(上接A29版)

华泰证券资产托管部拥有独立的安全监控设施,稳定、高效的托管业务系统,完善的业务管理制度。保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时披露,为基金份额持有人利益履行基金托管职责,保证基金份额持有人的合法权益。

四、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规则和公司有关管理规定,秉持稳健经营、规范运作的理念,在组织体系、决策授权、制度流程等方面进一步完善风险控制措施,防范和化解风险,保证托管资产的安全完整;维护基金份额持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、风险治理组织架构

华泰证券风险管理组织架构包括四个主要部分:董事会及合规与风险管理委员会、总裁室及风险控制委员会、首席风险官、各职能部门以及各业务部门。

董事会是风险管理的最高决策机构,并对公司全面风险管理体系的有效性承担最终责任。董事会设合规与风险管理委员会,对风险管理的总体目标、基本政策、风险评估报告进行审议并提出意见;对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见。总裁室是风险管理的最高执行机构,根据董事会的授权和批准,结合公司经营目标,具体负责实施风险管理工作,并下设风险控制委员会。公司设首席风险官,负责全面风险管理工作。在主要业务部门都设立了一线的风险控制组织,各级组织和人员需在授权范围内履行风险管理的职责,分工明晰,强调相互协作。公司指定风险管理部履行风险管理职责,监测、评估、报告公司整体风险水平,并为业务决策提供风险管理建议。合规法律部是华泰证券合规管理的核心职能部门,主要负责对公司经营管理活动和员工执业行为进行合规管理,以及管理公司的法律事务工作。稽核部负责对公司各级部门的风险管理、内部控制及经营管理绩效进行独立、客观地检查、监督、评价,并督促其改进。各部门分工协作,各有侧重,共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价三道防线功能。资产托管部通过设立稽核内控专岗、建立复核机制、内控检查机制、报告机制等方式,实现对各类风险的全面有效管理,保证在合法合规、稳健规范的基础上开展基金托管业务。

3、内部控制制度及措施

华泰证券资产托管业务具备了系统、完善的内部控制制度体系,建立了业务管理制度、内部控制制度、业务操作流程,涵盖了业务管理操作、会计核算、监督和内控、信息系统、内部管理等各方面,覆盖了资产托管业务开展的各个重要环节,能够有效指导业务正常运转、稳健发展。

主要风险控制措施:(1)通过资产分离制度、专用交易单元及结算备付金账户、合理的账户结构、核算对账机制、实物资产盘点制度、内部多层级监督检查机制、系统保障客户资金安全、安防控制等措施有效控制资产安全风险;(2)通过监督管理机制、建立并完善投资监督系统、投资监督管理实施方案、核心业务数据向公司风控部门开放、透明化运作等措施有效控制投资监督风险;(3)通过内部管理控制制度、多维度对账机制、复核监督机制、系统故障应急处理机制和灾难备份机制等措施有效防范资金清算风险;(4)通过明确指令处理相关要素机制、严格资金划付管理流程、划款指令审核机制、监控资金变动机制、人工备份划款方式、及时沟通反馈机制等措施有效防范资金交收风险;(5)通过协议约定估值方法、信息传递程序及差错处理机制、独立会计核算机制、建立对账机制、会计资料管理调阅机制、差错及应急处理机制等措施有效防范资产净值估算错误风险;(6)通过信息披露和保密制度、协议约定信息披露的内容和程序、原始账簿数据分析和采集机制、信息披露授权机制等措施有效防范信息披露风险。

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

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、《托管协议》和相关法律法规的规定对基金投资范围、投资对象、禁止投资行为,基金投资、融资比例,基金管理人参与银行间债券市场,基金管理人投资流通受限证券,选择存款银行进行监督。对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金管理人投解的计提和支付、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。基金托管人发现基金管理人的上述事项及投指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和《托管协议》的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告,由此造成的损失由基金管理人承担。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销中心及本公司的网上直销交易平台。

名称:弘毅远方基金管理有限公司

住所:上海市黄浦区圆明园路149号SO301

办公地址:上海市黄浦区圆明园路149号6楼

法定代表人:郭文

电话:021-53682888

传真:021-53682755

联系人:沈娴

客户服务电话:4009208800(全国免长途话费)

网址:www.honyfunds.com

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理开户、认购、申购、赎回等业务,具体交易业务规则请参阅本公司网站。

2、其他销售机构

华泰证券股份有限公司

住所:江苏省南京市江东中路228号

办公地址:江苏省南京市江东中路228号

法定代表人:周易

联系人:张宇明

客户服务电话:95587

网址:www.htsc.com.cn

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

二、登记机构

名称:弘毅远方基金管理有限公司

住所:上海市黄浦区圆明园路149号SO301

办公地址:上海市黄浦区圆明园路149号6楼

法定代表人:郭文

电话:021-53682888

传真:021-53682755

联系人:黄怿俊

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫峰

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:安冬、陈颖华

联系人:陈颖华

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)

住所: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号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办注册会计师:倪清、张勇

联系人:周祎

第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》等有关法律法规以及基金合同的规定,经中国证监会证监许可【2018】1298号文准予募集注册。

一、基金的类型及存续期间

1、基金类型:混合型发起式证券投资基金

2、基金运作方式:契约型开放式

3、存续期间:不定期

二、基金份额的募集期限、募集方式及销售渠道、募集对象

1、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月。

本基金的发售期为2018年10月8日起至2018年10月26日。

基金管理人根据认购的具体情况可适当延长发售期,但最长不超过法定募集期;同时也可根据认购和市场情况缩短发售时间。

2、募集方式及销售渠道

通过直销机构(即基金管理人直销中心以及基金管理人的网上直销交易平台)和除基金管理人之外的其他销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

3、募集对象

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、合格境外机构投资者和发起资金提供方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。

三、基金份额的认购

除法律法规或中国证监会有关规定另有规定外,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。

1、基金份额的发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

2、认购费用

本基金的认购费率如下:

认购金额(M,含认购费)	认购费率
M<100万元	1.20%
100万元≤M<200万元	0.80%
200万元≤M<500万元	0.20%
M≥500万元	每笔1000元

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等基金募集期间发生的各项费用。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,根据市场情况制定基金促销计划,开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以适当调低基金认购费率。

3、认购份额的计算

基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式:

认购费率适用上表中比例费率的:

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

认购费率适用上表中固定金额的:

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+认购利息)/基金份额发售面值

认购份额计算结果保留到小数点后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:某投资者认购金额为1万元,募集期间基金份额发售面值为人民币1.00元,假定募集期间认购资金所得利息为3.00元,则根据公式计算出:

认购金额=10,000元

净认购金额=10,000/(1+1.20%)=9881.42元

认购费用=10,000-9881.42=118.58元

认购份额=(9881.42+3.00)/1.00=9884.42份

即:投资者投资1万元认购本基金,假定募集期间认购资金所得利息为3.00元,则其可得到9884.42份基金份额。

4、基金份额的认购程序

(1)认购时间安排

投资者认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金销售机构确定,请参见本基金的基金份额发售公告。

(2)投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额发售公告。

(3)基金份额的认购采用金额认购方式

投资者认购本基金采取全额缴款认购的方式。投资者认购时,需按销售机构规定的方式备足认购金额。投资者在募集期内可多次认购,认购费用按每笔认购申请单独计算。投资者的认购申请一经受理不得撤销。

(4)认购的确认

当日(T日)在规定时间内提交的申请,投资者通常应在T+2日到销售机构查询认购申请的受理结果,并可在募集截止日后4个工作日内到销售机构打印交易确认书。

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收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

(5)认购金额的限制

在基金募集期内,投资者可多次认购基金份额。通过基金管理人直销中心首次认购的最低金额为人民币50,000元(含认购费),追加认购的最低金额为单笔10元(含认购费),上述认购最低金额可由基金管理人酌情调整。基金管理人网上直销交易平台和其他销售机构接受认购申请的最低金额为单笔10元(含认购费),如果销售机构业务规则规定的最低单笔认购金额高于10元,以该销售机构的规定为准。

如本基金单个投资人(基金管理人或其高级管理人员、基金经理作为发起资金提供方的除外)累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

除上述限制外,基金管理人对募集期间的单个投资人的累计认购金额暂不设上限,如有调整,具体限制和处理方法请参看相关公告。

5、募集期利息的处理方式

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。认购利息折算的基金份额精确到小数点后2位,小数点2位以后的部分截位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担,其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以登记机构的记录为准。

四、募集资金的管理

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。

五、发起资金的认购

基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员认购金额不低于1000万元,认购的基金份额持有期限不少于三年。

第七部分 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1000万元且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

本基金的《基金合同》生效三年后(指《基金合同》生效之日起三年后的对应日,该对应日如为非工作日,则自动顺延至下一个工作日),若基金资产净值低于两亿元的,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

本基金的《基金合同》生效三年后继续存续的,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。

本基金的《基金合同》生效三年后继续存续的,连续60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。

法律法规另有规定时,从其规定。

第八部分 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本招募说明书第五部分"相关服务机构"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。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、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或相关销售机构另行公告。

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,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

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。

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,在对该投资人在该销售机构认购/申购的基金份额进行处理时,认购/申购确认日期在先的基金份额先赎回,认购/申购确认日期在后的基金份额后赎回,以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费。

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。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、赎回申请不成立。

投资人办理申购、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。

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,投资人按时全额交付申购款项,申购成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。若申购资金在规定的时间内未全额到账则申购不成立,申购款项将退回投资人账户,基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

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。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。

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他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,则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。

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(包括该日)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,则申购款项本金退还给投资人。

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,投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

登记机构可以在法律法规和基金合同允许的范围内根据相关业务规则对上述业务办理时间进行调整。基金管理人将在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、通过基金管理人直销中心首次申购的最低金额为人民币50,000元(含申购费),追加申购的最低金额为单笔10元(含申购费),上述申购最低金额可由基金管理人酌情调整。基金管理人网上直销交易平台和其他销售机构接受申购申请的最低金额为单笔10元(含申购费),如果销售机构业务规则规定的最低金额为单笔10元(含申购费),则以销售机构的规定为准。

单一投资者(基金管理人或其高级管理人员、基金经理作为发起资金提供方的除外)持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%(在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外)。法律法规、中国证监会另有规定的除外。除上述限制外,基金管理人对单个投资人累计持有的基金份额、单日申购金额等暂不设上限,如有调整,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2、投资者选择将现金红利自动转为基金份额进行再投资时,不受最低申购金额的限制,且不收取相应的申购费用。

3、投资者可将其全部或部分基金份额赎回,赎回最低份额1份,如果销售机构业务规则规定的最低单笔赎回份额高于1份,以该销售机构的规定为准。

4、每个工作日投资者在单个交易账户保留的本基金份额余额少于1份时,若当日该账户同时有基金份额减少类业务(如赎回、转换出等)被确认,则基金管理人有权将投资者在该账户保留的本基金份额一次性全部赎回。

5、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规定单个投资者申购金额上限、基金规模上限或基金单日净申购比例上限,以及拒绝大额申购、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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

6、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、赎回份额和最低基金份额保留余额的数量限制。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、申购费用和赎回费用

1、申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。投资者可多次申购,申购费用按每笔申购申请单独计算。

2、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。未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、申购费率

本基金的申购费率如下:

申购金额(M,含申购费)	申购费率
M(100万元	1.50%
100万元≤M(200万元	1.00%
200万元≤M(500万元	0.30%
M≥500万元	每笔1000元

4、赎回费率

本基金赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下:

持有期限(N)	赎回费率	归入基金资产比例
N(7天	2.00%	100%
7天≤N(30天	1.00%	100%
30天≤N(3个月	0.50%	75%
3个月≤N(6个月	0.50%	50%
6个月≤N(1年	0.50%	25%
1年≤N(2年	0.25%	25%
N≥2年	0	——

注:上述"月"指的是30个自然日,"年"指的是365个自然日

5、基金管理人可以在法律法规、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。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率。

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,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。

七、申购份额与赎回金额的计算

1、本基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。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2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。计算公式:

申购费率适用上表中的比例费率时:

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/申购当日基金份额净值

申购费率适用上表中的固定金额时:

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/申购当日基金份额净值

例:某投资者投资5万元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.0520元,则可得到的申购份额为:

申购金额=50,000元

净申购金额=50000/(1+1.50%)=49261.08元

申购费用=50000-49261.08=738.92元

申购份额=49261.08/1.0520=46826.12份

即:投资者投资5万元申购本基金,对应的申购费率为1.50%,假设申购当日基金份额净值为1.0520元,则其可得到46826.12份基金份额。

2、本基金赎回金额的计算

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2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。计算公式:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例:某投资者赎回本基金1万份基金份额,持有时间为90天,对应的赎回费率为0.50%,假设赎回当日基金份额净值是1.0520元,则其可得到的净赎回金额为:

赎回总金额=10000×1.0520=10520.00元

赎回费用=10520.00×0.50%=52.60元

净赎回金额=10520.00-52.60=10467.40元

即:投资者赎回本基金1万份基金份额,持有时间为90天,对应的赎回费率为0.50%,假设赎回当日基金份额净值是1.0520元,则其可得到的净赎回金额为10467.40元。

3、本基金份额净值的计算

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。

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或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。

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申购申请;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,基金管理人应当暂停接受投资人的申购申请。

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、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、出现继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,可暂停接受投资人的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述1、2、3、5、6情形之一日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。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%,则这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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3)如果发生巨额赎回,且单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过10%时,本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过10%比例的赎回申请实施延期办理赎回申请。对该单个基金份额持有人不超过10%比例的赎回申请,与当日其他赎回申请一起,按上述(1)、(2)方式处理。如下一开放日该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍归超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于10%,但如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回,则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(4)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、暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定,不迟于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近一个开放日的基金份额净值。

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,基金管理人在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,在履行适当程序后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、符合法律法规规定的其它非交易过户。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。基金账户或基金份额被冻结的,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与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。

十八、其他业务

如相关法律法规允许基金管理人办理其他基金业务,基金管理人在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,在履行适当程序后将制定和实施相应的业务规则。

十九、基金管理人可在不违反相关法律法规、不对基金份额持有人利益产生不利影响的前提下,根据具体情况经与基金托管人协商一致后对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

本基金围绕中国国企转型升级过程中所蕴含的投资机会,在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期增值。

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的股票(含中小板、创业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、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股票期权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。

基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的60%-95%,其中投资于国企转型升级主题相关证券比例不低于非现金资产的80%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股票期权合约需缴纳的交易保证金以后,基金保留的现金或投资于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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,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。

(二)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的60%-95%,其中投资于国企转型升级主题相关证券比例不低于非现金资产的80%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当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的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;

(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%;本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(16)因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;

(17)开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

(18)未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(19)本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的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投资比例不符合上述投资比例限制的,基