（上接A29版）

电话:0755－83198888
传真:0755－83195049
客服电话:95555
公司网站:www.cmbchina.com
3、名称:国都证券有限责任公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311
客服热线:400-818-8118
网址:www.guodu.com
4、名称:中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:侯艳红
电话:010-60838888
客服热线:95558
网址:www.citics.com
5、名称:中信证券（山东）有限责任公司
住所:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
电话:0532-85022313
客服热线:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn
6、名称:中信证券（浙江）有限责任公司
住所:中国浙江省杭州市江南大道 588号 恒鑫大厦19、20楼
办公地址:中国浙江省杭州市江南大道 588号 恒鑫大厦19、20楼
法定代表人:沈强
联系人:李珊
电话:0571-85783737
客服热线:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构,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。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

二、登记机构
名称:中欧基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
办公地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
法定代表人:窦玉明
总经理:刘建平
成立日期:2006年7月19日
电话:021-68609600
传真:021-68609601
联系人:管志斌
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:俞卫锋
经办律师:黎明、孙睿
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
四、审计基金财产的会计师事务所
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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏
经办会计师:单峰 俞伟敏

第六部分 基金的募集

一、基金募集的依据
本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定,经2015年1月4日中国证监会证监许可[2015]5号文准予募集。
二、基金类别与运作方式
本基金的类别为混合型证券投资基金。
本基金的运作方式为契约型开放式。
三、基金存续期间
不定期。
四、募集方式
通过各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。
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,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。
五、募集期限
自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。
六、募集规模
本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于2亿元。
七、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人。
八、基金份额初始面值、认购费用及认购份额的计算
1、本基金份额初始面值为人民币1.00元,按面值发售。
2、认购费用
募集期投资者可以多次认购本基金,认购费率按每笔认购申请单独计算。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。
养老金客户包括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等,具体包括:
1、全国社会保障基金;
2、可以投资基金的地方社会保障基金;
3、企业年金单一计划以及集合计划;
4、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;
5、企业年金养老金产品。
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。
通过基金管理人的直销中心认购本基金的养老金客户认购费率见下表:

	认购金额(M)	费率
认购费率	M<100万元	0.36%
	100万元≤M<500万元	0.24%
	M≥500万元	每笔1000元

其他投资者认购本基金的认购费率见下表:

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

3、认购份额的计算
当认购费用适用比例费率时,认购份额的计算公式为:
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）/1.00元
当认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下:
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）/1.00元
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:某投资人（非养老金客户）在认购期内投资1,000,000元认购本基金份额,认购费率为0.80%,假设这1,000,000元在认购期间产生的利息为295.00元,则其可得到的基金份额数计算如下:
净认购金额＝1,000,000/(1+0.8%)=992,063.49元
认购费用＝1,000,000-992,063.49＝7,936.51元
认购份额＝（992,063.49+295.00）/1.00=992,358.49份
即:投资人（非养老金客户）投资1,000,000元认购本基金份额,在认购期结束时,假设这1,000,000元在认购期间产生的利息为295.00元,投资人账户登记有本基金份额992,358.49份。
九、投资人对本基金的认购
1、认购时间安排
投资人认购本基金的具体业务办理时间见基金份额发售公告。
2、投资人认购本基金应提交的文件和办理的手续
投资人认购本基金应提交的文件和办理的手续见基金份额发售公告。
3、认购的方式及确认
投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。
投资人在募集期内可多次认购基金份额,认购申请一经受理,不得撤销。
投资人在T日规定时间内提交的认购申请,应于T+2日（包括该日）后及时在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心查询认购申请是否被成功受理。
投资人应于基金合同生效后及时在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心查询认购确认份额。
4、认购的限额
本基金其他销售机构的销售网点每个基金账户单笔最低认购金额为1,000元；直销机构每个基金账户的首次最低认购金额为10,000元,追加认购单笔最低认购金额为10,000元,不设级差限制（通过基金管理人网上交易系统认购本基金暂不受此限制,具体规定请至基金管理人网站查询）。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。
基金管理人可根据市场情况,调整认购金额的数量限制,基金管理人必须最迟在调整实施前两日在指定媒介上刊登公告并报中国证监会备案。
十、募集资金利息的处理
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。
十一、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。

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,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。
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
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。
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。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。
五、申购和赎回的数量限制
1、其他销售机构的销售网点每个账户单笔申购的最低金额为1,000元。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。
直销机构每个账户首次申购的最低金额为10,000元，追加申购的最低金额为单笔10,000元;已在直销机构有该基金认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。其他销售机构的销售网点的投资者欲转入直销机构进行交易要受直销机构最低申购金额的限制。投资者当期分配的基金收益转为基金份额时,不受最低申购金额的限制。通过基金管理人网上交易系统办理基金申购业务的不受直销机构单笔申购最低金额的限制，具体规定请至基金管理人网站查询。基金管理人可根据市场情况,调整本基金首次申购的最低金额和追加申购的最低金额。
投资者可多次申购,对单个投资者的累计持有份额不设上限限制。
2、基金份额持有人在销售机构赎回时,每次对本基金的赎回申请不得低于5份基金份额。若某笔份额减少类业务导致单个基金交易账户的基金份额余额不足5份的，销售机构有权对该基金份额持有人持有的基金份额做全部赎回处理（份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户、转托管等业务,具体种类以相关业务规则为准）。
3、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、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。
2、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。
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。
（1） 申购费用
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。
养老金客户包括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等,具体包括:
（1）全国社会保障基金;
（2）可以投资基金的地方社会保障基金;
（3）企业年金单一计划以及集合计划;
（4）企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;
（5）企业年金养老金产品。
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。
通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户申购费率见下表:

	申购金额(M)	费率
申购费率	M<100万元	0.45%
	100万元≤M<500万元	0.30%
	M≥500万元	每笔1000元

其他投资者申购本基金的申购费率见下表:

	申购金额(M)	费率
申购费率	M<100万元	1.50%
	100万元≤M<500万元	1.00%
	M≥500万元	每笔1000元

（2）申购份额的计算
当申购费用适用比例费率时,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/申购当日基金份额净值
当申购费用为固定金额时,申购份数的计算方法如下:
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:某投资人（非养老金客户）投资1,000,000元申购本基金份额,其对应的申购费率为1.00%,假设申购当日本基金份额净值为1.000元,则可得到的申购份额为:
净申购金额＝1,000,000/（1＋1.0%）＝990,099.01元
申购费用＝1,000,000－990,099.01＝9,900.99元
申购份额＝990,099.01/1.000＝990,099.01份
即:投资人（非养老金客户）投资1,000,000元申购本基金份额,假设申购当日本基金份额净值为1.000元,则其可得到本基金份额990,099.01份基金份额。
3、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。
（1）赎回费用

	持有期限(N)	费率
赎回费率	N<7日	1.50%
	7日≤N<30日	0.75%
	30日≤N<365日	0.50%
	1年≤N<730日	0.25%
	2年≤N	0

（注:赎回份额持有时间的计算,以该份额在登记机构的登记日开始计算,1年=365日。）
（2）赎回金额的计算
赎回金额＝赎回份额×赎回当日基金份额净值
赎回费＝赎回份额×赎回当日基金份额净值×赎回费率
净赎回金额＝赎回金额－赎回费
例:
某投资人赎回本基金10,000份基金份额,持有期限为5个月,对应的赎回费率为0.50%,假设赎回当日本基金份额净值是1.050元,则其可得到的净赎回金额为:
赎回总金额＝10,000×1.050＝10,500.00元
赎回费用＝10,500.00×0.50%＝52.50元
净赎回金额＝10,500.00－52.50＝10,447.50元
即:某投资人赎回持有的10,000份本基金份额,持有期限为5个月,假设赎回当日本基金份额净值是1.050元,则其可得到的净赎回金额为10,447.50元。
4、申购费用由投资人承担,不列入基金财产。
5、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。对持续持有期少于30日的投资人,赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于3个月的投资人,将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人,将不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期长于6个月的投资人,应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产,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。（注:1个月以30日计算）
6、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。
7、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,针对投资人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,并进行公告。
七、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、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。
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、基金管理人接受某笔或某些申购申请会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,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
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、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、5、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。
八、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/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、发生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,基金管理人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。
发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回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。
九、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、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、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个工作日的基金份额净值。
十一、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。
十二、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。

第九部分 基金的投资

一、投资目标
在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。
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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。
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:
本基金股票投资占基金资产的比例为60%－95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%－3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。三、投资策略
1、大类资产配置策略
本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置,强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产的大类资产配置比例。
2、股票投资策略
本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念,在以整个宏观策略为前提下,把握结构性调整机会,将行业分析与个股精选相结合,寻找出表现优异的子行业和优质个股。
（1）行业分析
在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后,精选出行业地位高、行业的发展空间大的子行业。
（2）个股选择
本基金在选择个股时关注如下几个方面:
1）基本面
主营业务竞争力强,包括技术、品牌、政策或者规模等方面
盈利能力强,不仅有短期的业绩与盈利支撑,盈利的稳定性、持续性好,具有长期的投资空间
良好的治理结构
管理层能力强
商业模式优越
2）估值水平
本基金除了关注个股的基本面之外,还要考查个股业绩的增长性和估值的匹配程度,如果估值比较合理或者低估就会选择买入并坚持持有，相反如果估值已透支了未来几年的增长,即业绩增长的速度与股价和市盈率不相匹配,那么就会相应减持这种股票。
3、债券投资策略
本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。
（1）久期偏离
本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析,预测利率的变化趋势,从而采取久期偏离策略,根据对利率水平的预期调整组合久期。
（2）期限结构配置
本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。
（3）类属配置
类属配置指债券组合中各债券种类间的配置,包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布,债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。
（4）个券选择
个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素,确定一定期限下的债券品种的过程。
4、股指期货投资策略
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。
5、资产支持证券投资策略
资产支持证券是指由金融机构作为发起机构,将信贷资产信托给受托机构,由受托机构向投资机构发行,以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。
6、权证投资策略
本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上,本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判,估算权证合理价值,同时还充分考虑个券的流动性,谨慎进行投资。
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）本基金股票投资占基金资产的比例为60%－95%;
（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的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%;
（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中的债券回购最长期限为1 年,债券回购到期后不得展期;
（15）本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;
（16）本基金参与股指期货交易,需遵守下列投资比例限制:
1）本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%;
2）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%;
3）本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%;
4）本基金在任何交易日日终,持有的买入股指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;
5）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
（17）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限制。
因证券/期货市场波动、上市公司合并、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规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消或调整上述限制,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按照调整后的规定执行。
2、禁止行为
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承销证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合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的同意,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、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。
五、投资决策
1、投资决策依据
投资决策依据包括:国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定;宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势;证券市场走势。
2、投资决策原则
合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。
3、投资决策机制
本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资事业部负责人、基金经理、研究部和中央交易室,投资过程须接受监察稽核部的监督和基金运营部的技术支持。
其中,投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构,对基金投资的重大问题进行决策,并在必要时做出修改。
投资事业部负责人负责本事业部内投资管理和内外部沟通工作,并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。
基金经理根据投资决策委员会的原则和决议精神,结合股票池及有关研究报告,负责投资组合的构建和日常管理,向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。
4、投资决策程序
本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限,建立完善的投资决策体系和投资运作流程:
（1）投资决策委员会会议:由投资决策委员会主席主持,对基金总体投资政策、业绩表现和风险状况、基金投资授权方案等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。
（2）在借助外部研究成果的基础上,研究部同时进行独立的内部研究。
（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议,在研究部的研究支持下,拟定投资计划,并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中,基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。
（4）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令,并担负一线风险监控职责。
5、风险分析与绩效评估
研究部负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面,对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略,进而调整投资组合。
6、组合监控与调整
基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化,结合基金当期的申购和赎回现金流量情况,以及组合风险与绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整。
六、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×80%+中债综合指数收益率×20%。
沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走