

信息披露 Disclosure

中国证券报

(上接B050版)

传真:021-62881889

联系人:王国儒

经办注册会计师:王国儒、黄小熠

四、基金的名称

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金。

五、基金类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金为股票型基金,力求通过对沪深300非周期行业指数进行完全复制,在严格控制跟踪误差的基础上,为投资者提供一个投资于沪深300非周期行业指数的有效工具。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300非周期行业指数的成分股以及其备选成分股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票),新股(一级市场初次发行和增发)、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(包括期权等金融衍生品),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:沪深300非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的90%,在任何交易日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的100%,每个交易日终在扣除股指期货合约缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内(含)的政府债券不低于基金资产净值的5%,保证占基金资产净值的比例为0~3%,其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

八、基金的投资策略

1.标的指数
本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300非周期行业指数。

沪深300非周期行业指数是中指指数有限公司编制的以沪深300指数成分股中的非周期行业股票作为样本,能够较为全面反映沪深两市A股市场非周期行业投资特点,中证系列指数中指数有限公司编制和计算,关于指数成分股的所有版权归属中指指数有限公司。

如果沪深300非周期行业指数被停止编制及发布,或沪深300非周期行业指数由其他指数替代(单独或同时),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300非周期行业指数不宜继续作为标的指数,基金管理人可以依据审慎原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更基金的标的指数和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等因素选择确定新的标的指数。本基金由于上述原因变更标的指数,不需召开基金份额持有人大会通过,但应及时通知基金管理人并报中国证监会备案,并在履行必要手续后,在中国证监会指定的媒体上公告,并在新的招募说明书中列示。若本基金由于变更投资目标、范围或策略而变更标的指数的,应当召开基金份额持有人大会。

2.投资策略
本基金采用完全复制法跟踪标的指数,即按照沪深300非周期行业指数的成分股组成及权重构建股票投资组合,进行被动指数化投资。

在建仓期结束后,本基金力争将年度跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

在基金运作过程中,当发生以下情况时,基金管理人将发挥专业优势,对投资组合进行适当调整,使跟踪误差控制在限制范围之内。

(1)标的指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成分股及权重的影响,在适当时机,采用适当方法调整投资组合。

(2)成分股发生新增、剔除等定期或临时调整。基金管理人将预测成分股调整方案,并判断指数成分股调整对投资组合的影响,在此基础上制定投资组合调整策略。

(3)沪深300非周期行业指数成分股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将分析这些信息对指数的影响,进而进行投资组合调整分析,确定相应的投资组合调整策略。

(4)基金发生申购赎回、基金分红、参与新股申购等影响跟踪效果的情形,基金管理人将分析这些情形对跟踪误差的影响,并相应调整投资组合。

(5)指数成分股的股票停牌、股票流动性不足等其他市场因素的影响,或者法律法规限制等合规因素的影响,使得基金管理人无法依据指数构成购买成分股的情形,基金管理人将根据市场情况,以跟踪误差最小化为原则,采用样本替代等方式对投资组合进行调整。

十、风险揭示特征
本基金为跟踪指数的股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

为有效控制投资组合对标的指数的跟踪误差,本基金投资股指期货将本着风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活

跃的合约。基金管理人将根据宏观经济因素和资本市场状况,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型对估值水平合理性地评估,并通过与现货资产进行匹配,选择合适的投资时机,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险,对冲特殊情况下流动性风险,如大额申赎回等;对冲其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;本基金主要利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整而导致的交易成本和跟踪误差,从而确保投资组合对标的指数的跟踪效果。

3.投资决策依据

以国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定为投资依据,并以维护基金份额持有人利益为最高准则。

4.投资决策原则

(1)合法合规原则。公司各类投资、研究业务应都严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。

(2)公平交易原则。公司应公平对待不同基金份额持有人、基金份额持有人和其他资产委托人,不得在不同基金财产之间、基金财产和其

他委托资产之间直接或通过第三方交易等形式进行利益输送。公司应制定公平交易制度和公平交易规则,明确公平交易的原则和实施措施。

(3)独立性原则。公司基金资产、其他委托资产和固有资产的运作应当严格分离;投资、研究、决策、交易和评估等部门和岗位应当在物理上和制度上分离。不同的基金要独立运作,分别管理。

(4)相互制约原则。投资业务部门和岗位的设置必须权责分明、相互牵制,并通过切实可行的制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(5)严控授权原则。授权制度是投资管理业务控制的核心,必须贯穿于公司投资管理活动的全过程;

(6)研究制约原则。任何基金投资决策都必须建立在有研究支持的基本之上。

5.投资决策流程

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定基金投资的整体投资机会和投资原则,决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策,基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

(1)投资运用数量化模型以及各种风险监控指标,对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算,并提供数量化风险分析报告;研究标的指数成分股的基本面和流动性变化的企业提供及时的风险分析报告。清算登记部每日提供基金申购赎回的数据分析,供基金经理投资决策参考。

(2)投资决策委员会定期召开会议,依据上述报告对资产配置制整体投资战略;如遇重大事项,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

(3)基金经理根据数量化风险分析和申购赎回分析报告,在追求跟踪误差最小化的情况下,控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险,降低交易成本。

(4)中央交易室依据基金经理指令,制定交易策略,通过组合交易系统执行投资组合的交易。

(5)投资组根据市场变化,定期和不定期地对基金投资业绩进行评估,并提供相关绩效评估报告。

(6)风险管理部根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议。监察稽核部对指数化投资的执行过程进行合规监控,基金经理依据申购赎回和成份股停牌等情况,对投资组合进行监控和调整。

本基金对标的指数成分股的充分投资,股票资产占基金资产的比例为90%~95%,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%,因此采用该采样方法构建以上业绩比较基准。

如果沪深300非周期行业指数被停止编制及发布,或沪深300非周期行业指数由其他指数替代(单独或同时),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300非周期行业指数不宜继续作为标的指数,本基金

经理人可以依据审慎原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更基金的标的指数和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等因素选择确定新的标的指数。本基金由于变更投资目标、范围或策略而变更标的指数的,应当召开基金份额持有人大会。

11.风险揭示特征
本基金为跟踪指数的股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的较高风

险、较高收益品种。

司的具体尽职调查、审计、评估等工作,并对重组后续推进方案进行充分沟通和审慎论证,同时认真按照有关要求,在重大资产重组事项期间每30日发布一次重大资产重组进展公告,认真履行信息披露义务。

三、相关信息披露及风险提示
在重大资产重组开展过程中,本公司按照证监监管部门的有关规定履行信息披露义务,并充分披露重组中存在的风险。四、首次重大资产重组的原因
自本次重大资产重组事项以来,公司、中介机构以及相关各方就本次重大资产重组事项进行了积极的商讨和准备,并披露了相关公告,其中独立董事陈耀华先生因公外出,特委托独立董事胡锦光先生代为出席并表决,会议召开符合《上市公司章程》及《公司法》等相关规定,会议决议如下:

1.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止本次重大资产重组的议案》。

2.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于共同发起设立零七广和(上海)云计算产业投资慧盈基金的议案》。

3.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的公告》。

4.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

5.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

6.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

7.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

8.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

9.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

10.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

11.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

12.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

13.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

14.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

15.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

16.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

17.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

18.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

19.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

20.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

21.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

22.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

23.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

24.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

25.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

26.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

27.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

28.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

29.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

30.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

31.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

32.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

33.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

34.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

35.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

36.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

37.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

38.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

39.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

40.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

41.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

42.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

43.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

44.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

45.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

46.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

47.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

48.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

49.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

50.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

51.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

52.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

53.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

54.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

55.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

56.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

57.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

58.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

59.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

60.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

61.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

62.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

63.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

64.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

65.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

66.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

67.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

68.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

69.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

70.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

71.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大资产重组的议案》。

72.以投票表决方式,同意对公司本次重大资产重组事项通过了《关于终止重大