（上接A25版）

联系电话：010-66577619，010-66577617
客服信箱：irm@mfcteda.com
客服电话：400-698-8888
传真：010-66577760/61
公司网站：http://www.mfcteda.com
2）泰达宏利基金网上直销系统
交易系统网址：https://etrade.mfcteda.com/etrading/
支持基金管理人旗下基金网上直销的银行卡和第三方支付有：农行卡、建行卡、民生银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、交通银行卡、浦发银行卡、中国银行卡、广发银行卡、上海银行卡和汇付天下“天天盈”、支付宝账户等。
泰达宏利微信公众账号：mfcteda_BJ，支持民生银行卡、招商银行卡、支付宝账户和汇付天下“天天盈”账户。
客户服务电话：400-698-8888或010-66555662
客户服务信箱：irm@mfcteda.com
2、代销机构
1） 中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客服电话：95566
银行网站：www.boc.cn
其他销售机构信息及联系方式详见本基金募集前发布的基金份额发售公告
（二）登记机构
名称：泰达宏利基金管理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层
法定代表人：弓劲梅
联系人：石楠
联系电话：010-66577769
传真：010-66577750
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：北京市天达共和律师事务所
注册地址：北京市朝阳区麦子店街37号盛福大厦1930室
办公地址：北京市朝阳区麦子店街37号盛福大厦1930室
负责人：李东明
电话：010-85276468
传真：010-85275038
经办律师：韩津生、张璇
联系人：张璇
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人：赵柏禄
经办注册会计师：单峰、庞伊君
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：庞伊君

六、基金的募集

（一）本基金募集申请已于2014年12月25日获中国证监会证监许可[2014]1416号文注册。并于2015年9月9日获得中国证监会证券基金机构监管部关于泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函(机构部函[2015]2515号)，核准延长募集。
（二）基金类型、运作方式及存续期
本基金类型：混合型发起式证券投资基金
本基金运作方式：契约型，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式
本基金存续期：不定期
（三）基金份额的发售时间、发售方式和发售对象
1、募集时间：募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。具体时间由基金管理人与销售机构约定（详见基金份额发售公告及销售机构相关公告）。基金管理人根据认购的具体情况可适当延长募集期，但最长不超过3个月，同时基金管理人也可根据基金认购和市场情况提前结束发售。
2、发售方式：本基金通过各销售机构的基金销售网点（包括基金管理人的直销中心、网上直销网点，具体名单见基金份额发售公告）公开发售。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。
3、发售对象：指符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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者。
（四）基金份额的认购限制
1、投资者认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。
2、投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。
3、通过基金管理人直销中心认购，单个基金账户单笔首次认购最低金额为10万元（含认购费），追加认购最低金额为1000元（含认购费）；通过代销机构认购，单个基金账户单笔认购最低金额为1,000元人民币（含认购费）。
通过基金管理人网上直销进行认购，单个基金账户单笔最低认购金额为10元（含认购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销相关说明。
4、募集期间单个投资者的累计认购规模没有限制。
（五）基金的最高募集规模
本基金募集期内不设募集目标上限。
（六）基金份额的初始面值、认购费用、认购价格及计算公式
1、基金份额初始面值：基金份额的初始面值为人民币1.00元。
2、认购费率
本基金基金份额在认购时收取基金认购费用。投资者如果有多笔本基金份额的认购，适用费率按单笔分别计算。本基金对通过直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的认购费率。
养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划等。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。
（1）通过基金管理人的直销中心认购本基金基金份额的养老金客户认购费率见下表：

认购金额（M，含认购费）	认购费率
M＜100万元	0.25%
100万元≤M＜250万元	0.15%
250万元≤M＜500万元	0.075%
M≥500万元	按笔收取，1000元/笔

（2）其他投资者（非养老金客户）认购本基金基金份额认购费率见下表：

认购金额（M，含认购费）	认购费率
M＜100万元	1.0%
100万元≤M＜250万元	0.6%
250万元≤M＜500万元	0.3%
M≥500万元	按笔收取，1000元/笔

本基金的认购费用应在投资者认购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
3、认购份额的计算
认购本基金基金份额的认购费用采用前端收费模式，即在认购基金基金份额时缴纳认购费。本基金基金份额采用金额认购的方式。投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。
本基金基金份额的认购份额的计算方法如下：
（1）适用比例费率时，本基金基金份额的认购份额计算如下：
净认购金额＝认购金额／（1＋认购费率）
认购费用＝认购金额－净认购金额
认购份额＝（净认购金额＋认购利息）／基金份额初始面值
（2）适用固定费用时，本基金基金份额的认购份额计算如下：
净认购金额＝认购金额-固定费用
认购费用＝固定费用
认购份额＝（净认购金额＋认购利息）／基金份额初始面值
基金认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点后两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。
例如：某投资者（非养老金客户）认购本基金基金份额10万元，所对应的认购费率为1.0%。假定该笔认购产生利息100元。则认购本基金基金份额为：
净认购金额＝认购金额／（1＋认购费率）＝100,000／（1+1.0%）=99,009.90元
认购费用＝认购金额－净认购金额＝100,000－99,009.90＝990.10元
认购份额＝（净认购金额＋认购期间的利息）／基金份额初始面值＝（99,009.90+100）／1.00＝99,199.90份
即：投资者（非养老金客户）投资10万元认购本基金基金份额，假定该笔认购产生利息100元，在基金合同生效时，投资者账户登记有本基金基金份额99,199.90份。
（七）认购的办法
投资者认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅基金份额发售公告。
（八）认购的确认
销售网点（包括直销中心、网上直销和销售网点）受理申请并不表示对该申请已经成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金登记机构的确认登记为准。投资者应在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。
于网上直销系统认购的投资者可于申请日（T日）后的第2个工作日（T+2）起在基金管理人网站查询认购结果，但此确认是对认购申请的确认，其最终结果要待基金合同生效后才能够确认；已受理的认购申请不能进行撤销，有关网上直销的相关认购程序请以基金管理人公司网站最新的说明及基金份额发售公告为准。
（九）募集期利息的处理方式
有效认购资金在募集期形成的利息将折算为基金份额归投资者所有，不收取认购费用。利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。
（十）募集期间的资金
基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金合同生效前，任何人不得动用。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件
本基金自基金份额发售之日起3个月内，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元，发起资金的提供方承诺持有期限不少于三年的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在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，向中国证监会办理基金备案手续。
基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人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。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。
（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式
如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：
1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。
（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模
基金合同生效满3年当日的前60天内连续20个工作日，基金资产净值低于2亿元的，本基金将在保持投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征等其他内容不变的情况下，转换为能够每日申购、赎回的开放式基金，基金合同中对应定期开放条款相应修改，并终止附加管理费的计提，而不需召开基金份额持有人大会。
基金合同生效满3年当日，基金资产净值低于2亿元的，基金合同应当终止。基金合同生效之日起3年后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金合同应当终止，并按照基金合同约定的程序进行清算，而无需召开基金份额持有人大会。
法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额开放期与封闭期

（一）基金的封闭期
本基金的首个封闭期为自基金合同生效日（包括基金合同生效日）起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。
本基金在封闭期内采取封闭运作模式。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。
（二）基金的开放期
本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过5个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深300股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。
如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直到满足开放期的时间要求。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，基金管理人最迟应于开放期开始前2日进行公告。

九、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所
本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。
（二）申购和赎回的开放日及时间
1、开放日及开放时间
在开放期内本基金采取开放运作模式，本基金的申购和赎回开放日为本基金开放期内的每个工作日，投资人在申购和赎回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，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介上公告。
2、申购、赎回开始日及业务办理时间
除法律法规或基金合同另有约定外，本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，开始办理申购和赎回等业务。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见招募说明书及基金管理人届时发布的相关公告。
本基金每个开放期的具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格，但若投资人在开放期到期日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换申请的，视为无效申请。
（三）申购与赎回的原则
1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
5、“基金份额持有人利益优先”原则，即若发生申购、赎回损害持有人利益的情形时，应当及时暂停申购、赎回业务。
基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
（四）申购与赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
2、申购和赎回的款项支付
投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。
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。特殊情况下，基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人可与基金托管人协商，在法律法规规定的期限内向基金份额持有人支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至下一个工作日划往基金份额持有人银行账户。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。
3、申购和赎回申请的确认
基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。
销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。
（五）申购和赎回的数量限制
1、申请申购基金的金额
通过直销中心申购本基金，单个基金账户单笔首次申购最低金额为10万元（含申购费），追加申购最低金额为1000元（含申购费），已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制；通过代销机构申购本基金，单个基金账户单笔申购最低金额为1,000元人民币（含申购费）。
通过基金管理人网上直销进行申购本基金，单个基金账户单笔最低申购金额为10元（含申购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销说明。
2、申请赎回基金的份额
投资者可将全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回的基金份额不得低于100份。
3、基金份额持有人赎回时或赎回后，在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足100份的，基金管理人有权一次将持有人在该交易账户保留的剩余基金份额全部赎回。
4、本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制。
5、基金管理人可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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，并根据中国证监会相关要求办理。
（六）申购费用与赎回费用
1、申购费用
本基金基金份额在申购时收取基金申购费用。投资者如果有多笔本基金基金份额的申购，适用费率按单笔分别计算。本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。
（1）通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表所示：

申购金额（M，含认购费）	申购费率
M＜100万元	0.375%
100万元≤M＜250万元	0.25%
250万元≤M＜500万元	0.15%
M≥500万元	按笔收取，1000元/笔

（2）本基金其他投资者（非养老金客户）申购本基金基金份额申购费率如下表：

申购金额（M，含认购费）	申购费率
M＜100万元	1.5%
100万元≤M＜250万元	1.0%
250万元≤M＜500万元	0.6%
M≥500万元	按笔收取，1000元/笔

本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
2、赎回费用
本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。
本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于7日的投资人收取1.5%的赎回费，对持续持有期大于等于7天少于30日的投资人收取0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于30天少于90天的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期大于等于90天少于180天的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期大于等于180天少于365天的投资人收取0.5%的赎回费，将赎回费总额的25%计入基金财产；对持续持有期大于等于365天少于730天的投资人收取0.25%的赎回费，将赎回费总额的25%计入基金财产；对持续持有期长于730天的投资人将不收取赎回费。本基金基金份额的赎回费率具体如下：

连续持有期限（日历日）	最低赎回费率	计入基金资产比例
1天-6天	1.5%	100%
7天-29天	0.75%	100%
30天-89天	0.5%	75%
90天-179天	0.5%	50%
180天-364天	0.5%	25%
365天-730天	0.25%	25%
731天以上	0%	-

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或调整收费方式。申购、赎回费率或收费方式如发生变更，基金管理人应依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
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况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，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率。
（七）申购和赎回的数额和价格
1、申购份额的计算
申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算。
（1）若适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：
净申购金额＝申购金额／（1＋申购费率）
申购费用＝申购金额－净申购金额
申购份额＝净申购金额／申购当日基金单位净值
（2）若适用固定费用时，申购份额的计算方法如下：
净申购金额＝申购金额-固定费用
申购费用＝固定费用
申购份额＝净申购金额／申购当日基金单位净值
上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两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。
例如：某投资者(非养老金客户)投资5万元申购本基金基金份额，对应费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.016元，则其可得到的申购份额为：
净申购金额＝申购金额／（1＋申购费率）＝50,000／（1+1.5%）＝49,261.08元
申购费用＝申购金额－净申购金额＝50,000－49,261.08＝738.92元
申购份额＝净申购金额／申购当日基金份额净值＝49,261.08／1.016＝48,485.32份
即：投资者投资5万元申购基金，假设申购当日本基金基金份额净值为1.016元，则可得到48,485.32份基金份额。
2、基金份额赎回金额的计算
赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额。
赎回金额＝赎回份数×T 日基金份额净值
赎回费用＝赎回金额×赎回费率
净赎回金额=赎回金额－赎回费用
计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。
例如：某投资者赎回本基金基金份额1 万份，持有时间为28天，对应赎回费率为0.75%，假设赎回当日本基金基金份额净值是1.12 元，则其可得到的赎回金额为：
赎回金额=10,000×1.12=11,200.00 元
赎回费用=11,200×0.75%=84 元
净赎回金额=11,200-11.20=11,116 元
即：投资者赎回基金份额1 万份，持有期限为28，对应赎回费率为0.75%，假设赎回当日本基金基金份额净值是1.12 元，则其可得到的赎回金额为11,116元。
3、本基金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，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。
T日的基金份额净值在当天收市后计算，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各类基金份额的基金份额净值；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交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。各个基金份额类别单独计算基金份额净值，计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。
（八）申购和赎回的登记
1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。
2、投资者T日申购基金成功后，基金登记机构在T＋1日为投资者增加权益并办理登记手续，投资者自T＋2日起有权赎回该部分基金份额。
3、投资者T日赎回基金成功后，基金登记机构在T＋1日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。
4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在指定媒介上公告。
（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理
在开放期内发生下列情形时，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管理人不能支付赎回款项。
2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
3、证券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。
4、开放期内连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
5、基金管理人认为接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，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4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。
开放期内因发生不可抗力等原因而发生暂停赎回情形的，开放期将按因不可抗力而暂停赎回的时间相应延长。
（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20%，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20%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个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。
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，同时在指定媒介上刊登公告。
（十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告
1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。
2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介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、若暂停时间超过1日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告增加次数。
以上暂停及恢复基金申购与赎回的公告规定，不适用于基金合同约定的开放期与封闭期基金运作方式转换引起的暂停或恢复申购与赎回的情形。开放期与封闭期基金运作方式转换的有关信息披露按照招募说明书的相关约定执行。
（十二）基金转换
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。
（十三）基金的非交易过户
基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。
继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠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机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。
（十四）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另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，每期申购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。
（十六）基金份额的冻结和解冻
基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。
如相关法律法规允许基金管理人办理其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

十、基金的投资

（一）投资目标
灵活运用多种绝对收益策略，对冲各类系统性风险，力争为投资者实现稳定的投资收益。
（二）投资范围
本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金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的相关规定）。
本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。
开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。
开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。
本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
（三）投资策略
本基金采用以市场中性投资策略为主以其他多种Alpha策略为辅构建多策略组合的多种绝对收益策略，通过利用股指期货和其他多种衍生品工具剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。
1、市场中性投资策略
本基金采用包含基本面、市场信息的多维量化选股模型构建多头股票组合，结合多种市场中性策略匹配合适的空头工具，剥离系统性风险。
（1）多头股票投资策略
本基金对公司基本面研究信息、财务信息、市场信息、投资者情绪信息等多方面数据进行处理和数量化研究，构建多种alpha信号，采用数量化风险模型对组合进行优化，构造与对冲标的风险结构类似的多头股票组合。
多种超额收益信息来源是获得稳定对冲收益的核心。通过数量模型方法分析上市公司的成长能力、估值、盈利能力、公司治理能力、流动性、动量等因素，结合市场情绪，构建多种低相关的超额收益来源，可以充分分散组合的超额收益波动风险，获取相对稳定的超额收益。
数量化风险模型是使超额收益稳定的必要工具。该基金管理通过分析市场风险结构，建立了以基本面数据为基础的风险模型以控制主动风险和个股预期波动率，从估值、成长、波动性、盈利质量等因素出发并结合细化的行业分类对风险要素进行分析，结合对预期收益的分析和对冲工具的选择，尽量对冲掉各类对基金业绩具有显著不确定性影响的风险因素，在风险暴露允许的范围内采用量化模型优化组合，最大化的体现alpha信息，以确保组合在各种风格轮动的市场环境下均有较稳定的回报。同时，本基金通过数量化风险模型估算组合暴露风险，做合理的风险预算，控制组合的下行风险。
在行业和市场风格层面，该基金将通过对市场风格特征的监控，对行业基本面变化的研究以及投资者对市场情绪的认识偏差的研究进行有限风险预算下的行业偏离和风格偏离，通过超低配行业权重和风格偏离获取超额收益.
（2）空头工具投资策略
现阶段本基金将利用股指期货剥离多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。
（3）事件驱动策略
本基金将通过对中国宏观经济和上市公司的研究，通过定量模型的监控，提前发掘对行业或者个股具有明显驱动和定价作用的事件性因子，通过因子的筛选和配比构建事件类策略的股票池并通过风险模型充分评估和考量个股对整体组合所带来风险的前提下构建最终的投资组合.
2、其他绝对收益策略
本基金采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他绝对收益策略（如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等）策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。
（1）股指期货套利策略
股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：
①期现套利
期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。
②跨期套利
跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。
（2）其他绝对收益策略
基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他绝对收益策略。
3、其他投资策略
（1）债券投资策略
本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。
（2）衍生品投资策略
本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。
（四）投资限制
1、组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制：
（1） 本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；
（2）开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；
（3）开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制；
（4）本基金持有一家公司的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；
（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的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%；
（10）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%；
（11）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%；
（12）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
（13）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
（14）基金财产参与股票发行申购，本基金所申