

# 海富通风格优势股票型证券投资基金更新招募说明书

(2010年第1号)

**基金管理人：海富通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

## 重要提示

海富通风格优势股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2006年8月28日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】179号文核准募集。本基金的基金合同于2006年10月19日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通风格优势股票型证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为2010年4月19日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年12月31日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目录

第一节	绪言.....	2
第二节	释义.....	2
第三节	基金管理人.....	8
第四节	基金托管人.....	15
第五节	相关服务机构.....	19
第六节	基金的募集与基金合同的生效.....	33
第七节	基金份额的申购与赎回.....	33
第八节	基金的转换.....	40
第九节	基金的非交易过户与转托管.....	43
第十节	基金的投资.....	44
第十一节	基金的业绩.....	59
第十二节	基金的财产.....	60
第十三节	基金资产的估值.....	61
第十四节	基金的收益与分配.....	66
第十五节	基金的费用和税收.....	68
第十六节	基金的会计与审计.....	70
第十七节	基金的信息披露.....	70
第十八节	风险揭示.....	74
第十九节	基金的终止和清算.....	76
第二十节	基金合同的内容摘要.....	78
第二十一节	基金托管协议的内容摘要.....	92
第二十二节	对基金份额持有人的服务.....	100
第二十三节	其他披露事项.....	103
第二十四节	招募说明书的存放及查阅方式.....	105
第二十五节	备查文件.....	105

## 第一节 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定以及《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了海富通风格优势股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二节 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：**指海富通风格优势股票型证券投资基金；
- 基金合同：**指《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》

- 及对本合同的任何有效修订和补充;
- 招募说明书:** 指《海富通风格优势股票型证券投资基金招募说明书》及其定期更新;
- 托管协议:** 指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《海富通风格优势股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充;
- 基金份额发售公告:** 指《海富通风格优势股票型证券投资基金基金份额发售公告》;
- 中国证监会:** 指中国证券监督管理委员会;
- 中国银监会:** 指中国银行业监督管理委员会;
- 银行业监督管理机构:** 指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会;
- 《证券法》:** 指《中华人民共和国证券法》;
- 《合同法》:** 指《中华人民共和国合同法》;
- 《基金法》:** 指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》;
- 《运作办法》:** 指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》;
- 《销售办法》:** 指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》;
- 《信息披露办法》:** 指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》;
- 《办理规则》:** 指上海证券交易所 2005 年 7 月 14 日发布并施行的《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则(试行)》;
- 《实施细则》:** 指中国证券登记结算有限责任公司 2005 年 7 月 27 日发布并施行的《开放式基金通过上海证券交易所场内认购、申购与赎回登记结算业务实施细则》;
- 《操作指引》:** 指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司

- 2005年7月27日发布并施行的《通过上海证券交易所办理开放式基金相关业务操作指引》
- 元:** 指人民币元;
- 基金合同当事人:** 指受基金合同约束,根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人;
- 基金管理人:** 指海富通基金管理有限公司;
- 基金托管人:** 指中国建设银行股份有限公司;
- 基金份额持有人:** 指依基金合同合法取得基金份额的投资人;
- 注册登记业务:** 指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;
- 注册登记机构:** 指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为海富通基金管理有限公司或接受海富通基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。对于投资人通过销售机构提交的基金交易业务申请(包括基金认购、申购、赎回、转换、转托管、分红方式设置等),其最终处理结果以注册登记机构的确认为准;
- 注册登记系统:** 指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统;
- 投资人:** 指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称;
- 个人投资者:** 指合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民,以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人;
- 机构投资者:** 指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或

- 其他组织；
- 合格境外机构投资者：**指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构；
- 基金份额持有人大会：**指按照基金合同第八部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
- 基金募集期：**指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月；
- 基金合同生效日：**指基金募集达到法律规定及基金合同规定的条件，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理基金备案手续，证监会书面确认的日期；
- 基金合同终止日：**指基金合同规定的合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期；
- 存续期：**指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 认购：**指在基金募集期间，投资人申请购买基金份额的行为；
- 申购：**指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为；
- 赎回：**指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为；
- 巨额赎回：**指本基金单个开放日，基金净赎回申请（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）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回；
- 基金转换：**指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转

- 换为基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金的基金份额的行为；
- 转托管：**指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金份额从一个销售机构托管转移到另一销售机构的行为；
- 投资指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
- 会员单位：**指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员
- 代销机构：**指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，包括可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理有关业务的会员单位；
- 销售机构：**指基金管理人直销机构及本基金代销机构；
- 场内：**指通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所；
- 场外：**指通过上海证券交易所开放式基金销售系统外办理开放式基金份额认购、申购、赎回等业务的销售机构和场所；
- 基金销售网点：**指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点；
- 指定媒体：**指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体；
- 基金账户：**指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户；

- 交易账户：**指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换和转托管等业务产生的基金份额变动及其结余情况的账户；
- 工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 开放日：**指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- T 日：**指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
- T + n 日：**指自 T 日起第 n 个工作日 (不包含 T 日)；
- 基金收益：**指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
- 基金资产总值：**指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产的价值总和；
- 基金资产净值：**指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金份额净值**指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数所得的值；
- 基金财产估值：**指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
- 法律法规：**指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等；
- 不可抗力：**指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等

## 第三节 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：包瑾

注册资本：1.5 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎投资管理 BE 控股公司（原名“富通基金管理公司”。与外方股东更名相关的变更程序目前正在办理之中）49%。

### （二）主要人员情况

邵国有先生，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997 年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加 (Stewart Edgar) 先生，董事，英国籍，学士。历任英国 Ivory & Sime 公共有限公司基金经理，美国 Fiduciary 国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国 HD 国际有限公司高级基金经理、董事，美国 F&C 管理公司高级基金经理、董事。1997 年至今任法国巴黎投资管理 BE 控股公司（原名“富通基金管理公司”）董事总经理。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁 Euroequipment S.A. 公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富

通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

董文标先生，独立董事，硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长，中国民生银行党委委员、副行长，中国民生银行党委书记、行长，现任中国民生银行董事长、党委书记。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院院长。

巴约特 (Marc Bayot) 先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，EFAMA (欧洲基金和资产管理协会) 和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT 公司 (布鲁塞尔) 董事总经理、Pionner 投资公司 (米兰，都柏林，卢森堡) 和 Degroof 资产管理 (布鲁塞尔) 独立董事、基金联合公会 (哥本哈根) 独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任上海大众交通 (集团) 股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用 (集团) 股份有限公司董事长。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展公司副总经理、海通证券计划财务部总经理、海通证券财务总监。

余毓繁先生，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理。现任富通银行亚洲区行政总裁。

奚万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003 年 4 月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理，监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int' l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理兼投资总监，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003 年 4 月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金基金经理，2005 年 7 月至 2006 年 9 月任海富通股票基金基金经理，2006 年 3 月至 9 月任海富通收益增长混合基金基金经理，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007 年 2 月至 2007 年 8 月任海富通风格优势股票基金基金经理，2007 年 4 月至 2007 年 8 月任海富通精选贰号混合基金基金经理，2008 年 6 月起任海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部市场经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

康赛波先生，1997 年毕业于湖南大学金融系，获学士学位。1997 年至 1999 年工作于湘财证券有限责任公司，主要从事投资管理业务；1999 年至 2000 年工作于大成基金管理有限公司，从事研发及投资管理业务；2001 年 2 月起加入湘财合丰基金管理公司筹备组，2003 年 4 月至 2005 年 4 月任泰达荷银合丰稳定基金基金经理；2005 年 4 月至 2006 年 12 月担任泰达荷银风险预算股票基金基金经理；2006 年 5 月至 2007 年 4 月担任泰达荷银效率基金基金经理；2007 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，2007 年 8 月起任海富通风格优势股票基金基金经理。

本基金历任基金经理分别为郑拓先生，任职时间为 2006 年 10 月至 2007 年 3 月；陈洪先生，任职时间为 2007 年 2 月至 2007 年 8 月。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理兼投资总监；蒋征，股票组合管理部总监；郭杰，股票组合管理部总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；戴

德舜，研究总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1. 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2. 办理基金备案手续；

3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6. 编制中期和年度基金报告；

7. 计算并公告基金资产净值、确定基金份额申购、赎回价格；

8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9. 召集基金份额持有人大会；

10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

1. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）用基金资产承销证券；

- (6) 用基金资产向他人贷款或提供担保;
- (7) 用基金资产从事承担无限责任的投资;
- (8) 用基金资产买卖其他基金份额,但国务院另有规定的除外;
- (9) 以基金资产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- (10) 以基金资产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有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;
- (11) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (12) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

3. 基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

- (1) 越权或违规经营;
- (2) 违反基金合同或托管协议;
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- (6) 玩忽职守、滥用职权;
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票投资;协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
- (9) 违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
- (10) 贬损同行,以提高自己;
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 法律法规禁止的其他行为。

#### 4. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### (五) 基金管理人的内部控制制度

#### 1. 内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部和监察稽核部，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

(3) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(4) 有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

(6) 适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改

变及时进行相应的修改和完善；

(7) 定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性。

(8) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

(9) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

## 2. 内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1) 公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟定，其制定和实施需事先报经公司业务管理委员会讨论通过和总经理批准。

公司致力于将国际资产管理行业成熟的专业经验同中国资产管理行业的实际情况相结合，建立既符合国际规范又行之有效的内部控制机制。

## 3. 完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系，董事会层面设立督察长，管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部和风险管理部，通过风险管理制度、合规性制度和稽核监察制度三个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系，对公司内部控制和风险管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈，保障公司

内部控制机制的严格落实。

风险管理制度由董事会下设的风险委员会制定风险管理政策，由管理层的风险管理委员会负责实施，由风险管理部专职落实和监督，公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施，全面把握风险点，将风险管理责任落实到人，实现对风险的日常管理和过程中管理，防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

合规性制度由监察稽核部具体落实，通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估及检查，监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况，识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险，提出并完善公司各项合规性制度，以充分维护公司客户的合法权益。

稽核监察制度在督察长的领导下严格实施，由监察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职能，通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节，对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

#### 4. 基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四节 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：尹东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

截至2009年12月31日，中国建设银行实现净利润1,068.36亿元，较上年增长15.32%，每股盈利为0.46元，较上年增加0.06元，盈利水平好于预期；平均资产回报率为1.24%，较上年降低0.07个百分点，加权平均净资产收益率为20.87%，较上年提高0.19个百分点，整体盈利趋势向好；总资产达到96,233.55亿元，较上年增长27.37%；资产质量在国内大银行中保持领先，不良贷款额和不良贷款率持续双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为1.50%，较上年末下降0.71个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为175.77%，较上年末提升44.19个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行，在悉尼设有代表

处，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM) 36,021台，拥有员工约30万人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，在2009年共获得50多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的“全球金融品牌500强”、“全球银行1000强”中分列第9位和第12位，被《亚洲货币》杂志评为2009年度“中国区最佳银行”，被《欧洲货币》杂志评为2009年度“中国最佳银行”，连续两年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”，荣获《亚洲银行家》杂志颁发的“中国风险管理成就奖”，中国扶贫基金会颁发的“20年特别贡献奖”等奖项，被中国红十字基金会评为“最具责任感企业”，被《全球托管人》杂志评为“国内最佳托管银行”，连续三年荣获香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工130余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

## (二) 主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理

及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2009 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 143 只证券投资基金，其中封闭式基金 6 只，开放式基金 137 只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010 年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，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，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集

中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### 三、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

#### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第五节 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37

层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37

层

法定代表人: 邵国有

全国统一客户服务号码: 40088-40099 (免长途话费)

电话: 021-38650797

传真: 021-33830160

## 2、场外代销机构

### (1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 郭树清

客户服务电话: 95533

联系人: 何奕

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### (2) 中国银行股份有限公司

地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 肖钢

电话: 010-66596688

传真: 010-66593777

客户服务电话: 95566

网址: [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### (3) 中国工商银行股份有限公司

地址: 中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

客户服务电话: 95588

联系人: 田耕

网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

### (4) 交通银行股份有限公司

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

网址：www.bankcomm.com

**(5) 招商银行股份有限公司**

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

客户服务电话：95555

联系人：丰靖

网址：www.cmbchina.com

**(6) 深圳发展银行股份有限公司**

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank Neil Newman)

客户服务电话：95501

联系人：周勤

网址：www.sdb.com.cn

**(7) 上海浦东发展银行股份有限公司**

地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务电话：95528

联系人：徐伟、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

**(8) 中国民生银行股份有限公司**

地址：北京市东城区正义路 4 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍、吴海鹏

网址：www.cmbc.com.cn

**(9) 广东发展银行股份有限公司**

注册地址：广州市农林下路83号

法定代表人：董建岳

客户服务电话：95508

联系人：詹全鑫 张大奕

网址：[www.gdb.com.cn](http://www.gdb.com.cn)

**(10) 中信银行股份有限公司**

地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

客户服务电话：95558

联系人：李瑞

网址：[www.ecitic.com/bank](http://www.ecitic.com/bank)

**(11) 中国光大银行股份有限公司**

地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：王明权

客户服务电话：95595（全国）

联系人：李伟

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

**(12) 浙商银行股份有限公司**

地址：中国杭州市庆春路288号

法定代表人：张达洋

客户服务电话：995105665

联系人：吴军阳

网址：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

**(13) 宁波银行股份有限公司**

地址：宁波市江东区中山东路294号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528

联系人：胡技勋

网址: [www.nccb.com.cn](http://www.nccb.com.cn)

**(14) 海通证券股份有限公司**

地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

客户服务电话: 021-95553 或 4008888001

联系人: 李笑鸣

网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

**(15) 中信证券股份有限公司**

地址: 北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人: 王东明

电话: 010-84588266

联系人: 陈忠

网址: [www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

**(16) 光大证券股份有限公司**

地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 徐浩明

客户服务电话: 400-8888-788

联系人: 刘晨、李芳芳

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

**(17) 国泰君安证券股份有限公司**

地址: 上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人: 祝幼一

客户服务电话: 400-8888-666

联系人: 韩星宇

网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

**(18) 中信建投证券有限责任公司**

地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 张佑君

客户服务电话: 400-8888-108

联系人：权唐

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

**(19) 招商证券股份有限公司**

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：官少林

客户服务电话：400-8888-111 或 95565

联系人：黄健

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

**(20) 兴业证券股份有限公司**

地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

客户服务电话：400-8888-123

联系人：谢高得

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

**(21) 华泰证券股份有限公司**

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：95597

联系人：张小波

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

**(22) 华泰联合证券有限责任公司**

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人：马昭明

客户服务电话：400-8888-555、95513

联系人：盛宗凌

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

**(23) 广发证券股份有限公司**

地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：王志伟

客户服务电话：95575或致电各地营业网点

联系人：黄岚

网址：www.gf.com.cn

**(24) 长江证券股份有限公司**

地址：武汉市新华下路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999 或 027-85808318

联系人：李良

长江证券客户服务网站：www.95579.com

**(25) 申银万国证券股份有限公司**

地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

客户服务电话：962505

联系人：邓寒冰

网址：www.sywg.com.cn

**(26) 中银国际证券有限责任公司**

地址：上海市浦东银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：唐新宇

客户服务电话：400-6208-888

联系人：张静

网址：www.bocichina.com.cn

**(27) 东方证券股份有限公司**

地址：上海市浦东大道720号20楼

法定代表人：潘鑫军

客户服务电话：95503

联系人：吴宇

网址：www.dfzq.com.cn

**(28) 国信证券股份有限公司**

地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

联系人：齐晓燕

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

**(29) 中国银河证券股份有限公司**

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

客户服务电话：4008-888-888

联系人：李洋

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

**(30) 平安证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：95511

联系人：袁月

网址：[www.pa18.com](http://www.pa18.com)

**(31) 世纪证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

联系人：张婷

网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

**(32) 中信金通证券有限责任公司**

地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客户服务电话：0571-96598

联系人：俞会亮

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

**(33) 中信万通证券有限责任公司**

地址：青岛市市南区东海路 28 号

法定代表人：史浩民

客户服务电话：电话：0532-96577

联系人：吴忠超

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

**(34) 东北证券股份有限公司**

地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：0431-96688

联系人：潘锴

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

**(35) 财通证券有限责任公司**

地址：杭州市解放路 111 号财通证券

法定代表人：沈继宁

客户服务电话：0571-96336（上海地区 962336）

联系人：乔俊

网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

**(36) 天相投资顾问有限公司**

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人：林义相

客户服务电话：400-887-8827

联系人：陈少震

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

**(37) 国海证券有限责任公司**

地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅峰

客户服务电话：96100（广西），4008888100（全国）

联系人：覃清芳

网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

**(38) 恒泰证券股份有限公司**

地址：内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4961259

联系人：张同亮

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

**(39) 瑞银证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

客户服务电话：400-887-8827

联系人：谢亚凡

网址：[www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com)

**(40) 江南证券有限责任公司**

地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：姚江涛

电话：0791-6768763

联系人：余雅娜

网址：[www.scstock.com](http://www.scstock.com)

**(41) 国元证券股份有限公司**

地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客户服务电话：0551-96888

联系人：陈琳琳

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

**(42) 德邦证券有限责任公司**

住所：上海市福山路 500 号城建大厦 26 层

法定代表人：方加春

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

**(43) 宏源证券股份有限公司**

公司注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源证券

法定代表人：汤世生

客户服务电话：010-62294600

联系人：李巍

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

**(44) 齐鲁证券有限公司**

地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙豪志

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

**(45) 第一创业证券有限责任公司**

地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层

法定代表人：刘学民

客户服务电话：0755-25832523

联系人：魏颖

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

**(46) 湘财证券有限责任公司**

地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：陈学荣

客户服务电话：400-888-1551

联系人：李梦诗

网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

**(47) 安信证券股份有限公司**

地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

**(48) 中国建银投资证券有限责任公司**

地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

客户服务电话：400-600-8008

联系人：刘权

网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

**(49) 中国国际金融有限公司**

地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李剑阁

公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）

联系人：易建军

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

**(50) 中国民族证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6 层-9 层

法定代表人：赵大建

客户服务电话：400-889-5618

联系人：李薇

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

**(51) 华宝证券有限责任公司**

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

联系人：刘闻川

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

**(52) 信达证券股份有限公司**

地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

**(53) 长城证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

客户服务电话：400666888

联系人：匡婷

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

**(54) 方正证券有限责任公司**

地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：张志刚

客户服务电话：95571

联系人：彭博

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

**(55) 广发华福证券有限责任公司**

地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：96326

联系人：张腾

网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

**(56) 渤海证券股份有限公司**

地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：张志军

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

**(57) 东莞证券有限责任公司**

地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

客户服务电话：961130

联系人：梁建伟

网址：www.dgzq.com.cn

### 3、场内销售机构

具有开放式基金代销资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构，相关信息同时通过上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）登载。

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并按照相关规定及时公告。

#### （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

电话：010-58598835

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

#### （三）出具法律意见书的律师事务所

北京市金杜律师事务所

地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

负责人：王玲

电话：010-58785588

传真：010-58785599

联系人：宋萍萍

联系电话：0755-82125533

经办律师：靳庆军、宋萍萍

#### （四）审计基金财产的会计师事务所

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 16 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、徐振晨

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：徐振晨

## 第六节 基金的募集与基金合同的生效

### （一）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，并于 2006 年 8 月 28 日经中国证监会证监基金字【2006】第 179 号文核准募集发售。设立募集期为 2006 年 9 月 11 日至 2006 年 10 月 13 日，共募集 2,218,085,859.91 份基金份额，有效认购户数为 46,513 户。

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

### （二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2006 年 10 月 19 日正式生效。

## 第七节 基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

本基金的申购与赎回将通过本基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资人也可通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上等形式进行申购与赎回。

### （二）申购与赎回办理的时间

1. 本基金已于 2006 年 11 月 1 日起开始办理申购业务，2006 年 11 月 30 日起开始办理赎回业务。

#### 2. 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。基金管理人根据法律法规或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

### （三） 申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理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”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 基金份额持有人赎回基金份额，注册登记系统遵循“先进先出”的原则，即对基金份额持有人在销售机构托管的份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定赎回份额所适用的费率；

4. 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。

5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则，但最迟须在新的原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

### （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，在开放日的交易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、赎回申请无效而不予成交。

#### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应当于受理基金投资人申购、赎回申请之日起3个工作日内，对申请的有效性进行确认。

#### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成

功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资人支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资人账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

## （五） 申购和赎回的数额和价格

### 1、 申购金额、赎回份额及余额的处理方式

（1） 场外单次申购的最低金额为 1000 元；场内单次申购的最低金额为 1000 元，最高金额为 99,999,900.00 元，且场内单次认购金额必须是 100 的整数倍。

（2） 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1000 份基金份额，且通过场内申请赎回的基金份额必须是整数份；基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 1000 份的，需一并全部赎回。

（3） 基金份额持有人在单个销售机构处持有本基金的最低份额为 1000 份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其基金账户内在该销售机构处剩余的基金份额低于 1000 份时，注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

2、 基金管理人可根据市场情况，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前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

### 3、 申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。投资人在同一天多次申购的，按照单次申购金额确定每次申购所适用的费率。计算公式如下：

$$\text{申购费} = \text{申购金额} \times \text{申购费率} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购份额} = (\text{申购金额} - \text{申购费}) / \text{T 日基金份额净值}$$

申购费以四舍五入方式保留到小数点后两位。场内申购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给投资人；场外申购份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 4、 赎回金额的计算

投资人在赎回基金份额需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

赎回金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费 = 赎回份额 × T 日基金份额净值 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费

赎回费、赎回金额以四舍五入方式保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 5、 基金份额净值的计算公式

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 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。计算公式为：

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日基金份额的余额数量

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，由此产生的误差在基金财产中列支。

### （六） 申购与赎回的费用

1、 本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2、 根据基金合同的规定，本基金申购费率不超过 1.5%，赎回费率不超过 0.5%。

3、 申购费率按照申购金额逐级递减，投资人在一天之内如果有多笔申购的，按单笔申购金额确定每笔申购所适用的费率并分别计算。实际执行的申购费率如下：

业务类型	金 额 (M)	费率
申购	M ≥ 500 万	按笔收取，1000 元/笔
	200 万 ≤ M < 500 万	0.6%

	100 万 ≤ M < 200 万	1.0%
	50 万 ≤ M < 100 万	1.2%
	M < 50 万	1.5%

4、赎回费率按照持有时间逐级递减。本基金赎回费率按持有期分档如下：

业务类型	持有期	费率
赎回	1 年以下	0.5%
	1 年（含）以上，2 年以下	0.25%
	2 年（含）以上	0%

5、在遵守法律法规及基金合同规定的前提下，基金管理人可根据市场情况制定基金促销计划。基金促销计划可以针对特定时间范围、特定地域范围、特定行业、特定职业等的投资人或以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资人等定期或不定期地开展。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购费率、赎回费率。

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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日前在至少一种指定媒体公告。

#### （七）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资人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、投资人申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施 3 个工作日前予以公告。

#### （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。
2. 证券交易所在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。

3. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4 基金财产规模过大，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，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形。

5. 基金管理人无正当理由认为需要暂停接受基金申购申请的；

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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。

### **(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人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 不可抗力。

2. 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。

3. 连续两个开放日发生巨额赎回。

4. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，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，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在中国证监会指定媒体上公告。投资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。

### **(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顺延赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)部分顺延赎回: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日基金总份额的10%的前提下,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;当日未能赎回部分,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,当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以该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. 巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时,基金管理人应立即向中国证监会备案,并在2日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告,说明有关处理方法。

连续2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,但不得超过正常支付时间20个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

#### (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,并在规定期限内至少一种指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为1日,第2个工作日基金管理人应在至少一种指定媒体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. 如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 日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 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 日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## 第八节 基金的转换

### （一）基金转换

基金转换是指投资人在本基金存续期间要求将其持有的本基金全部或部分份额转换为基金管理人管理的其它开放式基金份额的行为。

### （二）基金转换申请人的范围

旗下基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理基金转换。

### （三）基金转换受理场所

基金转换将通过基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。

### （四）基金转换受理时间

基金管理人自 2006 年 11 月 1 日起开始办理基金转换转入业务，11 月 30 日起开始办理基金转换转出业务。

办理基金转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

### （五）基金转换费用

1、基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

（1）基金转换申购补差费：当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转

入基金申购费率时，不收取费用补差。

(2) 转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用，转出基金赎回费总额的 25% 归入转出基金资产。

(3) 计算基金转换的申购补差费按照转出和转入基金的正常申购费率执行。

2、特别提示：由本基金转换到海富通精选贰号混合时，如果投资者的转入金额在 500 万（含）到 1000 万之间，在收取基金转换的申购补差费时，直接以海富通精选贰号混合该档次申购费率（即 1.0%）计算申购补差费，将不再扣减申购原基金时已缴纳的 1000 元申购费。

基金管理人可自行决定调低转换费率，并最迟于新费率开始实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

#### （六）基金转换公式

1、前端收费模式下，基金的转换公式为：

$$A = [B \times C \times (1-D) / (1+H) + G] / E$$

$$F = B \times C \times D$$

$$J = [B \times C \times (1-D) / (1+H)] \times H$$

其中，

A 为转入的基金份额数量；

B 为转出的基金份额数量；

C 为转换当日转出基金份额净值；

D 为转出基金份额的赎回费率；

E 为转换当日转入基金份额净值；

F 为转出基金份额的赎回费；

G 为转出基金份额对应的未支付收益，若转出基金为非货币市场基金的，则  $G = 0$ ；

H 为申购补差费率，当转出基金的申购费率  $\geq$  转入基金的申购费率时，则  $H = 0$ ；

J 为申购补差费。

转出金额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转出资金的基金资产中列支；转入份额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转入基金的基金资产中列支。

2、基金管理人在不损害各基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前 3 个工作日予以公告。

### **（七）基金转换的程序**

#### 1. 基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

#### 2. 基金转换申请的确认

基金管理人应以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T 日），并在 T+1 日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

### **（八）基金转换的数额限制**

基金转换按照份额进行，申请转换份额精确到小数点后两位，单笔转换份额不得低于 1000 份。

### **（九）基金转换的注册登记**

1. 基金投资人提出的基金转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后即不得撤销。

2. 基金份额持有人申请基金转换成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

3. 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

### **（十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式**

1. 除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受各基金份额持有人的基金转换申请：

a) 不可抗力；

b) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

c) 基金管理人认为可能有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换申请；

d) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

2. 发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。
3. 发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准。
4. 暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。
5. 暂停期结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周，暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额净值。

## 第九节 基金的非交易过户与转托管

（一）非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为。本基金基金注册登记机构受理因继承、捐赠和司法强制执行及基金注册登记机构认可的其它原因而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

1. “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。
2. “捐赠”指受理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其他具有社会公益性质的社会团体。
3. “强制执行”是指司法机关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。

(二) 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料, 直接向基金注册登记机构申请办理。对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理, 并按基金注册登记机构规定的标准收费。

(三) 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构(网点)时, 可办理已持有基金份额的转托管。

投资人申购基金份额后可以向原申购基金的销售机构发出转托管指令, 缴纳转托管手续费, 转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

转托管在转出方进行申报, 基金份额转托管经一次申报便可完成。投资人于T日转托管基金份额成功后, 转托管份额于T+1日到达转入方网点, 投资人可于T+2日起赎回该部分基金份额。

(四) 基金注册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。基金份额被冻结的, 被冻结部分产生的权益(包括现金分红和红利再投资)一并冻结。

(五) 在相关法律法规有明确规定的条件下, 基金注册登记机构可以办理基金份额的质押业务, 制订公布并实施相应的业务规则。

## 第十节 基金的投资

### (一) 投资目标

在适度控制风险并保持资产良好流动性的前提下, 通过积极选择不同风格优势的股票, 力争为投资者提供长期稳定的超额回报。

### (二) 投资方向和范围

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品, 基金管理人在履行适当的程序后, 可以将其纳入投资范围。

在通常市场情况下, 基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%~95%, 权

证投资 0%~3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~40%，其中，基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

### （三）投资理念

通过适度的大类资产配置、风格优势板块的积极动态优化管理，并在风格优势策略下精选个股，追求基金资产持续稳定的增长，力争在控制风险的前提下为投资者谋求最大回报。

### （四）投资策略

实践表明，不同的股票风格投资策略适应不同的市场环境，并取得不同的业绩表现。本基金将在适度的大类资产配置的基础上，运用“风格优选，积极轮换，精选个股”策略，把握不同风格优势策略在不同阶段的变动趋势和投资机会，并在策略内自下而上精选个股，实现基金资产的超额收益。本基金的投资策略主要包括资产配置策略、风格轮换策略和精选证券策略。

#### 1. 资产配置策略

在目前国内证券市场缺乏规避市场风险工具的情况下，实施适度的资产配置有利于规避市场的系统性风险，保障基金资产的稳定增值，更好地保护基金份额持有人的利益。因此，本基金采用多因素分析系统，依据定量和定性相结合的证券市场宏观分析、股票市场估值水平和市场系统性风险等因素，适度调整股票、债券、货币市场工具和其他法律法规允许的金融工具的投资比例。

多因素分析系统包括对宏观经济运行趋势的判断、经济政策调整的前瞻性分析，以及各类别资产的政策效应研究等，主要考虑以下几个因素：

- 经济周期和经济环境，包括宏观经济发展趋势，经济的景气周期研究等。本基金管理人将特别关注 GDP 增长、各种国民生产统计指标等，从而分析对股票市场的影响；

- 货币因素，主要包括利率水平及其变化、CPI、货币政策等。本基金管理人还将时刻关注利率以及人民币汇率水平的变化对中国经济及证券市场的影响；

- 市场估值，包括市场的相对定价水平、估值水平等。通过分析不同资产类别的长期风险收益特征，研究影响短中期各类资产估值的因素、市场出现的短期不均衡等情况，以定性定量的方法，侧重于研究证券市场的定价指标如 PE、

债券收益率等，以及证券类资产与商品类资产如石油、黄金、房地产等价格趋势比较及其影响；

- 政策影响因素，不同政策发布对不同资产类别的影响分析等。本基金管理人相信政策对中国证券市场的影响将在相当长的一段时间内发挥非常重要的作用，因此本基金管理人将总结历史，密切关注及预测政策发生对证券市场产生的影响；

- 利润预测分析因素，通过对商品价格、货币价格变化的分析，形成对行业利润趋势的意见；

- 量化模型分析因素，通过市场价值中枢模型，从量化的角度衡量资产类别的估值水平，并发现市场趋势；

- 市场气氛，通过对不同技术指标以及信心等对证券市场的气氛进行评估。通过对信心指标如分析师指数、市场特殊效应、人气指标、成交量指标、换手率指标进行分析，帮助基金确定和调整资产类别间的配置。

## **2. 风格轮换策略**

对中国股票市场历史数据的实证分析显示，在不同阶段不同风格股票投资策略股票的收益不尽相同。因此，本基金将运用“风格轮换模型”(Style Rotation Investment Model, SRIM)，划分、识别价值和成长策略，在此基础上，采取自下而上精选个股策略，以风格优势混合策略建立资产组合，努力克服单一策略投资所带来的局限性，争取长期获得主动投资的超额收益。

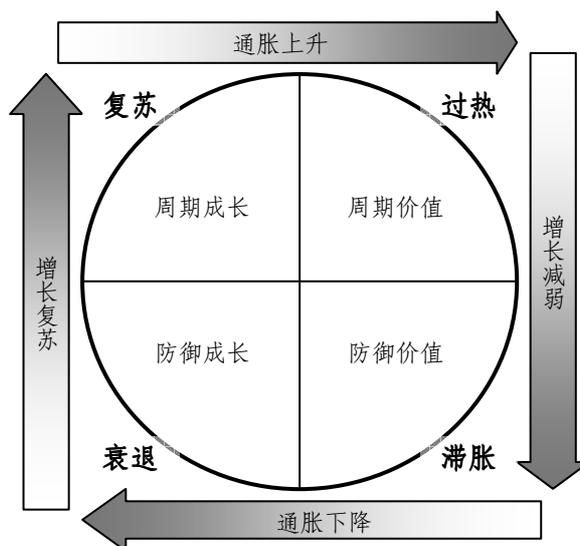
### **(1) 风格投资研判**

本基金将运用 SRIM 模型对股票进行分类，把中国 A 股市场中的股票按市净率 (PB)、市盈率 (PE)、主营业务增长率、净利润增长率等估值与成长性指标，采用现代统计学的基本理论，运用多元统计分析法，选择价值风格样本股票、成长风格样本股票，并编制价值指标和成长指标。同时，本基金管理人的策略分析师、定量分析师和股票分析师将在对宏观经济周期、行业景气周期的深入研究基础上，判断行业及行业内公司的估值水平和成长水平，将行业分为防御价值、防御成长、周期价值和周期成长四类，并优选风格投资策略。

### **(2) 风格优势轮换**

本基金将采用风格轮换模型，依据宏观经济周期、行业景气周期、市场景气

循环及相关环境变化,跟踪近期价值投资策略与成长投资策略对股票预期收益的发展趋势,确定当期“价值投资策略”和“成长投资策略”的权重,从而决定两者配置的比例。当某风格策略板块相对于大市的超额收益率出现上升或者下降趋势并到达预设的临界点时,增加或者减少该板块的权重。在经济衰退期(过热后期和滞胀期),投资策略以保值为主,以价值投资为首选对象,投资受行业经济周期影响不大的行业或价值低估型股票;在经济繁荣期(衰退后期和复苏期),以成长投资为主,投资盈利增长率高于市场平均的行业和股票。本基金管理人将动态检视上述价值策略与成长策略的有效性,在严谨量化分析基础上,予以进行适度调整。



图：宏观经济周期、行业景气周期下的风格投资轮换

### 3. 股票投资策略

针对各策略板块,本基金将采用定性指标与定量指标相结合,根据不同策略和标准,精选策略内的个股。

#### (1) 价值型股票投资

价值型投资采用定量分析和定性分析相结合的方法,主要的投资类型包括稳定收益型价值投资和高 $\alpha$ 型价值投资。

## • 定量分析

本基金管理人运用海富通定价分析系统，选择市盈率 PE、市销率 PS、市息率 PD 等估值指标低于市场平均水平的股票，并对公司的低价因素进行合理分析，在价值型公司中找到基本面素质较好，投资价值被低估的公司。这样有利于更好的控制投资风险、获取投资收益。

## • 定性分析

本基金重点关注的价值型股票主要包括：

- 与同行业的或主营业务相近的其它公司相比，公司具有相对价值；
- 结合公司未来业务发展和盈利水平确定的市盈率水平（动态市盈率）偏低；
- 企业拥有未被市场认识或被市场低估的资源；
- 企业经过并购和资产重组等事项后，基本面发生了积极变化，且其潜在价值未被市场充分认识；
- 公司治理结构良好，行为规范，信息透明，注重公众股东利益和投资者关系；
- 主营业务鲜明并具有一定的竞争力；
- 经营管理能力和市场竞争能力在行业中具有明显优势；
- 具备长期持续稳定成长性，预期至少未来两年的主营业务收入和利润增长率高于GDP增长率；
- 财务状况良好，具备较好的抗风险能力。

## • 稳定收益型价值投资

对于稳定收益型股票，本基金将以较高预期股息收益率为核心，同时结合以下几方面进行选择：

- 公司进入稳定发展阶段，预期主营业务收入及净利润保持稳定增长；
- 公司现金流状况良好；
- 公司有现金分红历史记录，同时具有继续进行现金分红的潜力；
- 预期股息收益率处于市场平均水平之上。

根据以上标准，选择出重点目标公司，在周密的案头研究基础上，通过实地调研，最终精选一批具备投资价值的收益型股票。

## • 高 $\alpha$ 型价值投资

高 $\alpha$ 型股票主要是指股票价格与价值之间的差异高过某一安全边际的股票。本基金对于高 $\alpha$ 股票投资价值的判断，主要依赖于两方面的基础工作：一是以行业专家和财务专家的角度对公司发展、经营和财务状况进行深入调查研究，二是运用 DDM、DCF 或 DFCF 等模型，选择股价具有较大升值空间的价值成长兼有型公司，主要包括两类：

一类是企业在过去经营中累积的核心竞争优势，包括由于公司具有强有力的管理团队、先进的技术、独占的专利、持续的创新能力和严格规范的管理、独到的企业文化、雄厚的品牌商誉、庞大的市场网络等因素带给企业持续发展的能力；

另一类是由于政策垄断、资源独占、进入壁垒高等因素所带给企业的持续发展能力，并且这些因素在可预见的将来不会改变或消失。

具有持续发展能力的上市公司一般具有以下特点：

- 公司主营业务清晰突出，经营业绩稳定成长，业绩真实、可靠；
- 财务状况良好，具备良好的盈利记录，有一定的现金分红能力；
- 有强有力的管理团队，重视股东价值增加，诚实信用；
- 公司在成本、技术、研究开发、市场营销、管理创新等方面具有一定优势，在行业内处于领先的地位，并且在竞争中积累了对手难以模仿的资源或能力；
- 公司股票具备一定规模的流通市值，具备良好的流动性。

本基金通过投资于具有高 $\alpha$ 和持续发展能力的价值成长兼有的上市公司，可以在较长的时期分享中国经济增长的成果，获取资本的中长期平稳增长。

## （2）成长型股票投资

投资成长类股票是分享中国证券市场成长的重要方法之一。本基金管理人重点关注具有内涵式增长特点的企业。内涵式增长主要是来自企业的管理技能的可复制、技术积累和进步的程度、及公司抵抗风险持续生存的能力。

## • 定量分析

定量分析主要包括公司基本面定量分析和盈利预测两方面。本基金以价值成长比率（PEG）、主营业务增长率、净资产收益率、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续

增长潜力的上市公司进行投资。

通常，具备持续成长能力的公司具备两个重要特征：一是主营业务的持续成长；二是成长的动力主要来自于公司内部。因此，本本基金管理人主要应用从三个定量指标在成长类股票中选择股票：PEG、主营业务增长率与净资产收益率。PEG 主要代表整个公司成长性的综合指标，主营业务增长率主要代表公司业务的持续成长能力，净资产收益率主要代表成长动力的内生性。

预期 PEG 值的计算公式如下：

$$PEG = P / EPS / G$$

其中：P 为计算日股票的收盘价，EPS 为上市公司最新年报的每股收益，G 为根据上市公司历史财务数据、实地调研、财务模型和其他相关信息预测的预期主营业务利润增长率。

#### • 定性分析

本基金对公司治理结构的考核主要包括一系列定性的指标，如公司核心竞争力如何、监督和制衡机制是否有效，激励机制是否合理，公司管理层是否具有好的诚信度等等。主要关注的指标包括：

- 行业是否有准入壁垒、技术壁垒或者其他壁垒；
- 行业的竞争结构；
- 公司在行业中的地位、市场占有率、竞争能力、竞争策略；
- 公司研发投入的比重及有效性，新产品的推出速度和竞争力；
- 公司的分红政策、财务杠杆是否合理及其发展趋势；
- 管理层的发展战略是否合理有效；
- 市场网络、品牌和商誉。

本基金股票投资强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合，并实时应用风险控制手段进行组合调整。深入的公司研究和分析是发掘这些具有价值低估的成长性股票的核心，通过定性的分析和定量的筛选，得出对公司未来盈利成长的潜力、质量以及持续性的评价，从而发掘出价值被市场低估并具有良好的成长性的股票。

#### 4. 债券投资策略

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券和货币市场工具组合。

##### (1) 债券组合的调整与管理

本基金将综合运用久期管理、期限结构配置、跨市场套利、相对价值判断、现金管理等债券组合管理技术进行日常管理。

a) 期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，在短、中、长期债券间进行动态调整，从债券各品种的相对价格变化中获利；

b) 本基金在债券投资过程中将密切关注市场创新和变化中带来的投资机会，以及把握债券套利和可转债套利的投资机会，提高债券投资的收益水平。

c) 相对价值判断是在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种，选择合适的交易时机，增持相对低估的品种，减持相对高估的品种。

另外，为满足日常赎回要求及资产配置和调整过程中产生的流动性要求，基金资产中有一定比例现金类资产。本基金将充分利用货币市场投资工具如回购、央行票据等工具提高现金资产的收益率。

##### (2) 个券的选择和债券组合的构建

在个券选择上，本基金将综合运用利率预期、公司信用分析、流动性评估等方法来评价个券的风险收益。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金债券投资重点关注的对象：

- a) 有良好流动性的债券；
- b) 有较高信用等级的债券；
- c) 在信用等级和剩余期限类似的条件下，到期收益率较高的债券；
- d) 风险水平合理、有较好下行保护、基本面有良性变化的可转换债券。

在债券组合的构建上，本基金将通过上述债券分析框架，判断债券市场的短、中、长期趋势，本着风险收益配比最优的原则确定债券资产的类属配置比例。

#### 5. 权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的；在个股层面上，充分发掘可能的套利机会，以达到增值的目的。

本基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证，并可以根据证券交易所的有关规定卖出该部分权证或行权。

本基金将根据权证投资策略主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

## 6. 投资方法与流程

本基金采用主动投资管理模式，投资方法将主要采用自上而下的方法。

首先，对各类资产（股票、债券、现金及其他金融资产）进行适度动态配置。

其次，构造候选股票池：1）以“成长”、“价值”指标进行严谨的股票筛选，通过数据处理，计算每一只股票的风格等级并排序，划分成长型和价值型股票；2）对上述成长型和价值型股票按照各自选股标准进行进一步筛选，研究团队将对个股进行基本面审核，所有个股进行投资级别分类，确定本基金的备选股票池。

第三，依据海富通风格优势轮换模型、市场环境及本基金管理人实践经验，可对各策略指标进行合理调整，确定成长型公司股票和价值型公司股票的投资比例。

第四，基金经理综合考虑资产配置、成长型和价值型股票的比例、行业状况变化及市场特点等因素，从候选股票池中挑选合适的股票，构造基金资产组合。

## （五）投资决策

### 1、决策依据

- （1）投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- （2）投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；
- （3）投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

### 2、决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

(1) 投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2) 投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在股票分析师设定的股票池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

## **(六) 业绩比较基准**

MSCI CHINA A75% + 上证国债指数 25%。

## **(七) 风险收益特征**

本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

## **(八) 投资禁止行为与限制**

### **1. 组合限制**

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合

将遵循以下限制：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的百分之十；

(2) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的百分之十；

(3) 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净资产的百分之四十；

(4) 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；

(5) 基金财产投资权证时，应遵循以下限制：

a) 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千分之五；

b) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

c) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十。

(6) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述第(1)、(2)、(5) b)、(5) c) 项规定或者基金合同约定的投资组合限制的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。

## 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) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有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；
- (7) 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；
- (8) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

### (九) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

1. 不谋求对所投资企业的控股或者进行直接管理；
2. 所有参与均在合法合规的前提下维护基金投资人利益并谋求基金资产的保值和增值。

### (十) 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定，于2010年5月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止至2009年12月31日（“报告期末”）。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,727,212,122.10	91.41
	其中：股票	6,727,212,122.10	91.41
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-

4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	532,346,857.71	7.23
6	其他资产	99,607,614.83	1.35
7	合计	7,359,166,594.64	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	530,053,021.16	7.24
C	制造业	3,283,121,219.49	44.83
C0	食品、饮料	304,542,596.36	4.16
C1	纺织、服装、皮毛	149,891,776.08	2.05
C2	木材、家具	37,492,683.30	0.51
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	623,831,746.97	8.52
C5	电子	171,447,746.33	2.34
C6	金属、非金属	597,810,757.98	8.16
C7	机械、设备、仪表	888,488,972.55	12.13
C8	医药、生物制品	503,602,354.56	6.88
C99	其他制造业	6,012,585.36	0.08
D	电力、煤气及水的生产和供应业	55,596,788.65	0.76
E	建筑业	177,616,832.04	2.43
F	交通运输、仓储业	171,774,873.08	2.35
G	信息技术业	756,742,619.23	10.33
H	批发和零售贸易	140,603,872.50	1.92
I	金融、保险业	782,624,180.52	10.69

J	房地产业	266,655,648.31	3.64
K	社会服务业	172,886,600.15	2.36
L	传播与文化产业	126,253,784.78	1.72
M	综合类	263,282,682.19	3.60
	合计	6,727,212,122.10	91.87

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600415	小商品城	4,095,553	183,194,085.69	2.50
2	601166	兴业银行	4,179,233	168,464,882.23	2.30
3	600143	金发科技	14,643,676	154,783,655.32	2.11
4	600000	浦发银行	6,900,000	149,661,000.00	2.04
5	600585	海螺水泥	3,000,000	149,580,000.00	2.04
6	000983	西山煤电	3,714,557	148,173,678.73	2.02
7	600893	航空动力	5,600,000	145,544,000.00	1.99
8	601318	中国平安	2,599,946	143,231,025.14	1.96
9	000712	锦龙股份	6,609,708	141,447,751.20	1.93
10	000063	中兴通讯	2,999,948	134,607,666.76	1.84

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-

8	合计	-	-
---	----	---	---

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产的构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,401,517.65
2	应收证券清算款	77,405,138.84
3	应收股利	-
4	应收利息	136,257.72
5	应收申购款	16,664,700.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,607,614.83

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000712	锦龙股份	141,447,751.20	1.93	临时停牌, 召开股东大会

## 第十一节 基金的业绩

基金业绩截止日为 2009 年 12 月 31 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

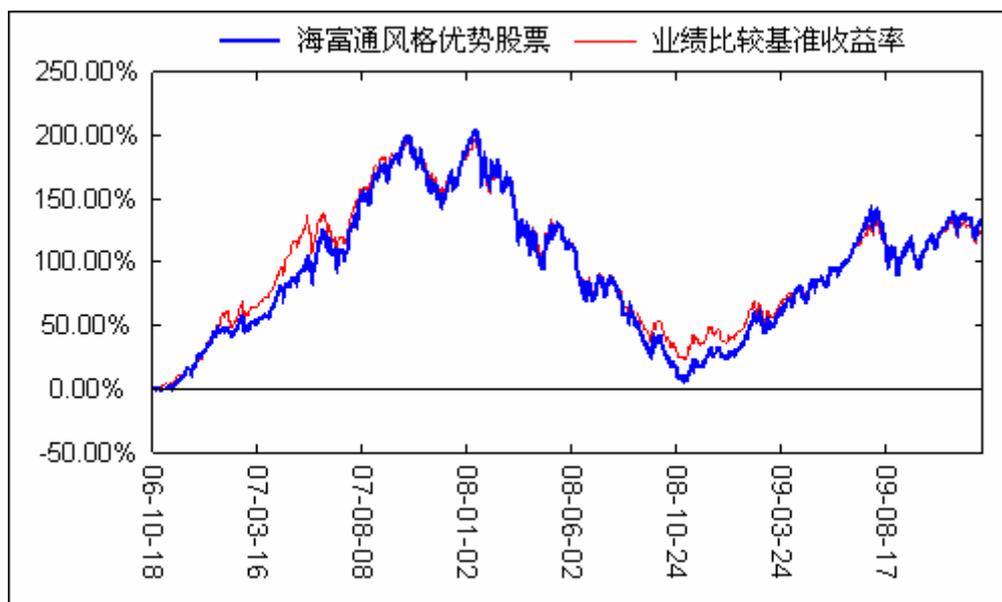
## (一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准标准差(4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2006年10月19日(基金合同生效日)-2006年12月31日	34.80%	1.27%	36.29%	1.09%	-1.49%	0.18%
2007年1月1日-2007年12月31日	111.65%	1.79%	106.20%	1.74%	5.45%	0.05%
2008年1月1日-2008年12月31日	-56.27%	2.45%	-51.83%	2.21%	-4.44%	0.24%
2009年1月1日-2009年12月31日	87.67%	1.80%	68.07%	1.52%	19.60%	0.28%
2006年10月19	134.16%	2.02%	127.54%	1.83%	6.62%	0.19%

日(基金合同生效日)-2009年12月31日					
------------------------	--	--	--	--	--

(二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:

2006年10月19日至2009年12月31日



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)、(六)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

## 第十二节 基金的财产

### (一) 基金资产总值

本基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### (二) 基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户,以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管

理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### **（四）基金财产的保管及处分**

1. 本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。

2. 基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。

3. 基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

4. 基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

5. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

### **第十三节 基金资产的估值**

#### **（一）估值目的**

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

#### **（二）估值日**

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

#### **（三）估值对象**

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

#### **（四）估值方法**

##### **1. 股票估值方法：**

(1) 上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易

的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

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市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2. 债券估值方法：

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

(3) 发行未上市债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，按成本进行后续计量；

(4) 在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，采用估值技术确定公允价值；

(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) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认

为按本项第(1) - (5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值,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;

(7) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

### 3. 权证估值方法:

(1) 基金持有的权证,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,按最近交易日的收盘价估值;

未上市交易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,按成本计量;

(2) 在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(3) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

4. 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。

5. 根据有关法律法规,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。

## (五) 估值程序

1. 基金份额净值是按照每个开放日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### **（六）暂停估值的情形**

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
4. 中国证监会认定的其它情形。

#### **（七）基金份额净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

#### **（八）估值错误的处理**

基金管理人、基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后三位以内(含第三位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1. 差错类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规

定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担

了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1)查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4)根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1)基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

(3)因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 第十四节 基金的收益与分配

### (一) 基金收益的构成

1. 买卖证券差价；
2. 基金投资所得红利、股息、债券利息；
3. 银行存款利息；

4. 已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

## （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

## （三）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. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
3. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；本基金收益每年最多分配 6 次，单次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；
4. 本基金收益分配方式分为两种：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权益登记日经除息后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式为现金分红；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响。
5. 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
6. 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

## （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资

金的划付。

### （五）基金收益分配中发生的费用

1. 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或其他公告中列示。

2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按权益登记日经除息后的基金份额净值自动转为基金份额。

## 第十五节 基金的费用和税收

### （一）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. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （二）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 2、基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、上述（一）中 3 到 8 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## （三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间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；基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

## （四）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在指定媒体上刊登公告。

## （五）税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第十六节 基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效不足2个月，可以并入下一个会计年度；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金年度审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定2日内在中国证监会指定媒体上公告。

## 第十七节 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
2. 对证券投资业绩进行预测;
3. 违规承诺收益或者承担损失;
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构;
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
6. 中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括:

#### (一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后,基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

#### (二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前,将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

### (三) 基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

### (四) 基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

### (五) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2. 基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发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；

3. 基金管理人将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。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

### (六) 基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

### (七) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3. 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、

半年度报告或者年度报告；

#### (八) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

1. 基金份额持有人大会的召开；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
14. 重大关联交易事项；
15. 基金收益分配事项；
16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
18. 基金改聘会计师事务所；
19. 变更基金份额发售机构；
20. 基金更换注册登记机构；

21. 本基金开始办理申购、赎回；
22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 中国证监会规定的其他事项。

#### (九) 澄清公告

在基金合同存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

#### (十) 基金份额持有人大会决议

#### (十一) 中国证监会规定的其他信息

#### (十二) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后,将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点,供公众查阅。投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第十八节 风险揭示

### (一) 市场风险

基金主要投资于证券市场,而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动,从而导致基金收益水平发生变化,产生风险。主要的风险因素包括:

1. 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化,导致市场价格波动,影响基金收益而产生风险。

2. 经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3. 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4. 上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5. 购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

## **(二) 信用风险**

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

## **(三) 管理风险**

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

## **(四) 流动性风险**

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资人的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础

上,通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制,但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

#### **(五) 操作和技术风险**

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中,可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险,如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外,在开放式基金的后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

#### **(六) 合规性风险**

指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### **(七) 模型风险**

指在估计资产价值、市场分析和风险估计中采用了错误的估计方法或选择了不恰当的模型而导致投资结果不确定风险。

#### **(八) 其他风险**

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险;

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险;

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,可能严重影响证券市场运行,导致基金资产损失;

4、其他意外导致的风险。

## **第十九节 基金的终止和清算**

### **(一) 基金的终止**

有下列情形之一的,基金合同经中国证监会核准后将终止:

(1) 基金份额持有人大会决定终止的;

(2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;

(3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

(4) 基金合并、撤销；

(5) 中国证监会允许的其他情况。

## (二) 基金的清算

### 1. 基金财产清算小组

(1) 基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金清算公告；

(1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2) 对基金财产进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估价和变现；

(4) 聘请律师事务所出具法律意见书；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(6) 将基金清算结果报告中国证监会；

(7) 参加与基金财产有关的民事诉讼；

(8) 公布基金财产清算结果；

(9) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

- (2) 交纳所欠税款;
- (3) 清偿基金债务;
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告; 清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

#### 6. 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。

## 第二十章 基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人权利与义务

#### 1.1 基金份额持有人的权利

1. 分享基金财产收益;
2. 参与分配清算后的剩余基金财产;
3. 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
7. 监督基金管理人的投资运作;
8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 1.2 基金份额持有人的义务

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4. 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法权益的活动；
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## **(二) 基金管理人的权利与义务**

### **2.1 基金管理人的权利**

1. 依法募集基金，办理基金备案手续；
2. 自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产；
3. 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；
4. 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
5. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
6. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
7. 根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
8. 在法律法规规定、基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
9. 自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10. 选择、更换销售代理机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其

行为进行必要的监督和检查；

11. 依据法律法规和基金合同的规定，决定基金收益分配方案；
12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13. 依法召集基金份额持有人大会；
14. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
15. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2.2 基金管理人的义务

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7. 依法接受基金托管人的监督；
8. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和转换价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12. 编制中期和年度基金报告；
13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义

务；

14. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

15. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

16. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

17. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

18. 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

19. 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

20. 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

21. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

22. 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

23. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

24. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

25. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册相关资料；

26. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

27. 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

28. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### （三）基金托管人的权利与义务

#### 3.1 基金托管人的权利

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3. 自基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5. 根据法律法规及基金合同及有关规规定监督基金管理人，对于基金管理人违反有关法律法规或基金合同规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的行为，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6. 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

7. 按规定取得基金份额持有人名册；

8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 3.2 基金托管人的义务

1. 安全保管基金财产；

2. 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3. 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7. 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

8. 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行

基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

9. 按照规定保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17. 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
18. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
19. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
20. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
21. 根据基金合同和托管协议的规定，建立并保存基金份额持有人名册；
22. 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
23. 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；
24. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### **（四）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

##### **A. 召开事由**

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：
  - (1) 终止基金合同；
  - (2) 转换基金运作方式；

- (3) 变更基金类别;
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序;
- (6) 更换基金管理人;
- (7) 更换基金托管人;
- (8) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
- (9) 本基金与其他基金的合并;
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的, 可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用;
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- (6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## **B. 召集方式**

1. 除法律法规或基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集, 开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集。

2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有

人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

### C. 通知

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表

决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

3. 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不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。

#### **D. 会议的召开方式**

##### **1. 会议方式**

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人的更换、提前终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### **2. 召开基金份额持有人大会的条件**

###### **(1) 现场开会方式**

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

###### **(2) 通讯开会方式**

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上；

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## **B. 议事内容与程序**

### **1. 议事内容及提案权**

(1) 议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交

大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔应不少于 6 个月。法律法规规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金分额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，形成大会决议。

大会由大会召集人的授权代表主持。如召集人为基金份额持有人，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。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) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3. 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。

## F. 表决

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列 (2) 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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

4. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5. 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。

## G. 计票

### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

(3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主

持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4) 基金管理人或基金托管人拒派代表参加基金份额持有人大会，或者拒不配合监票的，不影响计票的效力。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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（如果基金托管人为召集人，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。

如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序；如基金托管人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序。基金管理人或托管人不派监督计票的，不影响计票效力。

## H. 生效与公告

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2. 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。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定。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 3 日内在至少一种指定媒体公告。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。

## （五）基金合同解除和终止的事由、程序

### 1) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

(3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

(4) 基金合并、撤销；

(5) 中国证监会允许的其他情况。

## 2) 基金的清算

### 1. 基金财产清算小组

(1) 基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金清算公告；

(1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2) 对基金财产进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估价和变现；

(4) 聘请律师事务所出具法律意见书；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(6) 将基金清算结果报告中国证监会；

(7) 参加与基金财产有关的民事诉讼；

(8) 公布基金财产清算结果；

(9) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

- (2) 交纳所欠税款;
- (3) 清偿基金债务;
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告; 清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

#### 6. 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。

### (六) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议, 基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的, 对各方当事人均有约束力, 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。

基金合同受中国法律管辖。

### (七) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册, 供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅, 但其效力应以基金合同正本为准。

## 第二十一节 基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1.1 基金管理人

名称: 海富通基金管理有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

邮政编码:200120

法定代表人:邵国有

成立时间:2003年4月18日

批准设立机关:中国证监会

批准设立文号:中国证监会证监基字[2003]48号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.5亿元人民币

存续期间:持续经营

## 1.2 基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码:100033

法定代表人:郭树清

成立日期:2004年09月17日

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间:持续经营

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保管箱服务;经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## (二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 2.1 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(A) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资

范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查

根据本基金的基金合同的规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

(B) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。监督内容包括基金合同约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例符合法律法规规定及基金合同约定的时间要求、法律法规允许的基金投资比例调整期限等。

基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的百分之十；

(2) 进入全国银行间同业市场的债券回购的资金余额不得超过基金净资产的百分之四十；

(3) 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；

(4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

(5) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述(1)、(2)、(4)项投资组合限制的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。

(C) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

(D) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新, 如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单, 应向基金托管人说明理由, 在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制, 按银行间债券市场的交易规则进行交易, 基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督, 交易对手不履行相关合同造成的损失, 基金托管人不承担任何损失和责任。

(E) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 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。

(F) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定, 应及时以书面形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。基金管理人收到通知后应在下一工作日前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。

(G) 对基金托管人按照法规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。

(H) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为, 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、阻挠对方根据本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。

## 2.2 基金管理人 对基金托管人的业务核查

(A) 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查, 核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(B) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时, 应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函, 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, 基金管理人有权随时对通知事项进行复查, 督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为, 包括但不限于: 提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性, 在规定时间内答复基金管理人并改正。

(C) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知基金托管人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由, 拒绝、阻挠对方根据本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, 情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的, 基金管理人应报告中国证监会。

### **(三) 基金财产的保管**

#### **3.1 基金资产保管的原则**

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人根据基金管理人的指令, 按照基金合同和本协议的约定保管基金财产, 如有特殊情况双方可另行协商解决。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 到账日基金财产没有到达基金账户的, 基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的, 基金管理

人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### **3.2 基金募集期间及募集资金的验资**

1. 基金募集期间所募集的资金应存于中国证券登记结算有限责任公司的基金募集专户。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金从基金管理人的清算户划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### **3.3 基金资金账户的开立和管理**

1. 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### **3.4 基金证券账户的开立和管理**

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得

使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责, 账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

### **3.5 债券托管专户的开设和管理**

基金合同生效后, 基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定, 在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

### **3.6 其他账户的开立和管理**

1. 因业务发展需要而开立的其他账户, 可以根据法律法规和基金合同的规定, 由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的, 从其规定办理。

### **3.7 基金财产投资的有关有价凭证等的保管**

基金财产投资的银行间市场凭证等的保管按照实物证券相关规定办理。

### **3.8 与基金财产有关的重大合同的保管**

基金合同和托管协议由基金管理人和基金托管人各自保管原件。在基金运作中签订的重大合同, 包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同由基金管理人保管。上述重大合同的保管期限应不低于法律法规及行业的有关规定。

## **(四) 基金资产净值计算与复核**

### **1. 基金资产净值**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数, 基金份额净值的计算, 精确到 0.001 元, 小数点后第四位四舍五入, 国家另有规定的, 从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值, 并按规定公告。

### **2. 复核程序**

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后, 将基金份额净值结果发送基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规,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。

#### **(五) 基金份额持有人名册的保管**

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册,保存期不少于15年。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

在编制半年报和年报前,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,并保证其真实性、准确性和完整性,由基金托管人按相关规定负责保管。

#### **(六) 争议解决方式**

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### **(七) 托管协议的修改与终止**

(1) 本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

(2) 基金托管协议终止出现的情形:

1. 基金合同终止;
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 第二十二节 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### (一) 资料寄送服务

#### 1. 账户确认书

根据客户的需要,为客户寄送开放式基金账户确认书。如客户需要开放式基金账户的主账户卡,根据中国证券登记结算公司的业务规则到它指定的券商营业网点打印。

#### 2. 对账单

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。

季度对账单在每季结束后的 15 个工作日内向有交易的持有人寄送,年度对账单在每年度结束后 15 个工作日内对所有持有人寄送。

对账单的寄送方式分为邮寄和电子邮件两种方式。如客户需要重置寄送方式或寄送频率,请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

#### 3. 其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

### (二) 基金间转换服务

投资人可在基金管理人管理的不同开放式基金间按照基金间的转换费率转换基金份额。

### (三) 定期投资计划

在技术条件成熟时,基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划,投资人可以通过固定的渠道,定期申购基金份额。该定期投资计划的有关规则另行公告。

### (四) 网络在线服务

通过基金公司网站的留言板和客服信箱,客户可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息,投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

我们为现有投资人提供了基金账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式或

频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址: <http://www.hftfund.com>

电子信箱: [info@hftfund.com](mailto:info@hftfund.com)

### **(五) 信息定制服务**

在技术条件成熟时,基金管理人还可为基金客户提供通过基金管理公司网站、客户服务中心提交信息定制申请,基金管理公司通过手机短讯、E-MAIL 定期为客户发送所定制的信息,内容包括:每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

### **(六) 客户服务中心 (CALL-CENTER) 电话服务**

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询,在正常交易时间提供针对直销客户的电话委托下单服务。

呼叫中心人工座席每个交易日上午 9:00-11:30,下午 13:00-17:30 为投资人提供服务,投资人可以通过该热线获得业务咨询,信息查询,服务投诉,信息定制,资料修改等专项服务。

每个周五下午 15:30-17:30,基金经理或投资顾问定期通过呼叫中心与投资人进行交流,就投资人关心的基金投资运作情况、市场走势、宏观经济等问题进行解答。

客服电话: 40088-40099 (免长途话费)

传真: 021-50479997

### **(七) 投诉受理**

投资人可以拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式,对基金公司和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉,原则上是及时回复,对于不能及时回复的投诉,我们承诺在两个工作日之内对您的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉,我们将在顺延的工作日当日进行回复。

### **(八) 网上开户与交易服务**

2005 年 10 月 28 日,海富通基金管理有限公司与银联电子支付服务有限公司合作正式推出网上交易平台,为投资者提供方便快捷的网上在线开户交易服务,

中国银联客户可以通过海富通基金网站实现网上开户和交易。(包括认购、申购、赎回等)。

目前,对持有建设银行龙卡、兴业银行兴业卡、浦发银行东方卡、中信银行卡、农业银行金穗卡或其他银联通网上交易支持的银行卡的投资者通过本公司网上交易系统认购、申购本公司旗下开放式基金实行费率优惠,具体优惠政策如下:

1、对于持有建设银行龙卡的投资者:

(1) 对于持有建设银行龙卡的投资者申购费率标准如下:

基金名称	申购金额(M)(单位:元)	优惠费率
海富通风格优势股票	M < 50万	1.2%
	50万 ≤ M < 100万	0.96%
	100万 ≤ M < 200万	0.8%
	200万 ≤ M < 500万	0.6%
	M ≥ 500万	按笔收取, 1000元/笔

(2) 投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额(A级基金代码:519505, B级基金代码:519506)转换为本基金的,统一按上述1(1)中列示的申购费率标准收取申购补差费。

2、对于持有农业银行金穗卡的个人投资者:

(1) 对于持有农业银行金穗卡的投资者申购费率标准如下:

基金名称	申购金额(M)(单位:元)	优惠费率
海富通风格优势股票	M < 50万	1.05%
	50万 ≤ M < 100万	0.84%
	100万 ≤ M < 200万	0.7%
	200万 ≤ M < 500万	0.6%
	M ≥ 500万	按笔收取, 1000元/笔

(2)投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额(A级基金代码: 519505, B级基金代码: 519506)转换为本基金的, 统一按上述2(1)中列示的申购费率标准收取申购补差费。

3、对于持有兴业银行兴业卡、浦发银行东方卡、中信银行中信卡或其他银联网上交易支持的银行卡的投资者:

(1) 申购费率标准如下:

基金名称	申购金额(M)(单位: 元)	优惠费率
海富通风格优势股票	M < 500 万	0.6%
	M ≥ 500 万	按笔收取, 1000 元/笔

(2)投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额(A级基金代码: 519505, B级基金代码: 519506)转换为本基金的, 统一按上述3(1)中列示的申购费率标准收取申购补差费。

## 第二十三节 其他披露事项

### (一) 基金注册登记机构

#### 1. 委托与更换程序

基金管理人委托中国证监会认定的机构办理本基金的注册登记业务。基金管理人委托上述机构办理登记业务, 应与其签订委托代理协议, 以明确基金管理人与其在投资人基金账户管理、基金份额登记过户、基金清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务, 保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

注册登记机构的更换程序:

(1) 提名: 由基金管理人提名。

(2) 核准: 新任注册登记机构报中国证监会审查资格并核准后, 原任注册登记机构方可退任;

(3) 公告：基金注册登记机构更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

(4) 交接：原基金注册登记机构应做出处理基金注册登记事务的报告，并与新任基金注册登记机构完成业务移交手续，向新任基金注册登记机构提交完整的书面材料和电子数据；新任基金注册登记机构与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金注册登记机构仍有义务保留本基金正式移交日之前的注册登记业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金注册登记机构处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金注册登记机构业务移交产生的问题，原基金注册登记机构仍有协助解决之义务。

**2. 基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的注册登记手续。**

### **3. 基金注册登记机构概况**

基金注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：金颖

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证券监督管理委员会批准，在国家工商行政管理局注册登记的中国唯一的证券登记结算机构。由上海证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

(1) 证券账户和结算账户的设立和管理；

- (2) 证券登记与过户;
- (3) 证券托管与转托管;
- (4) 证券和资金的清算与交收;
- (5) 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务;
- (6) 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

## **(二) 关于调整基金持有的长期停牌股票估值方法的说明**

为保护投资者的利益,根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(第[2008]38号)和基金合同的相关约定,海富通基金管理有限公司经和本基金基金托管人协商一致,决定自2008年9月16日起采用《中国证券业协会基金估值小组关于停牌股票估值的参考方法》中的“指数收益法”,以停牌股票对应的交易所公布的行业指数对本基金持有的停牌股票进行估值。

## **第二十四节 招募说明书的存放及查阅方式**

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人和销售机构的办公场所和营业场所,在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。

## **第二十五节 备查文件**

备查文件等文本存放在基金管理人和销售机构的办公场所和营业场所,在办公时间内可供免费查阅。

- (一) 中国证监会批准海富通风格优势股票型证券投资基金设立的文件
- (二) 《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《海富通风格优势股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 海富通基金管理有限公司募集设立海富通风格优势股票型证券投资基金的法律意见书
- (七) 《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(八) 中国证监会要求的其他文件