(上接A25版)

管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

经过十四年发展,招商银行资产托管规模快速壮大。2016年招商银行加大高收益托管产品营销力度,截止11月末新增托管公募开放式基金80只,新增首发公募开放式基金托管规模566.49亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势,托管费收入、托管资产均创出历史新高,实现托管费收入40.54亿元,同比增长29.28%,托管资产余额9.62万亿元,同比增长52.89%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人,成功签约“壹基金”公益资金托管,为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索,该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖;四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获奖项国内托管银行,该行“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

(二)主要人员情况

李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生,本行副行长。大学本科毕业,副研究员。1996年12月加入本行,历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理,杭州分行行长助理、副行长,南昌支行行长,南昌分行行长,总行人力资源部总经理,总行行长助理,2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(三)基金托管业务经营情况

截至2016年11月30日,招商银行股份有限公司累计托管231只开放式基金及其它托管资产,托管资产为9.62万亿元人民币。

(四)托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务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理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整;建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级风险防范是总行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下,独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门,对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督,及时发现内部控制缺陷,提出整改方案,跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时,必须遵循内控制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

(1)全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位,并由全部人员参与。

(2)审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险,托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点,应当体现“内控优先”的要求。

(3)独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门,稽核监察室应保持高度的独立性和权威性,负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4)有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权利,内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5)适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要,并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6)防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室,应当在制度上和人员上适当分离,办公网和业务网分离,部门业务网和全行业务网分离,以达到风险防范的目的。

(7)重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8)制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。

(9)成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益,以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

(1)完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度,从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作,切实维护托管业务各当事人的利益,避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理,招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》,并建立了灾难备份中心,各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份,确保灾难发生时,托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2)经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程,有效地控制业务运作过程中的风险。

(3)业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备,同时,每日实时对托管业务数据库进行备份,托管业务数据每日进行备份,所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料,视同会计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并做好调用登记。

(5)信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护等,保证信息技术系统的安全。

(6)人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源控制。

(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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象、基金融投资比例、投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、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的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容约定和其他有关法律法规的规定,应及时以书面通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内,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的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人限期改正,如基金管理人未能在通知期限内纠正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1、直销机构
(1)直销中心
名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路318号31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼37层
法定代表人:陈光明
联系电话:(021)33315895
传真:(021)63326381
联系人:廉迪
客服电话:4009200808
公司网址:www.dfham.com
(2)网上交易系统

网上交易系统包括管理人公司网站(www.dfham.com)和管理人指定电子交易平台。个人投资者可登陆本公司网站(www.dfham.com)和管理人指定电子交易平台,在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后,通过本公司网上交易系统办理开户、认购、申购、赎回等业务。

2、代销机构
(1)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195050
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com
(2)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25层-29层、32层、36层、39层、40层
法定代表人:潘鑫军
联系电话:(021)63325888
联系人:胡月茹
客服电话:(021)95503
公司网站:www.dfzq.com.cn
(3)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:金煜
联系电话:021-68475888
传真:021-68476111
联系人:汤征程
客服电话:95594
公司网站:www.bankofshanghai.com
(4)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
公司地址:上海市徐汇区龙田路195号天华信息科技园南区3C座7楼(天天基金)
法定代表人:其实
联系电话:021-54509988
传真:021-64385308
联系人:胡阅
客服电话:4001818188
网址:http://www.1234567.com.cn/
(5)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系电话:(021)61618888
传真:(021)63604199
联系人:吴斌
客服电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

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

(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:任瑞新
(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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:陈颖华
经办律师:黎明、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)
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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:薛竞、李一
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:李一

六、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》、《基金合同》及其他有关规定募集,募集申请经中国证监会2016年12月16日证监许可【2016】3116号文准予注册。

(一)基金类型

混合型证券投资基金。

(二)基金运作方式

契约型、开放式、发起式

本基金以定期开放方式运作,即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作。

本基金定期开放运作方式的具体约定详见本招募说明书第八部分。

(三)基金存续期限

不定期。

(四)募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,募集时间见基金份额发售公告。

基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期,此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若延长,最长不得超过前述募集期。

(五)基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起不超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

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。

基金发售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册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。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资人、机构投资人及合格境外机构投资者、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。

4、发起资金认购

本基金发起资金认购的金额不少于1000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

(六)募集规模

本基金募集份额总额不少于1,000万份,基金募集金额不少于1,000万元,其中使用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、基金经理等人员资金认购基金的金额不少于1,000万元人民币。

发起资金提供方承诺持有认购资金认购的基金份额的期限自基金合同生效日起不少于3年。认购份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内离职的,其持有期限的承诺不受影响。

(七)基金份额的初始面值和认购价格

本基金基金份额初始面值为1.00元,本基金认购价格为1.00元/份。

(八)认购安排

1、认购时间:2017年4月10日至2017年4月28日。具体业务办理时间详见基金份额发售公告及销售机构相关公告。

2、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日后(包括该日)及时到网点查询交易情况,在募集截止日后4个工作日内可以到网点打印交易确认书。

投资人开户和认购所需提交的文件和办理的具体程序,请参阅基金份额发售公告。

3、认购数量限制

(1)本基金认购采用金额认购方式。

(2)投资人认购基金份额采用全额缴款的认购方式。投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

(3)投资人在募集期内可以多次认购基金份额,须按每次认购所对应的费率档次分别计费,已经正式受理的认购申请不得撤销。

(5)在募集期内,除份额发售公告另有规定外,各销售网点接受认购申请的最低金额为单笔1,000元(含认购费)。直销网点接受首次认购申请的最低金额为单笔50万元人民币,追加认购的最低金额为单笔1,000元人民币。通过本公司网上交易系统办理基金认购业务的不受直销网点单笔申购最低金额的限制,认购最低金额为单笔1,000元。

(5)基金募集期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

4、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,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

5、基金份额的认购费用及认购份额的计算公式

(1)认购费率

本基金对通过基金管理人直销中心认购本基金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以及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。

通过基金管理人直销中心认购本基金的养老金客户的认购费率如下:

认购金额(M)	费率
M<1,000万元	0.20%
M≥1,000万元	每笔1,000元

其他投资者认购本基金的认购费率如下:

认购金额(M)	费率
M<1,000万	1.20%
M≥1,000万元	每笔1,000元

投资人重复认购,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

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、注册登记等募集期间发生的各项费用。

(2)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。

认购费用适用比例费率时,认购份额的计算方法如下:

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

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)/基金份额初始面值

认购份额的计算保留到小数点后两位,小数点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。

例一:某投资人(非养老金客户)投资10,000元认购本基金,认购费率为1.20%,假定募集期产生的利息为5.50元,则可认购基金份额为:

认购总金额=10,000元

认购净金额=10,000/(1+1.20%)=9,881.42元

认购费用=10,000-9,881.42=118.58元

认购份额=(9,881.42+5.50)/1.00=9,886.92份

即:该投资人投资10,000元认购本基金,假定募集期产生的利息为5.50元,可得到9,886.92份基金份额。

(九)募集期间的资金存放和费用

本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。基金募集期间的信息披露费用、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

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基金的金额不少于1000万元人民币,且承诺持有期限自基金合同生效日起不少于三年的,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,验资机构需在验资报告中对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。基金管理人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。

《基金合同》生效时,认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资人所有。

(二)基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效,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日内返还投资人已缴纳的款项,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

基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,基金合同应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

基金合同生效三年后继续存续的,基金存续期内,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。

法律法规另有规定时,从其规定。

八、基金份额的申购、赎回与转换

(一)基金的运作方式

本基金以定期开放方式运作,即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作。

本基金以36个月为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个到期开放期结束之日次日起(包括该日)至36个月后的月度对日的前一日止。

在每个运作周期结束后第一个工作日起进入到期开放期。本基金的每个到期开放期为5至20个工作日。到期开放期的具体期间由基金管理人在上一个运作周期结束前公告说明。在到期开放期间本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

为满足投资者在每个运作周期中的流动性需求,本基金的每个运作周期以封闭期和期间开放期相交替的方式运作,共包含为3个封闭期和2个期间开放期。

在每个运作周期中,第一个期间开放期的首日为该运作周期首日的12个月后的月度对日,第二个期间开放期的首日为该运作周期首日的24个月后的月度对日。本基金的每个期间开放期为5至10个工作日,具体期间由基金管理人在每个期间开放期前公告说明。在期间开放期间本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

在每个运作周期内,除期间开放期以外,均为封闭期。在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回,也不上市交易。

如封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日因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,开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。如开放期内因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,或依据基金合同的约定发生基金暂停申购与赎回业务的,开放期将按暂停申购与赎回的期间相应顺延。前述开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

运作方式示例:假设本基金基金合同于2017年5月8日生效,则本基金的第一个运作周期为2017年5月8日至2020年5月7日,其中期间开放期的首日分别为2018年5月8日、2019年5月8日。以上每个期间开放期为5至10个工作日,具体期间由基金管理人在每个期间开放期前公告说明。在以上期间开放期间,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

本基金的首个运作周期结束后即进入首个到期开放期,为2020年5月8日起5至20个工作日。若基金首次到期开放期确定为10个工作日,则自2020年5月8日至2020年5月21日的十个工作日为本基金的到期开放期,在此期间投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。自2020年5月22日起进入本基金下一个运作周期,以此类推。

以上示例均未考虑节假日的影响。

(二)申购与赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。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基金代销机构,并予以公告。

(下转A27版)

(上接A25版)

(2)直销机构与代销机构网点的业务申请表不同,个人投资者请勿混用。

四、机构投资者的开户与认购程序

(一)注意事项

1、机构投资者在认购本基金前应在注册登记机构开设基金账户。

2、机构投资者认购本基金可以在代销机构指定的基金代销网点认购,单个基金交易账户单笔最低认购金额为1,000元(含认购费)。如果认购金额在50万元(含50万元)以上,还可到本公司直销中心办理,但已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受上述认购最低金额50万元的限制。如发生末日比例配售部分确认,认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。

3、投资者不能以现金方式认购

在直销中心开户的机构投资者必须指定一个银行账户作为投资基金的唯一结算账户,今后投资者赎回、分红及无效认(申)购的资金退款等资金结算均只能通过此账户进行。在代销网点认购的机构投资者应指定相应的代销银行结算账户或在券商处开立的资金账户作为投资基金的唯一结算账户。

(二)发售机构的开户与认购程序

1、通过直销中心办理机构投资者开户和认购的程序

如果机构客户认购金额在50万元(含50万元)以上,可以选择到本公司直销中心办理。

(1)业务办理时间:本基金份额发售日的9:30-15:00(周六、周日、法定节假日不营业)。

(2)机构客户办理开户申请时,应由指定经办人提供下列资料:

1)加盖单位公章的企业法人营业执照复印件及副本原件,事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件、加盖单位公章的组织机构代码证、税务登记证复印件;

2)加盖单位公章的《业务授权委托书》;

3)加盖单位公章的法定代表人有效身份证件复印件;

4)业务经办人有效身份证件原件及复印件(加盖单位公章);

5)《机构客户印鉴卡》;

6)指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件(或指定银行出具的开户证明),加盖单位公章;

7)填妥的《基金投资人风险承受能力调查问卷(机构版)》、《开放式基金账户类业务申请书(机构)》、《上海东方证券资产管理有限公司证券投资基金传真交易协议书》和《权益须知》,并加盖单位公章;

8)管理人要求的其他材料。

注:a、“指定银行账户”是指:在本直销网点认购基金的客户需指定一银行账户作为客户赎回、分红等资金结算汇入账户。此账户可为客户在任一商业银行的存款账户,账户名称必须与客户名称严格一致。

b、已使用新版“三证合一”营业执照开户的机构主体,需提供新版营业执照复印件,组织机构代码证及税务登记证无需提供。

(3)认购资金的划拨程序:

1)机构客户开户后,在办理认购手续前,应将足额资金通过银行系统汇入东证资管指定的银行账户:

户名:上海东方证券资产管理有限公司
开户行:中国农业银行股份有限公司上海卢湾支行
账号:03492300040015591
大额支付号:103290028025

2)汇款时,客户务必在“汇款人”栏中完整填写其在东证资管直销系统开户登记的客户全称,汇款的账户必须与开户时预留的银行账户一致。

(4)机构客户办理认购申请时,应提供以下资料:

1)业务经办人有效身份证件;

2)填妥的《基金产品风险等级确认单》和《开放式基金交易类业务申请书》,并加盖预留印鉴章;

3)管理人要求的其他材料。

2、其他销售机构的开户与认购程序以各销售机构的规定为准

3、投资者提示

(1)请机构投资者尽早向直销中心柜台或代销机构索取开户和认购申请表。投资者也可从本公司网站www.dfham.com下载直销业务申请表格,但必须在办理业务时保证提交的材料与下载文件中所要求的格式一致。

(2)直销机构与代销机构网点的业务申请表不同,机构投资者请勿混用。

五、清算与交割

1、基金募集期间募集的资金全部被冻结在本基金募集专户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。投资者有效认购款项在基金募集期间形成的利息归投资者所有,如基金合同生效,则折算为基金份额计入投资者的账户,具体份额以注册登记机构的记录为准。

2、本基金权益登记由注册登记机构在募集期结束后完成。

六、基金的验资与基金合同的生效

1、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基金的金额不少于1000万元人民币,且承诺持有期限自基金合同生效日起不少于三年的,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,验资机构需在验资报告中对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。基金管理人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。

2、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。

《基金合同》生效时,认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资人所有。

3、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效,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日内返还投资人已缴纳的款项,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。

七、本次募集当事人及中介机构

(一)基金管理人
名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市中山南路318号31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼31、37、39、40层
法定代表人:陈光明
联系电话:(021)63325888
传真:(021)63326981
联系人:廉迪
公司网址:www.dfham.com
(二)基金托管人
名称:招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
成立时间:1987年4月8日
法定代表人:李建红
联系电话:0755—83199084
联系人:邓炯鹏
(三)销售机构
1、直销机构
名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路318号31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼37层
法定代表人:陈光明
联系电话:(021)33315895
传真:(021)63326381
联系人:廉迪
公司网址:www.dfham.com
2、代销机构
(1)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25层-29层、32层、36层、39层、40层
法定代表人:潘鑫军
联系电话:(021)63325888
联系人:胡月茹
客服电话:(021)95503
公司网站:www.dfzq.com.cn
(2)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
联系电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195050
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
公司网站:www.cmbchina.com
(3)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:金煜
联系电话:021-68475888
传真:021-68476111
联系人:汤征程
客服电话:95594
公司网站:www.bankofshanghai.com
(4)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
公司地址:上海市徐汇区龙田路195号天华信息科技园南区3C座7楼(天天基金)
法定代表人:其实
联系电话:021-54509988
传真:021-64385308
联系人:胡阅
客服电话:4001818188
网址:http://www.1234567.com.cn/
(5)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系电话:(021)61618888
传真:(021)63604199
联系人:吴斌
客服电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

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

(四)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:任瑞新
(五)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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:陈颖华
经办律师:黎明、陈颖华
(六)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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:薛竞、李一
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:李一

上海东方证券资产管理有限公司
二〇一七年三月三十日

(上接A25版)

召开时间的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人参加,方可召开。

(2)通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的书面方式在表决截至日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

1)会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后,在表决截止日前公布2次相关提示性公告;

2)召集人按基金合同规定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

3)本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%(含50%);

基金份额持有人持有的基金份额低于50%的,召集人可以在原公告的表决截止日的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人出具意见,方视为有效。

4)上述第3)项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人,同时提交或经验证的持有基金份额的凭证、受托出具意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金注册登记机构记录相符,并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定。

(3)在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人可采用网络、电话、短信等其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会;在会议召开方式上,本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

5、议事内容与程序

(1)议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2)议事程序

1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2)通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1)一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2)特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》(基金合同另有约定除外)、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人,符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

(1)现场开会

1)如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

(三)基金收益分配原则、执行方式

1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

(1)本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(2)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的25%;

(3)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(4)基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

5、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。

6、基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额。

(四)与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金的证券、期货交易费用;

(7)基金的银行汇划费用;

(8)证券、期货账户开户费和账户维护费;

(9)投资港股通标的股票的相关费用;

(10)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times 1.5\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times 0.2\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述基金费用的种类中第3-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费。

调整基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;基金管理人调整管理费、托管费,需于调整实施前书面告知基金托管人。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

(五)基金资产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金在追求基金资产长期安全的基础上,为基金份额持有人获取稳定的投资收益,追求超越业绩比较基准的投资回报。

2、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)、港股通标的股票、债券(国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经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。

本基金的投资比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的50%,但在每个期间开放期的前10个工作日和后10个工作日、到期开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间,基金投资不受前述比例限制;本基金投资于股票的比例不高于基金资产的50%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-50%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-50%)。在开放期,每个交易日日终在扣除国债期货和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%,在封闭期,本基金不受前述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

3、投资策略

本基金以36个月为一个运作周期,以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择,运用封闭期无流动性需求的优势,同时,充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排,在股票的配置上,以时间换空间,采用低风险投资策略,为本基金获得更高的低风险收益;在债券配置上,合理配置久期匹配债券的结构,做好流动性管理,以期获得更高的投资收益。

(1)资产配置

本基金以36个月为一个运作周期,以为投资者在每个运作周期追求超越业绩比较基准的投资回报为目标,进行长期目标指引下的大类资产的配置,通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票、债券和现金类大类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。并通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。

(2)股票组合的构建

本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略,秉持长期投资的理念,利用基金管理人投研团队的资源,对企业内在价值进行深入细致的分析,并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好,符合转型期中国经济发展趋势的上市公司股票进行投资。

1)行业配置策略

在行业配置层面,本基金会倾向于一些符合转型期中国经济发展趋势的行业或子行业,比如由人口老龄化驱动的医疗行业、具有品牌优势的消费品行业、可以替代人工的自动化行业等。具体分析时,我们会跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC变动情况,依此来判断各行业的景气度,再根据行业整体的估值情况,市场的预期,目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。

2)股票投资选择

针对个股,每个报告期基金管理人都会根据公开信息和一些假设推理初筛一批重点研究标的,围绕这些公司,基金管理人的股票研究团队将展开深入的调研,除了上市公司外,基金管理人还会调研竞争对手,产业链的上下游,以此来验证基金管理人的推理是否正确。对于个股是否纳入到组合,基金管理人会重点关注3个方面:公司素质、公司的成长空间及未来公司盈利增速、目前的估值。其中公司素质是基金管理人最看重的因素,包括公司商业模式的独特性、进入壁垒、行业地位、公司管理层的品格和能力等方面;对于具有优秀基因的公司,如果成长性和估值匹配的话,基金管理人将其纳入投资组合;否则将会放在股票库中,保持持续跟踪。

3)港股投资策略

本基金将仅通过港股通投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注:

①A股稀缺性行业个股,包括消费龙头白马(如白酒、中药)、A股缺乏投资标的的行业(如博彩);

②具有持续领先优势或核心竞争力的企业,这类企业应具有良好成长性或为市场龙头;

③符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股;

④与A股同类公司相比具有估值优势的公司。

(3)债券等其他固定收益类投资策略

本基金将充分利用封闭期无流动性需求的优势,采用“自上而下”的投资策略,对债券类资产进行配置。本基金将基于对国内外宏观经济形势、国内财政政策与货币市场政策、以及结构调整等因素对债券市场的影响,对利率走势进行预测,判断债券市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略,力争有效控制整体资产风险。

在债券投资组合构建和管理过程中,基金管理人将采用久期控制、期限结构配置、市场比较、相对价值判断、信用风险评估等管理手段。

①久期控制:根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险。

②期限结构配置:在确定组合久期后,基金管理人将针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等,在长期、中期与短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

③市场比较:不同债券子市场的运行规律不同,本基金在充分研究不同债券子市场风险-收益特征、流动性特性的基础上构建调整组合(包括跨市场套利操作),以提高投资收益。

④相对价值判断:本基金将在相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种进行投资。

⑤信用风险评估:本基金将根据发债主体的经营状况与现金流等情况对其信用风险进行评定与估测,以此作为品种选择的基本依据。

(4)可转债投资策略

本基金的可转债投资策略包括传统可转换债券,即可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的投资策略。本基金参与可转换债券有两种途径,一种是一级市场申购,另一种是二级市场参与。一级市场申购,主要考虑发行条款较好、申购收益较高、公司基本面优秀的可转债;二级市场参与可运用多种可转债投资策略,本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略,精选个券,力争实现较高的投资收益。同时,本基金也可以采用相对价值分析策略,即通过分析不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值,把握可转换债券的价值走向,选择相应券种,从而获取较高投资收益。另外,本基金将密切关注可转债的套利机会和条款博弈机会。

(5)中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时,将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时,将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债,以降低信用风险。

(6)资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率几方面来考虑,采用自下而上的项目精选策略,以资产支持证券的优先级或次优级为投资标的,精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。根据不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略,在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法,以基金管理人的内部信用风险评估为主,并结合外部信用评级机构的分析报告,最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外,鉴于资产支持证券的流动性较差,本基金更倾向于久期较短的品种,以降低流动性风险。

(7)股指期货投资策略

本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萃取相应股票组合的超额收益。

(8)国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。

(9)证券公司短期公司债券投资策略

本基金证券公司短期公司债券的投资策略主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本面情况入手,包括整个证券行业的发展现状,发展趋势,具体证券公司的经营情况、资产负债情况、现金流情况,从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

4、投资限制

(1)投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

1)本基金投资于债券的比例不低于基金资产的50%,但在每个期间开放期的前10个工作日和后10个工作日、到期开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间,基金投资不受前述比例限制;

2)本基金投资于股票的比例不高于基金资产的50%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-50%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-50%);

3)在开放期,每个交易日日终在扣除国债期货和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%,在封闭期,本基金不受前述5%的限制;

4)本基金持有一家公司发行的证券,其市值(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计算)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(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计算),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)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)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%,且基金投资中小企业私募债券的剩余期限,不得超过本基金当期封闭期内的剩余运作期;

16)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%;本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%;

17)如本基金投资国债期货或股指期货的,在封闭期内,本基金每个交易日日终,持有国债期货或股指期货合约的,持有的买入国债期货和股指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%;在开放期内,本基金每个交易日日终,持有国债期货或股指期货合约的,持有的买入国债期货和股指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%;

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;

18)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股票总市值的20%;本基金在任何交易日终,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%;

19)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;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

20)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%;本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%;

21)本基金封闭期的每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;

22)封闭期内,本基金资产总值不得超过基金资产净值的200%;开放期内,本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

23)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。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制,基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在指定媒介公告,且不需要经基金份额持有人大会审议。

除13)条外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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,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本基金合同生效之日起开始。

(2)禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

1)承销证券;

2)违反规定向他人贷款或提供担保;

3)从事承担无限责任的投资;

4)买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

5)向基金管理人、基金托管人出资;

6)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

7)法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(3)关联交易原则

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他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,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,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。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。

其中,中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,具有广泛的市场代表性,能够反应中国债券市场的总体走势。

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,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

本基金业绩比较基准中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果未来法律法规发生变化,或市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或出现更加适合的业绩比较基准时,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,在履行适当程序后报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒介上及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

6、风险收益特征

本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

本基金除了投资A股外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

(六)基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

2、估值方法

以下估值方法中所指的固定收益品种,是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、同业存单等债券品种。

(1)证券交易所上市的有价证券的估值

1)交易所上市的权益类证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

2)交易所上市实行净价交易的固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

3)交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含的应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值。

4)交易所上市不存在活跃市场的权益类证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则应采用估值技术确定其公允价值。

(3)全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,以第三方估值机构提供的价格数据估值;对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,按成本估值。

(4)中小企业私募债采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(5)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

(6)投资证券衍生品的估值方法

1)从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考监管机构或行业协会有关规定,或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

2)首次发行未上市的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

3)因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行估值。

4)股指期货合约以估值日金融期货交易所的当日结算价估值,该日无交易的,以最近一日的结算价估值。

5)国债期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

(7)存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(8)汇率

本基金外币资产价值计算中,涉及港币对人民币汇率的,应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更,或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时,基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率,并及时报中国证监会备案,无需召开基金份额持有人大会。

若无法取得上述汇率价格信息时,以基金托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

(9)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(10)相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

3、基金资产净值、基金份额净值

本基金的《基金合同》生效后,在基金封闭期间,基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日,披露开放期前最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金开放期每个开放日的次日,基金管理人应通过网站、基金销售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和份额累计净值登载在指定媒介上。

(七)基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

(1)变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

(2)关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行,基金管理人应在决议生效后2个工作日内在指定媒介公告。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

(1)基金份额持有人大会决定终止的;

(2)基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

(3)基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元;

(4)《基金合同》约定的其他情形;

(5)相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

(1)基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4)基金财产清算程序:

1)基金合同终止情形发生后,发布基金财产清算公告;

2)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

3)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

4)对基金财产进行估值和变现;

5)制作清算报告;

6)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

7)将清算报告报中国证监会备案并公告。

8)对基金剩余财产进行分配。

(5)基金财产清算的期限为6个月。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

(八)争议解决方式

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为上海,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,除非仲裁裁决另有决定,仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》适用中华人民共和国法律并从其解释。

(九)基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅。

上海东方证券资产管理有限公司
二〇一七年三月三十日