合,提高投资收益;

(4)相对价值判断是在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的类属,减持相对高估、价格将下降的类属;

(5)信用风险评估是指管理人将充分利用现有行业与公司研究力量,根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估,以此作为品种选择的基本依据。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券:

(1)具有良好流动性的债券;

(2)具有较高信用等级的债券;

(3)在信用等级与剩余期限类似的条件下,到期收益率较高的债券;

(4)风险水平合理、有较好的下行保护且基本面有良性变化的可转换债券。

3、适时选择权证投资

本基金还可能运用基金财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具:

(1)运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益;

(2)构建权证与债券的组合,利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性,形成保本投资组合;

(3)针对不同的市场环境,构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合,形成多元化的盈利模式;

(4)在严格风险监控的前提下,通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究,谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

(五)投资风格

"研究为本、积极投资、淡化选时、均衡配置,在严格风控的基础上实现投资收益的最大化"体现了本基金的投资风格。

(六)投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制,基金经理负责基金管理组工作。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、股票投资的行业配置比例及重仓投资品种投资方案等重大投资决策。

基金管理组根据对市场走势的判断,在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略,并向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立交易员,负责执行投资指令,就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈,并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的实现监控以及本基金资产与公司其他基金之间的公平交易控制。

(七)投资程序

1、基金管理组根据市场的趋势、运行的格局和特点,并结合基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

2、投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例等重要事项。

3、基金管理组根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、个券投资分布方式及买卖时机,并对已投资品种进行跟踪,对投资组合进行动态调整。

4、集中交易室依据基金管理组的指令,制定交易策略,统一执行证券投资组合计划,进行具体品种的交易。

5、风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施,监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制。

6、基金管理组须每月提交工作报告及工作计划。

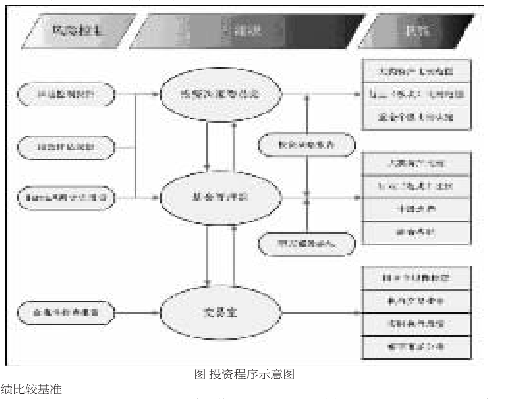

图 投资程序示意图

(八)业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中信标普 300 指数,债券投资部分的业绩比较基准采用中信标普国债指数。

中信标普 300 指数和中信标普国债指数具有较强的代表性。中信标普 300 指数由深沪两市具有行业代表性的公司构成,样本股经过流动性和财务稳定性的审慎检查,能较全面地描述中国 A 股市场的总体趋势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势,是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金定位为股票型基金,因此本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式:中信标普 300 指数×80%＋中信标普国债指数×15%＋同业存款利率×5%。

基金管理人认为,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。如果今后证券市场中有其他代表性更强的业绩比较基准推出,或者有更科学客观的权重比例适用于本基金时,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。本基金由于上述原因变更业绩比较基准,应经过投资决策委员会批准后报中国证监会备案,并在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

(九)风险收益特征

本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。

(十)投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点, 通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。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,其市值不超过基金资产净值的 10%;

(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(3)基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;

(4)基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(5)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%;

(6)在正常市场状况下,本基金投资组合中的股票投资比例浮动范围为:60%-95%;除股票以外的其他资产投资比例浮动范围为:5%－40%。其中,投资于创新主题类上市公司股票的比例不低于基金股票投资的 80%;

(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)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)本基金所投资资产支持证券的信用级别评不得低于 BBB,在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)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;

(13)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(14)保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(15)如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述相关规定的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。

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)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、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者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;

(9)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

(十二)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、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,保护基金份额持有人的利益;

2、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;

3、有利于基金资产的安全与增值;

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。

(十三)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十一、基金的财产

(一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

其构成主要有:

1、银行存款及其应计利息;

2、清算备付金及其应计利息;

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、权证投资及其估值调整

9、其他投资及其估值调整;

10、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负债后的价值。

其构成主要有:

1、基金份额持有人申购基金份额所支付的款项;

2、运用基金资产所获得收益(亏损);

3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

(三)基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户,以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的财产的债务相抵销,不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

十二、基金资产的估值

(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正常营业日。

(二)估值方法

本基金按以下方式进行估值:

1、股票估值方法

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;

(2)未上市股票的估值:

1)送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值,该日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;

2)首次发行的股票,按成本价估值;

(3)配股权证,从配股除权日起到配股确认日止,若收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值;若收盘价等于或低于配股价,则估值为零;

(4)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)－(3)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)小项规定的方法对基金资产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,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(5)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

2.债券估值方法:

(1)证券交易所市场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)证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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净价估值;

(3)未上市债券按其成本价估值;

(4)在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值;

(5)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)－(4)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)－(4)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值,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)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

3、权证估值方法:

(1)基金持有的权证,从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值;估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值;未上市交易的权证按公允价值估值;

(2)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(3)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

4、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。

5、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资产净值的计算结果对外予以公布。

(三)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

(四)估值程序

1.基金份额净值是按照每个开放日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到 0.0001 元,小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每个开放日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2.基金管理人应每个开放日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后,将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,由基金管理人对外公布。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。

(五)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。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时,视为基金份额估值错误。

差错处理

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

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、或注册登记机构、或代销机构、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不能预见、不能避免、不能克服,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,由差错责任方承担赔偿责任;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财产损失时,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财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(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,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1)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)错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

(3)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

(六)暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2.因不可抗力或其它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.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,已决定延迟估值;

4.如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;

5.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(六)暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2.因不可抗力或其它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.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,已决定延迟估值;

4.如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;

5.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七)基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和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工作日交易结束后计算当日的基金资产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予以公布。

(八)特殊情形的处理

1.基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(4)项、债券估值方法的第(5)项或权证估值方法的第(2)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,或由于证券交易所及注册登记公司发送的数据错误,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。但基金管理人和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。

十三、基金收益与分配

(一)收益的构成

1.买卖证券差价;

2.基金投资所得红利、股息、债券利息;

3.银行存款利息;

4.已实现的其他合法收入。

5、赎回费和转换费收入

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

(二)基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定应在基金收益中扣除的费用后的余额。

(三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1.本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2.基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;

3.收益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,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

4.本基金收益每年最多分配 12 次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%;

5.本基金收益分配方式分为两种: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除息日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;

6.基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

7.基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;

8.法律法规或监管机构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收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

(五)收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订,由基金托管人复核,依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案;

2.在收益分配方案公布后,基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令,基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十四、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.基金财产拨划支付的银行费用;

4.基金合同生效后的基金信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

7.基金的证券交易费用;

8.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在相关公告中载明;

9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年管理费率÷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,经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年托管费率÷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,经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用,其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,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 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、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会计责任方;

2.本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日;

3.本基金的会计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.本基金独立建账、独立核算;

6.基金管理人保留完整的会计账目、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.基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

(二)基金的审计

1.基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2.会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人同意。

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,经基金托管人(或基金管理人)同意,并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所,基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

十六、基金的信息披露

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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息,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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内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。

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。

公开披露的基金信息包括:

(下转 A28 版)