(上接A30版)

费用种类	A类基金份额		C类基金份额
认购费率	M＜100万	0.60%	0%
	100万≤M＜300万	0.40%	
	300万≤M＜500万	0.20%	
	M≥500万	按笔收取,1,000元/笔	

注:M为金额。

本基金认购费由认购人承担,不列入基金财产。认购费用用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

5、认购价格及认购份额的计算

本基金的认购价格为每份基金份额1.00元。

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以登记机构的记录为准。

(1)A类基金份额的认购份额计算方法

投资者的总认购份额的计算方式如下:

当认购费用适用比例费率时:

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)/基金份额发售面值

当认购费用适用固定金额时:

认购费用＝固定金额

净认购金额＝认购金额-认购费用

认购份额＝(净认购金额＋认购期间利息)／基金份额发售面值

认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。

例:某投资者投资10,000元认购本基金的A类基金份额,如果认购期内认购资金获得的利息为5元,则其可得到的基金份额计算如下:

净认购金额＝10,000/(1+0.6%)＝9,940.36元

认购费用＝10,000－9,940.36＝59.64元

认购份额＝(9,940.36＋5)/1.00＝9945.36份

即投资者投资10,000元认购本基金的A类基金份额，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到9945.36份基金份额。

(2)C类基金份额的认购份额计算方法

投资者的总认购份额的计算方式如下:

认购份额＝(认购金额＋认购利息)/基金份额发售面值

认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。

例:某投资者投资10,000元认购本基金的C类基金份额,如果认购期内认购资金获得的利息为5元,则其可得到的基金份额计算如下:

认购份额=(10,000＋5)/1.00=10,005.00份

即投资者投资10,000元认购本基金的C类基金份额,加上认购资金在认购期内获得的利息,可得到10,005.00份基金份额。

6、认购的方法与确认

(1)认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续,由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同,在基金份额发售公告中确定并披露。

(2)认购确认

销售网点(包括本公司的直销中心、本公司网上交易系统和其他销售机构的基金销售网点)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。投资者可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。

如果接受某笔或某些认购申请有可能导致单一投资者的累计认购规模占所有投资者累计认购总规模比例达到或者超过50%，或者存在变相规避50%集中度的情形时，基金管理人可拒绝接受投资者的认购申请。

7、募集期间认购资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

十二、募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集结束前任何人不得动用。

基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案和基金合同生效

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2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，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》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,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,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

一、申购与赎回办理的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构见本招募说明书第五部分内容或其他相关公告。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、申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资者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,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。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

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、申购与赎回的开始时间

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,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介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。投资者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。

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,即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则。

6、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采取摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者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

投资者申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资者交付申购款项,申购成立;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。

基金份额持有人赎回申请成功后,基金管理人将在T＋7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货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时,赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,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,投资者应在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。若申购不成功或无效,则申购款项本金退还给投资者。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回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。

在法律法规允许的范围内,本基金登记机构可根据相关业务规则,对上述业务办理时间进行调整,本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

五、申购与赎回的数额限制

1、申购时,投资者通过销售机构网点每笔申购本基金的最低金额为10元人民币(含申购费);通过本基金管理人网上交易系统申购,每个基金账户单笔申购最低金额为10元人民币(含申购费);通过本基金管理人直销中心申购,首次最低申购金额为5万元人民币(含申购费),已在直销中心有认/申购本公司旗下基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制,单笔申购最低金额为10元人民币(含申购费)。本基金直销机构单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。实际操作中,以各销售机构的具体规定为准。

投资者将当期分配的基金收益再投资时,不受最低申购金额的限制。

2、通过本基金的销售机构赎回,每次赎回基金份额不得低于10份,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10份的,在赎回时需一次全部赎回。实际操作中,以各销售机构的具体规定为准。

如遇巨额赎回等情况发生而导致延期赎回时,赎回办理和款项支付的办法将参照基金合同有关巨额赎回或连续巨额赎回的条款处理。

3、单个投资者累计持有的基金份额占总基金份额的比例不得达到或者超过50%,也不得存在变相规避50%集中度的情形(运作过程中,因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外)。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见相关公告。

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报中国证监会备案。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费

本基金A类基金份额在申购时收取基金申购费用;投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金C类基金份额不收取申购费。具体费用安排如下表所示:

基金的申购费率结构

费用种类	A类基金份额		C类基金份额
申购费率	M＜100万	0.80%	0%
	100万≤M＜300万	0.60%	
	300万≤M＜500万	0.40%	
	M≥500万	按笔收取,1,000元/笔	

注:M为金额。

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费

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。对于持有A、C类份额持有期少于30天的,收取的赎回费全额计入基金财产;对于持有A类份额持有期少于3个月的,不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对于持有A类份额持有期长于3个月但小于6个月的,不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对于持有A类份额持有期长于6个月的,不低于赎回费总额的25%计入基金财产。上述“月”是指30个自然日。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减,具体费率如下:

基金的赎回费率结构

费用种类	A类基金份额		C类基金份额	
赎回费率	持有期限	赎回费率	持有期限	赎回费率
	Y＜7天	1.50%	Y＜7天	1.50%
	7天≤Y＜30天	0.75%	7天≤Y＜30天	0.50%
	30天≤Y＜180天	0.50%		
	180天≤Y＜1年	0.10%	Y≥30天	0%
	1年≤Y＜2年	0.05%		
	Y≥2年	0%		

注:Y为持有期限,1年指365天。

3、赎回费用未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、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,并最迟应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。

5、基金管理人可以在不违反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,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和基金赎回费率。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式:本基金A类基金份额在申购时收取基金申购费用,投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算;C类基金份额不收取申购费。

(1)A类基金份额

如果投资者选择申购A类基金份额,则申购份数的计算方法如下:

当申购费用适用比例费率时:

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A类基金份额净值

当申购费用适用固定金额时:

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额净值

各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:某投资者投资5万元申购本基金的A类基金份额,假设申购当日A类基金份额净值为1.0500元,则可得到的申购份额为:

净申购金额＝50,000/(1＋0.8%)＝49,603.17元

申购费用＝50,000－49,603.17＝396.83元

申购份额＝49,603.17/1.0500＝47,241.11份

即:投资者投资5万元申购本基金的A类基金份额,假设申购当日A类基金份额净值为1.0500元,则其可得到47,241.11份基金份额。

(2)C类基金份额

如果投资者选择申购C类基金份额,则申购份数的计算方法如下:

申购份额=申购金额/申购当日C类基金份额净值

各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:某投资者投资5万元申购本基金的C类基金份额,假设申购当日C类基金份额净值为1.0500元,则可得到的申购份额为:

申购份额=50,000/1.0500=47,619.05份

即:投资者投资5万元申购本基金的C类基金份额,假设申购当日C类基金份额净值为1.0500元,则其可得到47,619.05份基金份额。

2、赎回金额的计算方式:A类基金份额和C类基金份额赎回费率均随投资者持有基金份额期限的增加而递减。

(1)A类基金份额

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中,

赎回金额＝赎回份数×赎回当日A类基金份额净值

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

赎回费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位;赎回金额结果按照四舍五入方法,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:某投资者赎回本基金1万份A类基金份额,持有时间为2个月,对应的赎回费率为0.5%,假设赎回当日A类基金份额净值是1.2500元,则其可得到的赎回金额为:

赎回金额＝10,000×1.2500＝12,500.00元

赎回费用＝12,500.00×0.5%=62.50元

净赎回金额＝12,500－62.50＝12,437.50元

即:投资者赎回本基金1万份A类基金份额，持有期限为2个月，假设赎回当日A类基金份额净值是1.2500元,则其可得到的赎回金额为12,437.50元。

(2)C类基金份额

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中,

赎回金额＝赎回份数×赎回当日C类基金份额净值

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

赎回费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位;赎回金额结果按照四舍五入方法,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:某投资者赎回本基金1万份C类基金份额,持有时间为2个月,假设赎回当日C类基金份额净值是1.2500元,则其可得到的赎回金额为:

赎回金额＝10,000×1.2500＝12,500.00元

赎回费用＝12,500×0%=0元

净赎回金额=12,500.00－0=12,500.00元

即:投资者赎回本基金1万份C类基金份额,持有期限为2个月,假设赎回当日C类基金份额净值是1.2500元,则其可得到的赎回金额为12,500.00元。

3、基金份额净值计算

由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各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。

T日某类基金份额净值＝T日该类基金资产净值/T日该类基金份额余额。

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。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,并在次日公告。遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

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者的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

3、证券、期货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、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、接受某笔或某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、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,或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

8、接受某笔或某些申购申请将使基金总规模超过基金管理人设定的基金总规模限制、使单日净申购比例超过上限或该申购申请超过单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、6、7、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项本金将退还给投资者。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者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,以及因不可抗力导致基金管理人无法接受基金份额持有人的赎回申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

3、证券、期货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、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、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投资者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,且该部分按照赎回申请确认日的基金份额净值为基础进行计算。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。

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、部分延期赎回或暂停赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时,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者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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,投资者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。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。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,直到该部分全部赎回为止。

对于该单个基金份额持有人当日10%以内(含10%)的赎回申请,应当与其他投资者的赎回申请合并计算后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。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。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。

(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

当发生上述巨额赎回并延期办理的,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个开放日各类基金份额的基金份额净值。

3、如果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个工作日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近1个工作日各类基金份额的基金份额净值。

4、如果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2个工作日在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近1个工作日各类基金份额的基金份额净值。

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、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十四、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者。

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,基金销售机构可以按照其规定的标准收费。

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者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者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、基金份额的冻结、解冻和质押

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。

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。法律法规或监管部门另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力求实现基金资产的持续稳健增值。

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,包括国内依法发行上市交易的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货、权证、货币市场工具,同业存单,银行存款以及现金,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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债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,其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

1、资产配置策略

本基金将由投资研究团队及时跟踪资本市场环境变化,根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、资本市场运行状况等因素的深入研究,分别判断股票和债券等市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析、公司盈利能力与现金流状况,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观经济数据、预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响,同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响,在严格控制信用风险暴露程度的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

5、衍生品投资策略

(1)股指期货投资策略

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析,发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点,采用股指期货在短期内取代部分现货,获取市场敞口,投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时,为避免市场冲击,提前建立股指期货多头头寸,然后逐步买入现货并解除股指期货多头,当完成现货建仓后将股指期货平仓;空头套期保值指当基金需要卖出现货时,先建立股指期货空头头寸,然后逐步卖出现货并解除股指期货空头,当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中,将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合beta的稳定性,精细化确定投资方案比例。

(2)国债期货投资策略

本基金以提高对利率风险管理能力,在风险可控的前提下,本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析;构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

(3)权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合,力求取得最优的风险调整收益。

四、业绩比较基准

1、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%＋中债综合全价(总值)指数收益率×30%。

2、选择理由

沪深300指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数。中债综合全价(总值)指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

本基金是混合型证券投资基金,本基金对沪深300指数和中债综合全价(总值)指数分别赋予70%和30%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接收的业绩比较基准推出,基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则调整基金业绩比较基准。经与基金托管人协商一致,本基金可在报中国证监会备案后更变业绩比较基准并及时公告。

五、风险收益特征

本基金属于混合型基金,风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

六、投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

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)违反规定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,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)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;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略,遵循持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、基金投资组合比例限制

基金管理人运用基金财产进行证券投资,本基金的投资遵守下列限制:

(1)基金股票投资比例为基金资产的60%-95%;

(2)每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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,其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)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%;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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0.5%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)本基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;

(13)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;

(14)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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(16)基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

(17)基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(18)基金参与股指期货、国债期货交易,应当遵守下列要求:开放式基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(19)本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过该基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(20)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(21)本基金管理人与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

本基金投资流通受限证券,基金管理人应根据中国证监会相关规定进行投资。基金管理人应制订严格的