长城稳健增利债券型证券投资基金招募说明书

(上接C9版)

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:长城基金管理有限公司
2、住所:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
3、办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
4、法定代表人:杨光裕
5、组织形式:有限责任公司
6、设立日期:2001年12月27日
7、电话:0755-23982338 传真:0755-23982328
8、联系人:谭水阳

9、管理基金情况:目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)和长城品牌优选股票型证券投资基金八只基金

10、客户服务电话:400-8868-666
11、注册资本:壹亿伍仟万元
12、股权结构:

基金或本基金	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托投资股份有限公司	17.647%
合计	100%

(二)基金管理人主要人员情况

1、董事、监事及高管人员介绍

(1)董事

杨光裕先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任,长城证券有限责任公司副总裁,现任长城基金管理有限公司董事长。

赵玉华先生,南开大学经济学硕士。历任君安证券有限责任公司投资银行部项目经理、总经理助理、业务董事、北京投行部副总经理,国泰君安证券股份有限公司企业融资部副总经理、常务董事、北京企业融资部董事总经理、部门负责人,长城证券有限责任公司投资银行委员会副主席,现任长城证券有限责任公司副总经理。

杨平先生,北京大学国际MBA学历。历任北京国际信托投资公司外汇部首席交易员、加拿大蒙特利尔银行北京分行资金部和市场部高级经理、中国人民保险公司投资部投资总监、中国人保资产管理有限公司银行/外汇业务部副总经理、中国人民保险(香港)有限公司投资部总经理、长城证券有限责任公司总裁助理,现任长城证券有限责任公司副总经理。

梁宇峰先生,中共党员,复旦大学经济学博士。历任东方证券研究发展总部经理助理、办公室主任助理、研究所副所长,2006年4月至今任东方证券研究所所长。

崔泽军先生,中共党员,硕士研究生毕业,高级会计师。历任中原信托投资有限公司财务部副经理、经理、公司副总经理,现任中原信托投资有限公司总经理。

陆妍女士,1991年毕业于天津理工学院管理信息系统专业,获工学学士学位,1997年毕业于天津大学管理学院,获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理、北方国际信托投资股份有限公司证券管理总部总经理,现任北方国际信托投资股份有限公司副总经理。

任俊杰先生,大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融机构同业协会首任秘书长、赛格投资有限公司(香港注册)董事总经理、祥安证券有限公司(香港联交所会员)董事、中国投资环境协会副理事长、深圳怀新企业投资顾问有限公司副总经理,现任深圳施得普汇投资顾问有限公司董事长。

万建华先生,中共党员,工商管理博士,高级经济师。历任中国人民银行货币政策司处长、招商银行总行副行长、党委副书记、常务副行长、中国银联筹备组组长、党委书记、副董事长、总裁,现任上海国际集团党委副书记、副董事长、总裁。

谢志华先生,中共党员,经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院(现北京工商大学)副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘杉先生,经济学博士。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报财经新闻部主任,中国人民银行深圳分行金融早报社总编辑,中华工商时报社总编辑助理,现任中华工商时报社副总编辑,兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

关林戈先生,中共党员,经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任,中共天津市委领导同志秘书,南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理,长城证券有限责任公司总裁助理,长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理,现任长城基金管理有限公司总经理。

(2)监事

罗世容女士,大学本科毕业,会计师。历任四川轻工厅盐业学校财经教研室主任,海南信托投资公司证券部主办会计,长城证券总部财务主管、长城证券总部深圳二部财务部经理,长城证券有限责任公司成都营业部副总经理兼财务部经理、深圳一部副总经理兼财务部经理、公司审计部总经理、公司审计监控部总经理,现任长城证券有限责任公司财务部副总经理,并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

田德良先生,2005年毕业于中央广播电视大学会计学专业,经济师。曾任职于中国建设银行天津开发区分行,任经理助理、事后总稽核。现任职于北方国际信托投资股份有限公司,曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部经理、监察稽核部副经理、项目评估部项目经理、业务发展总部客户经理,现任自营业务总部项目经理。

张令先生,中共党员,研究生学历。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券资金财务管理总部总经理,现任东方证券稽核总部总经理。

孟凡君先生,中共党员,经济学学士,经济师。历任工商银行河南华信资金市场融资二部经理、总经理助理、中原信托投资有限公司开封证券营业部副经理、资产管理部经理,现任中原信托有限公司投资管理二部经理。

桑煜先生,中共党员,经济学学士。曾任职于中国建设银行山东日照市分行、中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司,历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理,现任公司总经理助理兼市场开发部总经理。

韩刚先生,中共党员,1999年毕业于中国人民银行研究生部,经济学硕士。曾任国信证券发展研究中心研究员。2001年7月进行长城基金管理有限公司,历任研究员、长城久恒基金经理、基金管理部副总经理,现任研究部副总经理。

(3)高级管理人员

杨光裕先生,长城基金管理有限公司董事长,简历同上。

关林戈先生,长城基金管理有限公司董事、总经理,简历同上。

余骏先生,硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院,历任中国人民银行湖北省分行科室负责人,君安证券有限公司研究部宏观室负责人,长城证券有限责任公司营业部总经理,长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理,现任长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理和综合管理部总经理。

汪钦先生,中共党员,博士研究生毕业。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处,海南港澳国际信托投资公司证券部,历任三亚东方实业股份有限公司副总经理,国信证券有限责任公司研究所所长,长城基金管理有限公司总经理助理,并先后兼任研究策划部总经理、市场开发部总经理,现任长城基金管理有限公司副总经理。

韩浩先生,硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部总经理,长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理部总经理、“久嘉证券投资基金”基金经理、总经理助理、“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理,现任长城基金管理有限公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

彭洪波先生,经济学硕士,MBA,曾就职于长城证券有限责任公司,历任深圳东园路营业部电脑部经理,公司电子商务筹备组项目经理,公司审计部技术主审。2002年3月加盟长城基金管理有限公司,历任监察稽核部业务主管、部门副经理、部门经理,现任长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理。

2、本基金基金经理简历

刘海先生,生于1978年,1999年毕业于清华大学经济管理学院国际金融与财务专业,经济学学士。曾就职于深圳发展银行总行,任职债券交易员。2005年6月进入长城基金管理有限公司,曾任“长城货币市场证券投资基金”基金助理,自2006年3月9日起任“长城货币市场证券投资基金”基金经理。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

关林戈先生,投资决策委员会主席,公司董事、总经理。

韩浩先生,投资决策委员会执行委员,公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

汪钦先生,投资决策委员会委员,公司副总经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;

(2)依照基金合同获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费用和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(3)发售基金份额;

(4)依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(5)在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

(6)根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

(7)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;

(8)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、融券;

(9)自行担任或选择、更换登记结算机构,获取基金份额持有人名册,并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查;

(10)选择、更换代销机构,并依据销售代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

(11)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(12)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(13)依法召集基金份额持有人大会;

(14)法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、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、勤勉尽责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)计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

(9)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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;

(10)按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(11)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(12)编制中期和年度基金报告;

(13)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;

(14)保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、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,不得向他人泄露;

(15)按照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收益;

(16)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;

(17)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

(18)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者实施其他法律行为;

(19)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;

(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,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)基金托管人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托管人追偿;

(22)按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

(23)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;

(24)执行生效的基金份额持有人大会决议;

(25)不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(26)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,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

(27)法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》等法律法规的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止性行为

(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牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

(五)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,不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。

(六)基金管理人的内部控制制度

健全、完善的内部风险控制制度是规范公司行为,有效防范经营风险,实现公司持续、稳健发展的主要保证,也是公司经营管理水平的重要标志。为此,公司建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度。

1、风险控制的目标

公司风险控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理实体。具体目标是:

(1)确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行;

(2)建立符合现代企业制度要求的法人治理结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制;

(3)不断提高基金管理的效率和效益,在有效控制风险的前提下,努力实现基金份额持有人利益最大化;

(4)努力将各种风险控制在规定的范围内,保障公司发展战略和经营目标的全面实施,维护公司股东的合法权益;

(5)建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

2、建立风险控制制度的原则

公司按照合法、合规、稳健的要求,制定明确的经营方针,建立合理的经营机制。在建立风险控制制度时应严格遵循以下原则:

(1)全面性原则:风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

(2)审慎性原则:内部风险控制的核心是有效防范各种风险,公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;

(3)独立性原则:公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行部门;风险控制委员会、合规审查委员会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查;

(4)有效性原则:风险控制制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章,具有高度的权威性,成为所有员工严格遵守的行动指南;执行风险控制制度不能存在任何例外,公司任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力;

(5)适时性原则:内部风险控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善;

(6)防火墙原则:公司基金投资、研究策划、市场开发等相关部门,应当在空间上和制度上适当分离,以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序。

3、风险控制的主要内容

(1)确立加强内部风险控制的指导思想,确定风险控制的目标和原则;

(2)建立层次分明、权责明确的风险控制体系;

(3)建立公司风险控制程序;

(4)对公司内部风险进行全面、系统的评估,制定风险控制计划;

(5)确定公司风险控制的路径和措施;

(6)保障风险控制制度的持续性和有效性,制定可行的风险控制制度的评价和检查机制。

4、风险控制体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构,并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系:

(1)一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险控制与审计委员会,负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。对公司内部控制制度的有效性进行评价,对公司经营管理和基金业务运作的合法合规性进行监督检查,协助董事会建立并有效维持公司内部控制系统,对公司经营中的风险进行研究、分析和评估,并提出风险防范措施和建议,保证公司的规范健康发展。风险控制与审计委员会的基本职能为:

①协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。

②审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。

③检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况,并出具评估意见或改正方案;

④定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报;

⑤检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见;

⑥评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险,检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性,并提出改进意见;

⑦检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序,与外部审计机构进行交流;

⑧对公司内部控制和风险管理工作进行考核;

⑨董事会安排的其他事项。

公司设督察长。督察长作为风险控制与审计委员会的执行机构,对董事会负责,按照中国证监会的规定和风险控制与审计委员会的授权进行工作。

(2)二级风险防范

二级风险防范是指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。

投资决策委员会在总经理的领导下,研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略,对基金的总体投资情况提出指导性意见,从而达到分散投资风险,提高基金资产的安全性的目的。其在风险控制中主要职责为:

①研究并确立公司的基金投资理念和投资方向;

②决定基金资产在现金、债券和股票中的分配比例;

③审核基金经理提出的投资组合方案,并对其运作过程中的风险进行评估和控制;

④批准基金经理拟订的投资原则,对基金经理做出投资授权;

⑤对超出投资决策委员会执行委员及基金经理权限的投资项目作出决定。

监察稽核部在总经理的领导下,独立于公司各业务部门和各分支机构,对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。其在风险控制中主要职责是:

①根据各项风险的产生环节,和相关的业务部门一起,共同制定对风险的事前防范和事后审查方案;

②就各部门内部风险控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告及建议职能;

③调查公司内部的违规案件,协助监管机构处理相关事宜;

④对基金运作和公司内部管理进行日常监督与稽核,并向总经理汇报。

(3)三级风险防范

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施,达到:

①一线岗位双人双职双责,互相监督;直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位,实行双人负责;属于单人、单岗处理的业务,强化后续的监督机制;

②相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道,各部门和岗位分别在自己的授权范围内承担各自的职责,将风险控制在最小范围内。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

(1)本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;

(2)本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部风险控制制度。

四、基金托管人

(一)基金托管人概况

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
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币
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[1998]12号
联系人:尹 东
联系电话:010-67595003

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号:HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。2007年,中国建设银行的综合盈利能力达到同业领先水平,实现净利润691.42亿元,较上年上升49.27%。平均资产回报率为1.15%,平均股东权益回报率为19.50%,分别较上年提高0.23个百分点和4.50个百分点,每股盈利为0.30元,较上年提高0.09元。总资产达到65,981.77亿元,较上年增长21.10%。资产质量稳步上升,不良贷款额和不良贷款率实现双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为2.60%,较上年下降0.69个百分点。拨备水平充分,拨备覆盖率为104.41%,较上年末提升22.17个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行,在伦敦、纽约、悉尼设有代表处。2006年8月24日,中国建设银行在香港与美国银行签署协定,收购美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司100%的股权,并于2006年12月29日完成收购交割,美国银行(亚洲)有限公司更名为“中国建设银行(亚洲)股份有限公司”。

2007年,中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的世界银行1000强中列第14位;被美国《福布斯》杂志评为全球上市公司2000强第69位;被英国《金融时报》评为“全球500强”第35位;荣获美国《环球金融》杂志“年度中国最佳银行奖”、香港《资本》杂志“中国杰出银行奖”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”、《亚洲风险》杂志“中国最佳金融风险管理奖”、《亚洲银行家》杂志“零售风险管理卓越奖”等奖项。中国建设银行在2007年首届中国基金行业年度评选中荣获“最佳托管银行奖”;荣获《财资》杂志颁发的“2007中国最佳次托管银行奖”。在取得出色的经营业绩的同时,中国建设银行亦积极承担企业公民的社会责任,2007年获得中国扶贫基金会“扶贫中国公益家”荣誉称号,获得新华网颁发的“企业社会责任贡献奖”,获得香港上市公司公会和浸会大学工商管理学院颁发的“企业社会责任奖”,连续两次获得中国红十字基金会颁发的“最具责任感企业奖”。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室,现有员工110余人。

(二)主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

(三)基金托管业务经营情况

截止到2008年3月31日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、鸿飞、银丰等8只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华-道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选、工银瑞信红利、泰达荷银市值优选、长城品牌优选、交银施罗德蓝筹、易方达增强回报、南方盛元红利、交银施罗德增利等58只开放式证券投资基金。

(四)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

(1)每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3)根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

(4)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:长城基金管理有限公司
住所:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
法定代表人:杨光裕
成立时间:2001年12月27日
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
联系人:黄念英
客户服务电话:400-8868-666
网站:www.ccfund.com.cn

2、代销机构

(1)中国建设银行
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(2)中国农业银行
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

(3)交通银行
注册地址:上海市仙霞路18号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:021-58781234
传真:021-58408842
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(4)招商银行
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
联系人:兰奇
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

(5)光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595
网址:www.cebbank.com

(6)华夏银行
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)
法定代表人:刘海燕
联系人:陈宇
电话:(010)85238423
传真:(010)85238680
网址:www.hxb.com.cn

(7)上海银行
注册地址:上海市中山东二路585号
办公地址:上海市中山东二路585号
法定代表人:陈辛
开放式基金咨询电话:021-962888
开放式基金业务传真:021-63370777
联系人:张萍
联系电话:021-63370888
网址:www.bankofshanghai.com

(8)民生银行
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:010-58351666
传真:010-83914283
联系人:李群
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(9)中信银行
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:孔丹
电话:(010)6554-1585
传真:(010)6554-1230
客户服务电话:95558
公司网站:www.htsc.com.cn

(10)北京银行
注册地址:北京市西城区金融大街17号北京银行大厦
办公地址:北京市西城区金融大街17号北京银行大厦
法定代表人:阎冰竹
电话:010-66223248
传真:010-66223248

(11)渤海证券
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:张志军
联系人:徐焕强
联系电话:022-28451883
客户服务电话:022-28455588
网址:www.ewww.com.cn

(12)长城证券
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系人:高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
客户服务热线:0755-82288968
网址:www.cc168.com.cn

(13)东方证券
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22-29层
法定代表人:王益民
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务热线:400-8888-506、021-962506
网址:www.dfzq.com.cn

(14)广州证券
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼
法定代表人:吴志明
客户服务中心电话:020-961303
基金业务联系人:曾洋
联系电话:020-87322668
传真:020-87325036
网址:www.gzs.com.cn

(15)国都证券
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层
办公地址:北京市东城区安外大街安贞大厦3层
法定代表人:王少华
开放式基金业务传真:010-64482090
联系人:马泽承
联系电话:010-64482828-390
全国免费业务咨询电话:800-810-8809
网址:www.guodu.com

(16)国盛证券
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:管荣升
联系电话:0791-6285337
传真电话:0791-6289395
联系人:徐美云
客户服务电话:0791-6285337
网址:www.gsstock.com

(17)国泰君安证券
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
联系人:芮敏祺
电话:021-62580818-213
传真:021-62152814
客户服务热线:4008888666
网址:www.gtja.com

(18)国信证券
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
法人代表人:何如
联系人:林建闽
电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
客户服务电话:800-810-8868
网址:www.guosen.com.cn

(19)海通证券
通讯地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:021-53594566
传真:021-53858549
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:4008888001、021-962503
网站:www.htsec.com

(20)江南证券
法定代表人:姚江涛
公司名称:江南证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
联系人:方俊才
联系电话:(0791)6772501
传真:(0791)6789414
网址:www.scstock.com

(21)联合证券
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层
法定代表人:马昭明
联系人:盛宗凌
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
客户服务电话:400-8888-555,0755-25125666
网址:www.lhzq.com

(22)平安证券
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:叶黎成
联系人:余江
电话:0755-82450826
传真:0755-82433794
全国统一客户服务热线:95511
网址:www.pa18.com

(23)申银万国
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
传真:021-54038844
客服电话:021-962505
网址:www.sw2000.com.cn

(24)世纪证券
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:段强
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
联系人:章磊,刘军辉
客服电话:0755-83199511
网址:www.csco.com.cn

(25)天相投顾
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座
法定代表人:林义相
电话:(010)66045522
传真:(010)66045500
联系人:陈少震
网址:www.txsec.com、www.txjijin.com

(26)兴业证券
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:021-68419974
联系人:易勇
客户服务热线:021-68419393-1098
网址:www.xyzq.com.cn

(27)银河证券
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:朱利
电话:(010)66568587
联系人:郭京华
咨询电话:8008201868
网址:www.chinastock.com.cn

(28)招商证券
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82960141
联系人:黄健
客户服务热线:4008888111、0755-26951111
网址:www.newone.com.cn

(29)中信建投证券
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:张佑君
电话:010-85130577
联系人:权唐
网址:www.csc108.com
开放式基金咨询电话:4008888108

(30)齐鲁证券
齐鲁证券有限责任公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
办公地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李炜
电话:0531-81283728
传真:0531-81283735
联系人:傅咏梅
网址:www.qlzq.com.cn
客服电话:0531-82084184

(31)华西证券
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼(深圳总部)
法定代表人:张慎修
电话:0755-83025046
传真:0755-83025991
联系人:张有德
客户服务电话:400-8888-818
网址:www.hx168.com.cn

(32)华泰证券
注册地址: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
电话:025-84457777-950、248
联系人:李金龙、张小波
客户咨询电话:025-84579897
网址:www.htsc.com.cn

(33)中信万通证券
注册地址:青岛市崂山区香港东路316号
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:史洁民
联系电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁韶燕
中信万通证券客户咨询电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn

(34)安信证券
办公地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825555
传真:0755-82825560
联系人:李瑾
客服电话:020-96210
网址:www.axzq.com.cn

(35)光大证券
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:王明权
电话:021-68816000
传真:021-68815009
联系人:刘晨
客服电话:10108998
公司网址:www.ebscn.com

(36)东海证券
注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼
办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
电话:021-50586660
传真:021-50586660-8880
联系人:邵一明
客服电话:0519-8166222 0379-64912266
网址:www.longone.com.cn

(37)恒泰证券
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010
法定代表人:刘汝军
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
联系人:常向东
客服电话:0471-4961259
网址:www.cnht.com.cn

(38)国元证券
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
电话:0551-2207114
联系人:程维
客户服务电话:全国统一热线4008888777,安徽省内热线96888
网址:www.gyzq.com.cn

(39)中投证券
注册地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
法定代表人:杨小阳
电话:0755-82026521
联系人:刘权
客服电话:400-600-8008
网址:www.cjis.cn

(40)西部证券
注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:029-87406172
传真:029-87406387
客服热线:029—87419999
联系人:黄晓军
网址:www.westsecu.com.cn

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构,并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。

(二)基金注册登记机构

名称:长城基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
法定代表人:杨光裕
成立时间:2001年12月27日
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
联系人:杜京果
客户服务电话:400-8868-666

(三)律师事务所与经办律师

律师事务所名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
负责人:王玲
经办律师:靳庆军、宋萍萍
电话:0755-22163333
传真:0755-22163380
联系人:宋萍萍

(四)会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称:深圳大华天诚会计师事务所
注册地址:深圳市福田区滨河大道5022号联合广场B座11楼
负责人:李秉心
经办注册会计师:李秉心、徐海宁
电话:0755-82900952
传真:0755-82900965
联系人:何慧仪
电话:0755-82900952
传真:0755-82900965

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》等有关法律、法规及基金合同募集。并经中国证券监督管理委员会2008年5月16日证监许可【2008】706号文核准公开募集。

(一)基金类型、运作方式及存续期间

基金类别:债券型
基金运作方式:契约型开放式
存续期间:不定期

(二)募集方式

本基金通过直销机构和代销机构办理基金认购业务的网点公开发售。

(三)募集期限

本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

自2008年7月18日到2008年8月22日,基金向个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者同时发售。

具体发售方案以本基金份额发售公告为准,请投资者就发售和购买事宜仔细阅读本基金份额发售公告。

(四)募集对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者(法律法规禁止购买证券投资基金者除外)以及合格的境外机构投资者。

(五)募集场所

基金管理人的直销网点和基金销售代理人确定的代销网点。

上述销售机构办理开放式基金业务的城市(网点)的具体情况和联系方法,请参见本基金的份额发售公告。

(六)募集规模上限

本基金实行限量发售,最大募集规模上限为100亿元。具体限制方法请参见本基金的份额发售公告。

(七)基金的最低募集份额总额

基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

(八)基金份额面值、认购价格及计算方式、认购费用

1、基金份额面值

基金份额的初始面值为1.00元人民币。

2、认购价格

本基金按面值发售,认购价格为每份基金份额人民币1.00元。

3、认购费用

本基金采用金额认购的方式,认购费率最高不超过认购金额的0.6%。本基金认购费由认购人承担,可用于市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。本基金认购费率按有效认购金额(有效认购金额=申请认购金额×配售比例)分档如下,投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算:

有效认购金额(含认购费)	认购费率
100万元以下	0.6%
100万元(含)–300万元	0.4%
300万元(含)–500万元	0.2%
500万元以上(含)	每笔1000元

4、认购份额的计算

本基金认购份额的计算如下:

净认购金额=有效认购金额/(1+认购费率),对于500万元(含)以上的认购,净认购金额=认购金额–固定认购费金额

认购费用=有效认购金额–净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额面值

例:某投资者投资100,000元认购本基金,对应的认购费率为0.6%,假设该笔认购按照100%比例全部予以确认,这100,000元在认购期间产生的利息为50元,基金份额面值为1.0000元,则其可得到的基金份数计算如下:

净认购金额=100,000/(1+0.6%)=99,403.58元

认购费用=100,000–99,403.58=596.42元

认购份额=(99,403.58+50)/1.00=99,453.58份

即投资者投资100,000元认购本基金,加上募集期间利息后一共可以得到99,453.58份基金份额。

上述计算结果(包括基金份额的份数)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。

(九)投资者对基金份额的认购

1、认购的时间和程序

认购时间安排、投资人认购时应提交的文件和办理的手续、认购的方式及确认等均在本基金份额发售公告中详细列明,请参见基金份额发售公告及销售代理人相关公告。

2、认购的限制

(1)本基金的认购采用金额认购方式认购;

(2)投资人认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款;

(3)投资人在募集期内可以多次认购基金份额,但已申请的认购不允许撤销;

(4)投资者首次认购本基金最低金额为1,000元人民币,本基金募集期间对单个基金份额持有人不设置最高认购金额限制;

(5)销售机构对认购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受了认购申请,申请的成功与否应以基金注册登记机构的确认结果为准。

(十)募集资金利息的处理方式

认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

(十一)募集期间的资金与费用

本基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

七、基金合同生效

(一)基金合同生效

1、本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金管理人在募集期届满并达到基金合同的备案条件,应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,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,办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、本基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

(二)基金募集失败

1、基金募集期届满,未达到基金合同的生效条件,或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效,则基金募集失败。

2、如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期限届满后30日内返还投资人已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

基金合同生效后的存续期内,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,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于人民币5000万元,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并提出解决方案。

八、基金份额的申购与赎回

(一)申购与赎回场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销机构及代销机构的指定营业网点进行。销售机构名单和联系方式详请参见本招募说明书第五部分“相关服务机构”。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。条件成熟时,投资者可通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上等形式进行申购与赎回,具体办法另行公告。

(二)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。

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、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

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并公告。

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。

在确定申购开始与赎回开始时间后,由基金管理人最迟于开始日前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(三)申购与赎回的数额限制

1、每笔申购申请不得低于1,000元(含申购费)。本基金定期定额业务不受此最低申购金额限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时,每笔赎回申请不受限制。投资者每个交易账户不设最低基金份额余额限制。

3、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前3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

(四)申购与赎回的原则

1、本基金申购、赎回业务采用“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日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消;

4、对投资者持有的本基金同一基金代码的基金份额,基金赎回业务遵循“先进先出”的原则,即先确认的认购或申购的基金份额先赎回。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响投资者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3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,在开放日的交易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、赎回申请无效而不予成交。

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收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),并在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本基金合同有关条款处理。

(六)申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由申购人承担,由基金管理人及代销机构收取。

本基金的申购费率不高于0.8%,随申购金额的增加而递减,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。费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	0.8%
100万元(含)–300万元	0.5%
300万元(含)–500万元	0.3%
500万元以上(含)	每笔1000元

本基金的申购费用由基金申购人承担,归基金管理人及代销机构所有,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

2、本基金的赎回费用

本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减,费率如下:

持有期	赎回费率
30天以内	0.3%
30天(含)–1年	0.1%
1年(含)–2年	0.05%
2年(含)以上	0

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,赎回费总额的25%归基金财产,75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、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,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日前在至少一种指定媒体公告。

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,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调整基金申购费率和基金赎回费率。如因此或其他原因导致上述费率发生变更,基金管理人最迟应于新费率实施日3个工作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

1、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,

净申购金额=申购金额/(1+申购费率),对于500万元(含)以上的申购,净申购金额=申购金额–固定申购费金额

申购费用=申购金额–净申购金额

申购份数=净申购金额/T日基金份额净值

2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,

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

3、基金份额净值计算公式

T日基金份额净值=T日收市后的该基金资产净值/T日该基金份额的余额数量

本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。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。

4、申购份额余额的处理方式: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。

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。

(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、证券交易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、发生本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,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。

(九)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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、发生本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。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过20个工作日,并在指定媒体上公告。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。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)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延期赎回。

(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

当发生上述延期赎回并延期办理时,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,同时在指定媒体上刊登公告。

(十一)其它暂停申购和赎回的情形及处理方式

1、为了更好的保护投资人,当基金管理人认为出现可能有损现有基金份额持有人利益需要暂停基金申购、赎回申请的,应当报中国证监会备案。基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停公告。

2、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、赎回申请的,应当报中国证监会备案。基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停公告。

(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本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算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。

(十四)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记结算机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及登记结算机构认可、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结算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结算机构的规定办理,并按基金登记结算机构规定的标准收费。

(十五)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)基金的冻结和解冻

基金登记结算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,以及登记结算机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

九、基金的投资管理

(一)投资目标

本基金主要投资对象为具有高信用等级的固定收益类金融工具,部分基金资产可以适度参与二级市场权益类金融工具投资,并运用固定比例投资组合保险策略对权益类组合资产的风险进行有效管理,在组合投资风险可控和保持资产流动性的前提下尽可能提高组合收益。同时根据市场环境变化,采用积极主动的组合动态调整策略,力争获得超越业绩比较基准的长期稳定收益。

(二)投资范围

本基金投资于高信用等级的债券,包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债和可转换债(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持债券;投资于大额存单、债券回购、债券远期交易以及法律、法规或监管部门允许基金投资的其它固定收益类投资工具及其衍生工具。

除此以外,本基金可参与一级市场新股申购(含增发新股),二级市场股票和权证投资。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。

本基金组合资产中固定收益类资产所占比例为80%–100%,权益类资产所占比例为0–20%,且本基金持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

(三)投资策略

1、动态资产配置策略及固定比例投资组合保险策略(constant proportion portfolio insurance, CPPI)

本基金在组合投资管理中,将基金资产分为收益资产和风险资产,收益资产主要投资于固定收益类金融工具,风险资产主要投资于权益类金融工具,以收益资产的预期收益作为风险资产的安全垫。建立和运用严格的动态资产数量模型,在确定风险资产暴露预算(Equity Risk Budget)的基础上对收益资产和风险资产的投资比例进行即时调整。即用收益资产的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损。

在收益资产和风险资产的配置上,通过对远期利率、极端市场价格等参数的预测,计算风险资产组合中不同类属资产可能发生的最大亏损,据此得到不同类属资产的可放大倍数。根据风险资产投资的盈亏状况,动态调整风险资产和安全资产的权重。

通过这种定量化的资产类属配置达到一定资产的相对安全,并获取权益类投资市场阶段性机会,从而提高整体投资组合的收益,同时限定和规避组合的下行风险(Down Risk)。

2、收益资产投资策略

本基金将综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策以及债券市场资金供求关系的基础上,主动判断市场利率变化趋势,确定和动态调整收益资产的平均久期,并根据收益最优化的原则,通过量化模型确定组合中收益类别资产[注1]的合理配置。

[注1] 本基金所列收益类别资产:现金类(银行存款、清算备付金、证券清算款等)、债券(国债、央行票据、金融债、投资级以上的公司债、企业债和次级债、可转换债含分离交易可转债、短期融资券、资产支持债券等)、银行定期存款、大额存单、债券回购、债券远期交易以及法律、法规或监管部门允许基金投资的其它固定收益类投资工具及其衍生工具。

本基金投资组合中收益资产的超额收益主要来源于久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择、以及把握市场低效或失效情况下的交易机会。

(1)久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型,预测利率变化趋势,确定投资组合的目标平均久期,实现久期管理。

本基金将债券市场视为金融市场整体的一个有机部分,通过“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策、以及债券市场资金供求等因素的分析,主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式,并据此确定收益资产组合的平均久期。当预测利率和收益率水平上升时,建立较短平均久期或缩短现有收益资产组合的平均久期;当预测利率和收益率水平下降时,建立较长平均久期或增加现有收益资产组合的平均久期。

本基金建立的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标,分析金融市场中各种关联因素的变化,从而判断债券市场趋势。宏观经济指标有GDP、CPI/PPI、固定资产投资、进出口贸易;货币金融指标包括货币供应量M1/2、新增贷款、新增存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将决定央行货币政策,央行货币政策通过调整利率、调整存款准备金率、公开市场操作、窗口指导等方式,带来市场利率变动;同时,央行货币政策对金融机构的资金流也将带来明显的影响,从而引起债券需求变动。本基金在对市场利率变动和债券需求变动进行充分分析的基础上,选择建立和调整最优久期收益资产组合。

(2)收益率曲线策略

本基金将在确定收益资产组合平均久期的基础上,根据利率期限结构的特点,以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化,遵循风险调整后收益率最大化配比原则,建立最优化的债券投资组合,例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

(3)个券选择策略

本基金将通过对个券基本面和估值的研究,选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券,收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。

在个券基本面分析方面,本基金重点关注:信用评级良好的个券,预期信用评级上升的个券和具有某些特殊优势条款的个券。在个券估值方面,本基金将重点关注估值合理的个券,信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券,经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。

(4)把握市场低效或失效状况下的交易机会

在市场低效或无效状况下,本基金将根据市场实际情况,积极运用各类套利以及优化策略对收益资产投资组合进行管理与调整,捕捉交易机会,以获取超额收益。

a) 新券发行溢价策略

在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率,在发行时认购新券可能获得超额收益。

b) 信用利差策略

不同信用等级的债券存在合理的信用利差,由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围,将会出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。

c) 套利策略

套利策略包括跨市场套利和跨期限套利。

跨市场套利是指利用同一只债券类投资工具在不同市场(主要是银行间市场与交易所市场)的交易价格差进行套利,从而提高收益资产组合的投资收益。

跨期限套利是指当短期回购利率低于长期回购利率时,可通过短期融资、长期融券实现跨期限套利。

3、风险资产投资策略

本基金风险资产投资于权益类金融工具,即占比不超过20%的基金资产可适度参与中国A股二级市场股票和权证投资,以及一级市场新股申购或增发新股等,并可持有因在一级市场申购或增发新股所形成的股票或权证,持有因可转债转股所形成的股票及该股票派发的权证或可分离交易可转债分离交易的权证等资产。

本基金风险资产在二级市场重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业。在股票选择方面,充分发挥“自下而上”的主动选股能力,结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断,选择具备外延式扩张能力的优势上市公司,结合财务与估值分析,深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司,构建股票投资组合,同时将根据行业、公司状况的变化,基于估值水平的波动,动态优化股票投资组合

本基金风险资产的权证投资策略主要体现为深入分析权证标的证券基本面,在合理估值的基础上,结合期权定价模型选择市场定价合理的权证进行投资。具体包括价值发现策略、杠杆策略、波动性溢价策略、买入保护性认沽权证策略等。

本基金风险资产的新股申购策略主要体现在从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股或权证的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况,结合新股发行当时的市场环境,根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格,指导新股询价,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高的低风险收益。

随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,本基金将在遵循该产品风险收益特征的前提下,积极寻求其他投资机会,履行适当程序后更新和丰富投资标的以及组合投资策略。

(四)投资决策依据及程序

1、决策依据

(1)国家有关法律、法规和基金合同的规定;

(2)宏观经济环境、国家政策和市场周期分析;

(3)上市公司财务品质和管理能力,以及对公司盈利增长能力的预测。

2、投资决策程序

(1)固定收益小组定期对宏观经济、市场、行业、投资品种和投资策略等提出分析报告,为投资决策委员会和基金经理提供投资决策依据;对于可能对证券市场造成重大影响的突发事件,及时提出评估意见及决策建议;

(2)固定收益小组负责建立和维护公司固定收益券种库,提供各券种的基本面情况及投资要点分析;

(3)基金经理在对经济形势和市场运作态势进行分析后,在券种库的基础上拟定下一阶段基金投资持仓比例,明确投资组合的平均久期,在“既定久期风险调整后收益率最大化”的原则下,对个券基本面进行分析,最终确定重点持券券种,做出《资产配置提案》和重点券种投资方案,报投资决策委员会讨论;

(4)投资决策委员会在基金经理上报的资产配置提案的基础上,进行讨论并确定下一阶段的资产配置和重点券种投资决定,会议决定以书面形式下达给基金经理;

(5)根据投资决策委员会确定的资产配置决议和重点券种投资决定,基金经理负责在固定收益券种库中选择拟投资的券种,并制定投资组合方案;

(6)在基金经理权限内的投资,由基金经理自主实施;超过基金经理权限的,根据规定须报经投资决策委员会执行委员或投资决策委员会批准的,须经批准后实施;

(7)基金管理部负责开发基金投资组合的分析评价体系及其他辅助分析统计工具,对本基金投资组合进行定期跟踪分析,为基金经理和投资决策委员会提供决策支持。

3、交易指令的下达和执行

(1)基金经理以电子口令形式或书面形式向集中交易室下达交易指令;

(2)集中交易室主管组织交易员根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查,确保投资指令合法、合规,同时拟定交易计划;

(3)交易员准确及时执行;

(4)集中交易室主管组织、监督交易员完成交易;

(5)集中交易室及时反馈市场信息,保持与基金经理的有效沟通。

4、投资风险的监控和管理

(1)监察稽核部负责组织实施监控措施,通过交易系统检查包括投资集中度、投资组合比例、投资禁止、投资限制、投资权限等交易情况,对投资风险进行日常监管。确保投资目标实现以及投资限制的执行;

(2)集中交易室主管有权修正交易员的交易行为;

(3)风险控制与审计委员会成员、投资总监、集中交易室主管以及监察稽核人员实施监督;

(4)基金绩效评估和风险管理岗位定期出具基金绩效评估和风险管理报告。基金经理根据有关意见对投资组合进行调整。

(五)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算公司发布的中国债券总指数。

本基金管理人认为选择该业绩比较基准体现了基金产品本身的投资特征,体现了目标客户群的风险收益偏好,且该指数合理、透明、公开,具有较好的市场接受度。

若未来市场发生变化导致本业绩基准不再适用,本基金管理人可以根据当时市场状况和基金投资范围及投资策略的要求调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准应经投资决策委员会批准后,报中国证监会核准,基金管理人将在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

(六)风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。本基金为中等风险、中等收益基金产品。

本基金不低于80%的基金资产投资于固定收益类投资品种,与较激进型的股票型基金相比,属于较低风险度的债券基金品种;同时为获得权益类投资市场的阶段性机会以提高整个基金投资组合的收益,本基金不高于20%的基金资产可视市场时机适度投资二级市场股票和权证,也可参与一级市场新股申购或增发新股,以此获得较高的债券组合的平均收益。故其风险和预期收益水平低于股票型基金、高于货币市场基金,并略高于没有权益类投资策略的债券型基金。

(七)建仓期

本基金管理人自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

(八)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)本基金组合资产中固定收益类资产占基金资产净值比例为80%–100%,权益类资产占基金资产净值比例为0–20%,且本基金持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(2)本基金投资于同一公司发行的债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

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

(4)本基金财产参与股票发行申购,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%;

(6)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%;

(7)本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%;

(8)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%;

(9)本基金在银行间同业市场债券回购融入资金额不得超过基金资产净值的40%;

(10)本基金必须投资于信用评级为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三个月内予以全部卖出;

(11)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%;

(12)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发行规模的10%;

(13)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%;

(14)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的比例,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(15)如果法律法规对本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。

(下转C12版)