

# 海富通精选证券投资基金更新招募说明书

(2011 年第 2 号)

**基金管理人：海富通基金管理有限公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

## 重要提示

海富通精选证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2003 年 7 月 9 日出具的《关于同意海富通精选证券投资基金设立的批复》（证监基金字【2003】85 号文）批准募集。本基金的基金合同于 2003 年 8 月 22 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《海富通精选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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、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，投资者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 2011 年 8 月 22 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 6 月 30 日。

# 海富通精选证券投资基金更新招募说明书

## 目 录

一、绪言.....	1
二、释义.....	1
三、基金管理人.....	5
四、基金托管人.....	13
五、相关服务机构.....	17
六、基金的募集.....	34
七、基金合同的生效.....	35
八、基金份额的申购与赎回.....	36
九、基金的转换.....	42
十、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押.....	45
十一、基金的投资.....	47
十二、基金的业绩.....	56
十三、基金的财产.....	58
十四、基金资产的估值.....	58
十五、基金的收益与分配.....	65
十六、基金的费用与税收.....	66
十七、基金的会计与审计.....	68
十八、基金的信息披露.....	69
十九、基金的风险揭示.....	72
二十、基金的终止与清算.....	74
二十一、基金合同的内容摘要.....	76
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	89
二十三、对基金份额持有人的服务.....	96
二十四、基金注册登记人.....	98
二十五、基金管理人和基金托管人的更换.....	99
二十六、招募说明书的存放及查阅方式.....	101
二十七、备查文件.....	101

## 一、绪言

本招募说明书依据《基金法》及其配套法规、本基金的基金合同以及其他法律法规编写。

本招募说明书阐述了海富通精选证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。本基金根据本招募说明书所载明的资料管理运作并交易。本招募说明书由海富通基金管理有限公司解释。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出任何解释或者说明。

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本基金合同的当事人,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。

## 二、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:	指海富通精选证券投资基金
基金合同或本基金合同:	指《海富通精选证券投资基金基金合同》及基金合同当事人对其不时作出的修订
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
《证券法》:	指1998年12月29日经第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订

《合同法》：指《中华人民共和国合同法》；

《基金法》：指 2003 年 10 月 28 经中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并公布，自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》

《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》

招募说明书：指《海富通精选证券投资基金招募说明书》及其每六个月的更新

托管协议：指基金管理人和基金托管人签订的《海富通精选证券投资基金托管协议》及对该协议的任何修订和补充

销售代理协议：指基金管理人与各基金代理销售机构签订的《海富通精选证券投资基金销售与服务代理协议》及对该等协议的任何修订和补充

基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的基金管理人、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：指交通银行

基金销售业务：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

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

直销机构: 指海富通基金管理有限公司

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: 指直销机构和代销机构

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;

注册登记业务: 指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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

注册登记人: 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。

个人投资者: 指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人

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或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织以及经中国证监会批准的合格境外机构投资者

投资者: 指个人投资者和机构投资者

基金份额持有人: 指依据基金合同、招募说明书取得基金份额的投资者

基金合同生效日: 指基金达到成立条件后,基金管理人宣告基金合同生效的日期

存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

申购：指在基金合同生效后投资者申请购买基金份额的行为

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某一基金（包括本基金）的基金份额转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（包括本基金）的基金份额的行为

工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

开放日：指为投资者办理基金申购、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）

巨额赎回：指基金单个开放日，基金赎回有效申请份额总数扣除申购有效申请份额总数后的余额超过上一日基金总份额的10%时的情形

元：指人民币元

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、银行存款利息及其他合法收入

基金资产总值：指基金购买的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款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

基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

基金账户：指注册登记人为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户

基金份额持有人服务：指基金管理人承诺为基金份额持有人提供的一系列服务

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，包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站及深圳证券交易所网站

不可抗力：指任何无法预见、无法克服并无法避免的事件或因素，包括但不限于：相关法律、法规和规定的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等

### 三、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

法定地址：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 1 日经中国证监会批准设立

注册资本：1.5 亿元

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 49%。

电话：021-38650999

联系人：包瑾

#### （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，比利时富通基金管理公司董事总经理，法国巴黎投资管理公司亚太区行政

总裁。

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。

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。

王明权先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任武汉市人民政府副市长、交通银行行长、副董事长、中国光大 (集团) 总公司董事长、党委书记。现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

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。现任富通银行香港分行行政总裁。

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 BCC 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月至2011年2月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。

丁俊先生，硕士。2002年7月至2006年4月就职于平安资产管理公司，曾任权益投资部研究主管，2006年4月加入海富通基金管理有限公司，任海富通精选混合基金和海富通风格优势股票基金基金经理助理，2007年8月起任海富通精选混合基金和海富通精选贰号混合基金基金经理。

本基金历任基金经理为郑拓，任职时间为2005年4月至2006年9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、 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、 编制季度、半年度和年度基金报告；
- 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、 中国证监会规定的其他职责。

### **(四) 基金管理人的承诺**

- 1、 基金管理人承诺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、 基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。
- 3、 基金管理人承诺不从事违反《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) 基金之间相互投资；
  - 2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
  - 3) 从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其他证券自营业务；
  - 4) 动用银行信贷资金从事基金投资；

- 5) 将基金资产用于非法抵押、担保、资金拆借或者贷款;
  - 6) 从事证券信用交易;
  - 7) 以基金资产进行房地产投资;
  - 8) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资;
  - 9) 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) 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) 进行内幕交易、操纵市场;
  - 12) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。
- 4、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;
  - 9) 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;
  - 10) 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;
  - 11) 贬损同行,以提高自己;
  - 12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

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

5、 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、 风险管理和内部控制的原则

风险管理和内部控制是指通过风险识别和风险评价, 并在此基础上优化组合各种风险管理技术以及组织制度和管理框架, 有效控制风险和妥善处理风险所致损失的后果, 以获得最大的安全保障。风险管理和内部控制遵循以下原则:

- 1) 全面性原则: 风险管理和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: 公司根据管理业务的需要设立保持相对独立的机构、部门和岗位, 并在相关部门建立防火墙; 公司设立独立的监察稽核部, 监察稽核部保持高度的独立性和权威性, 协助和配合督察长负责对公司各部门内部风险管理工作进行稽核和检查;
- 3) 审慎性原则: 内部管理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: 各种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。执行风险管理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：内部管理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：内部管理制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、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：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

## 2、风险管理和内部控制的组织体系

公司的风险管理和内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，实现对公司决策层到管理层和操作层的全面监督和控制，具体包括以下部分：

- 1) 董事会对风险管理和内部控制负最高责任。董事会认为必要时，可聘请公司外专业人士，组成专家顾问委员会，提供有关风险管理和内部控制的专业意见。
- 2) 董事会下设风险委员会，负责制定公司投资管理风险、运营风险、道德风险和其他风险的衡量标准，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策。风险委员会责成管理层制定相应的监测系统、防范措施、补救措施以及定期的风险控制报告。
- 3) 管理层设风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策，具体负责对各类风险的识别、拟定防范和控制的措施、收集分析各类数据进行监测反馈、实施各种必要的应急补救措施，并就风险的整体控制管理定期地向董事会风险委员会作出报告。
- 4) 业务部门依据风险管理委员会提出的方针和政策，结合本部门的业务特点具体制定部门作业流程和风险管理制度，并负责日常的风险管理，通过部门作业流程及风险管理制度的制定与执行，将风险控制在最小范围内。
- 5) 督察长和监察稽核部负责协助业务部门制定作业流程和制度，评价、监督、检查各部门内部控制制度的制定与执行情况，督察长负责对风险管理委员会的风险管理决策和公司各项风险管理制度的执行情况进行检查，向董事会风险委员会、董事会提交报告。督察长和监察稽核部还应

根据外部环境和公司新业务的开展提出风险管理的建议。

### 3、 风险管理和内部控制的制度

#### 1) 投资风险管理制度

基金投资风险管理的主要内容是对市场风险和流动性风险的管理。对市场风险的管理包括：建立完备的系统性风险预警和监控系统，对于一般系统性风险，由投资部在投资决策委员会制定的风险管理原则下按照谨慎原则积极防范，对于重大系统性风险，经公司风险管理委员会同意并授权后，对基金的投资策略作重大调整，同时做好与基金份额持有人、托管人和监管部门的沟通工作。对流动性风险的管理包括：建立评判和监测基金资产流动性的量化指标，建立使基金现金流出与资产流动性相匹配的系统，定期检查和分析基金投资组合的流动性。公司在尽可能的范围内运用数量化模型和计算机软件系统辅助管理基金资产的市场风险和流动性风险。

#### 2) 道德风险管理制度

道德风险分基金管理公司和公司员工两个层次。对公司道德风险的管理包括：设立独立董事，加强对公司高级管理人员任免、公司和基金审计事务等的监督；充分发挥监事会的监督职能；健全并严格执行公司有关关联交易的各项限制性措施和控制性程序。对员工道德风险的管理包括：教育员工熟悉和遵守员工守则；对照各部门的员工守则，定期、不定期检查员工具体执行情况；将员工守法情况和职业道德作为录用和提升的重要标准；对于基金经理，还实施承诺与质询制度、投资限制制度、谈话提醒制度和强制休假制度等。

#### 3) 操作风险管理制度

操作风险管理是指通过完善内部控制制度和合规检查制度、严格落实执行和定期安全检查，防范公司业务操作中因人为因素或管理系统设置不当造成操作失误所引致的风险。操作风险管理制度由一系列具体制度构成，包括：投资管理制度、集中交易制度、基础设施故障风险管理制度、信息披露制度、信息资料保全制度、保密制度、财务会计制度、电子信息系统控制制度、岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度和宣传制度等。

#### 4) 合规性风险管理制度

合规性风险管理制度通过对公司所有业务步骤中可能涉及基金份额持有人

利益的部分作出明确规定，以最大限度地保护基金份额持有人的合法权益，保证基金管理业务合规审慎进行。

#### 5) 稽核监察制度

公司实行独立的稽核监察制度，督察长和监察稽核部有权对公司所有工作部门、工作环节及员工遵守法律法规和公司规章的情况进行稽核监察，并提出改进建议。公司保证稽核监察工作的独立性和客观性。

#### 4、基金管理人关于风险管理和内部控制的声明

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风险管理和内部控制的披露真实、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。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：562.59亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志（The

Asset) “2010年全球最佳交易银行评选”中，交通银行荣膺“中国最具成长性现金管理银行”、“最佳次托管银行”两项大奖。英国《银行家》杂志2011年公布的全球1000家银行排名，交通银行以343.21亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行50强。截至2011年6月30日止，交通银行资产总额达到人民币4.34万亿元，实现净利润人民币263.96亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## (二) 主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理，2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

## (三) 基金托管业务经营情况

截止2011年6月末，交通银行共托管证券投资基金55只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精

选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国 50 混合、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票 (LOF)、万家公用事业行业股票 (LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证 50 指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证 100 指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国债券指数、博时深证基本面 200ETF 及联接、建信信用增强债券。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等 12 类产品，托管资产规模超过七千亿元。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的监控和管理，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### (二) 内部控制原则

1、全面性原则：通过各个处室自我监控和专门内控处室的风险监控的内部控制机制覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

2、独立性原则：交通银行资产托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金分别设置账户，独立核算，分账管理。

3、制衡性原则：贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各处室和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

4、有效性原则：在岗位、处室和内控处室三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流

程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

5、效益性原则：内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部内部风险控制制度》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》、《交通银行资产托管部监察守则》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行内部控制评审。

### 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

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时

通知基金管理人限期纠正。

#### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 五、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

总经理：田仁灿

成立时间：2003年4月18日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】48号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期间：持续经营

联系人：康旭

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、代销机构

（1）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

**(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

**(3) 中国建设银行股份有限公司**

地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

联系人：张静

网址：www.ccb.com

**(4) 中国工商银行股份有限公司**

地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：姜建清

客户服务中心电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

联系人：刘业伟

网址：www.icbc.com.cn

**(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：傅育宁

客户服务电话：95555

联系人：邓炯鹏

网址：www.cmbchina.com

**(6) 中国农业银行股份有限公司**

地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

传真：010-85109219

网址：www.abchina.com

**(7) 兴业银行股份有限公司**

地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

联系人：梁曦

网址：www.cib.com.cn

**(8) 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：肖遂宁

客户服务电话：95501

联系人：姜聃

网址：www.sdb.com.cn

**(9) 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

**(10) 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](http://www.spdb.com.cn)

**(11) 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：王巍、李博

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

**(12) 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

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

**(13) 广发银行股份有限公司**

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)

**(14) 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：95527

联系人：毛真海

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

**(15) 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.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

**(16) 华夏银行股份有限公司**

地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

联系人：黄滨

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

**(17) 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)

**(18) 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)

**(19) 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：万建华

客户服务电话：021-962588、400-8888-666

联系人：韩星宇

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

**(20) 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

**(21)** 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

**(22)** 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：林生迎

网址：www.newone.com.cn

**(23)** 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

**(24)** 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

网址：www.95579.com

**(25)** 华泰联合证券有限责任公司

地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

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

**(26) 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

**(27) 东方证券股份有限公司**

地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层

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16层到26层

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

**(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：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

**(30) 平安证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：4008816168

联系人：郑舒丽

网址：<http://stock.pingan.com/>

**(31) 财通证券有限责任公司**

地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

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)

**(32) 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：张智河

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)

**(33) 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：莫晓丽

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

**(34) 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：万鸣

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

**(35) 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)

**(36) 中信证券股份有限公司**

地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

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)

**(37) 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](http://www.bocichina.com.cn)

**(38) 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.csco.com.cn](http://www.csco.com.cn)

**(39) 中信金通证券有限责任公司**

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

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)

**(40) 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：武斌

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

**(41) 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：021-4961259

联系人：张同亮

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

**(42) 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)

**(43) 中航证券有限公司**

地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

电话：4008866567

联系人：余雅娜

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

**(44) 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：95578

联系人：陈琳琳

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

**(45) 德邦证券有限责任公司**

住所: 上海市福山路 500 号城建国际中心 26 层

法定代表人: 姚文平

客户服务电话: 4008888128

联系人: 罗芳

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

**(46) 宏源证券股份有限公司**

地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

法定代表人: 冯戎

客户服务电话: 4008-000-562

联系人: 李巍

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

**(47) 齐鲁证券有限公司**

地址: 山东省济南市经七路 86 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)

**(48) 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: 4008881888

联系人: 魏颖

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

**(49) 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：鲁雁先

网址：www.xcsc.com

**(50) 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

**(51) 中国建银投资证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-600-8008

联系人：刘毅

网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

**(52) 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)

**(53) 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：李微

网址：www.e5618.com

**(54) 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)

**(55)** 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)

**(56)** 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：4006666888

联系人：高峰

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

**(57)** 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：雷杰

客户服务电话：95571

联系人：彭博

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

**(58)** 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（福建省外请先拨0591）

联系人：张腾

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

**(59)** 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](http://www.dgzq.com.cn)

**(60) 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：杜庆平

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

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

**(61) 广州证券有限责任公司**

地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

法定代表人：刘东

客户服务电话：020-961303

联系人：林洁茹

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

**(62) 上海证券股份有限公司**

地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

客户服务电话：4008918918

联系人：陈翔

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

**(63) 大通证券股份有限公司**

地址：大连市沙河口区会展路 129 号

法定代表人：于宏民

客户服务电话：4008169169

联系人：谢立军

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

**(64) 江海证券股份有限公司**

地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

客户服务电话：400-666-2288

联系人：郭玲

网址：www.jhzq.com.cn

**(65) 山西证券股份有限公司**

地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张志国

网址：www.i618.com.cn

**(66) 国都证券有限责任公司**

地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

**(67) 东兴证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：崔海涛

客户服务电话：4008-888-993

联系人：黄英

网址：www.dxzq.net

**(68) 财富证券有限责任公司**

地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

电话：0731-84403360

传真：0731-84403330

联系人：朱友谊

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

**(69) 民生证券有限责任公司**

地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 层 16-18 层

法定代表人: 岳献春

客户服务电话: 4006198888

联系人: 赵明

网址: <http://www.msza.com/>

**(70) 华龙证券有限责任公司**

地址: 甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦四楼

法定代表人: 李晓安

客户服务电话: 4006898888

联系人: 李昕田

网址: <http://www.hlzqgs.com>

**(71) 英大证券有限责任公司**

地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人: 赵文安

客户服务电话: 4008698698

联系人: 王睿

网址: <http://www.ydsc.com.cn>

**(72) 中山证券有限责任公司**

地址: 深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人: 吴永良

客户服务电话: 4001022011

联系人: 李珍

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

**(73) 日信证券有限责任公司**

地址: 呼和浩特市新城锡林南路 18 号

法定代表人: 孔佑杰

客户服务电话: 010-88086830

联系人：陈韦杉

网址：www.rxzq.com.cn

**(74) 红塔证券股份有限公司**

地址：云南省昆明市北京路155号附一号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

客户服务电话：0871 - 3577888

联系人：刘晓明

网址：www.hongtastock.com

**(二) 注册登记人**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

电话：010-59378835

传真：010-59378907

联系人：任瑞新

**(三) 律师事务所**

名称：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) 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1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法人代表：杨绍信  
经办注册会计师：薛竞、金毅  
电话：(021) 23238888  
传真：(021) 23238800  
联系人：金毅

## 六、基金的募集

### (一) 基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字【2003】第 85 号文批准募集。

### (二) 基金存续期间：不定期

### (三) 基金类型：契约型开放式

(四) 募集方式：发行期内本基金管理人代销网点和直销中心将同时面向个人投资者和机构投资者发售本基金。

(五) 募集期限：自《招募说明书》公告之日起到基金合同生效日止，最长不超过 3 个月。本基金的实际募集期限为 2003 年 7 月 15 日至 2003 年 8 月 15 日。

(六) 募集对象：中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）。

(七) 募集场所：本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售。

### (八) 认购费率

认购本基金采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。前端认购费率按认购金额分档如下：

认购金额（含认购费）	前端认购费率
50 万元以下	1.2%
50 万元以上（含 50 万）	1.0%

### (九) 认购份额的计算

本基金采用金额认购方法，基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。前端认购时计算方法如下：

净认购金额=认购金额/(1+前端认购费率)

前端认购费用 = 净认购金额 × 前端认购费率

认购份额 = 净认购金额/基金份额面值

基金份额以四舍五入的方法保留到小数点后两位。

#### **(十) 投资人对基金份额的认购**

1、认购的时间安排、投资人认购应提交的文件和办理手续、认购的方式详见本基金发行公告。

2、基金认购期结束后，若基金合同生效，海富通基金管理有限公司注册登记中心在认购期结束后 30 日内为投资者寄送认购确认单，投资者也可以通过海富通基金管理有限公司直销柜台、客户服务中心或网上交易系统查询最终认购确认情况。

3、认购的限额：投资者在募集期内可以多次认购基金份额，已经受理的认购申请不得撤销。投资者在销售网点的单笔认购金额均不低于 1000 元；认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。

#### **(十一) 募集资金利息的处理方式**

募集资金利息在基金合同生效后归基金所有。

#### **(十二) 基金募集期间募集的资金存入专门帐户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用**

## **七、基金合同的生效**

#### **(一) 基金合同生效的条件**

基金募集期限届满具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

1、在募集期限内基金募集份额总额不少于两亿份，基金募集金额不少于两亿元人民币；

2、 基金份额持有人的人数不少于两百人；

基金备案获中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。

## **(二) 基金募集失败**

1、 募集期满，未达到基金合同生效条件，或募集期内发生使基金合同无法生效的不可抗力，则基金募集失败。

2、 本基金合同不生效时，基金管理人应承担全部募集费用，将已募集资金加计银行活期存款利息在募集期结束后30天内退还基金认购人。

3、 基金募集失败，基金管理人及托管人不得请求报酬。

## **(三) 本基金的基金合同已于2003年8月22日正式生效**

# **八、基金份额的申购与赎回**

## **(一) 申购与赎回的办理场所**

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。

投资者可在销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

## **(二) 申购与赎回的开放日及时间**

1. 本基金已于2003年10月10日起开始办理包括日常申购、赎回在内的日常交易业务。

### **2. 开放日及时间**

本基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。投资者在本基金合同约定办理时间之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

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具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

## **(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、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

4、场内申购需遵守《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）》及其相关的《实施细则》和《操作指引》。

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟须在新的原则实施前三个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

#### **（四） 申购与赎回的程序**

##### **1、 申购与赎回申请的提出**

基金投资者须按照销售机构的规定，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。

投资者提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### **2、 申购与赎回申请的确认与通知**

对投资者在T日规定时间内受理的申请，正常情况下，本基金注册登记人在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在T+2日到销售网点或销售机构规定的其他方式查询申购、赎回的确认情况。

##### **3、 申购与赎回款项支付的方式与时间**

申购采用全额缴款方式，投资者交付款项后，申购申请即为有效，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项本金将退还给投资者。

投资者赎回申请成功后，赎回款项将于T+7日内划入赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照基金合同及本招募说明书的有关规定处理。

#### **（五） 申购与赎回的限制**

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，且场内单次申购金额必须是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在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足1000份的，在赎回时需一次全部赎回。

- 3、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可以根据实际情况对以上限制进行调整并报中国证监会备案，最迟在调整生效前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## (六) 申购和赎回的数额和价格

### 1、 申购份额的计算

申购本基金采用前端收费模式，即在申购基金时缴纳申购费，计算方法如下：

净申购金额=申购金额/(1+前端申购费率)

前端申购费用 = 净申购金额 × 前端申购费率

申购份额 = 净申购金额/申购当日基金份额净值

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。

### 2、 赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额 = 赎回份数 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额以四舍五入的方法保留至小数点后二位。

### 3、 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

## (七) 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。基金赎回费用由赎回人承担，在扣除

必要的手续费后，赎回费余额不得低于赎回费总额的百分之二十五，并归入基金财产。

- 2、基金的申购与赎回费率不得超过法律法规规定的水平，实际执行的费率在招募说明书中进行公告。
- 3、本基金按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金申购费率结构如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
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、本基金赎回费率按持有期分档如下：

持有期	赎回费率
小于 6 个月	0.35%
6 个月（含）以上，1 年以下	0.18%
1 年（含）以上，2 年以下	0.09%
2 年（含）以上	0%

注：赎回费总额的 25% 归入基金资产

- 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、特定职业等的投资者或以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资者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者调低基金申购费率、赎回费率。

#### （八）申购与赎回的注册登记

- 1、投资者申购基金成功后，注册登记人在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

- 2、 投资者赎回基金成功后，注册登记人在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。
- 3、 基金管理人可在法律法规允许的范围内及技术条件允许的情况下，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 个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

#### **(九) 拒绝或暂停接受申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理**

- 1、 除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- 1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- 2) 证券交易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；
- 3) 基金资产规模过大，基金管理人无法找到合适的投资品种，或继续接受申购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；
- 4) 当基金管理人认为某笔申购申请会有损于其他基金份额持有人利益时，可拒绝该笔申购申请；
- 5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将全额退还给投资者。

- 2、 除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请：

- 1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2) 证券交易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；
- 3) 本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回；
- 4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

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。已接受的赎回申请，基金管理人将足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分根据基金管理人制定的处理办法在后续开放日予以兑付，并以后续开放日

的基金份额净值为依据计算赎回金额；投资者对未实现赎回部分的延迟赎回可以选择撤销。

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暂停接受基金申购或赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。

4、基金暂停申购、赎回，基金管理人应立即向中国证监会备案，并及时在至少一种指定媒体刊登公告。暂停期间结束、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日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前1个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回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；暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

## （十）巨额赎回的认定及处理

### 1、巨额赎回的认定

在基金单个开放日，基金赎回有效申请份额总数扣除申购有效申请份额总数后的余额超过上一日基金总份额的10%时，为巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请可能会对基金的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 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，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；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在 3 个工作日内通过至少一种指定媒体基金管理人的公司网站或代销机构公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；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，并应当在至少一种指定媒体上进行公告。

## 九、基金的转换

### （一）基金间转换

基金转换是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某一基金（包括本基金）的基金份额转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（包括本基金）的基金份额的行为。

### （二）基金转换申请人的范围

任何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基金销售代理人的代销网点进行。

### （四）基金转换受理时间

基金管理人自 2004 年 4 月 26 日开始推出基金的转换业务。

办理基金间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归入转出基金资产的比例，参见转出基金招募说明书规定。

(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基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销售代理人规定的手续，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 工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 工作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、基金投资者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 工作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：

1) 不可抗力；

- 2) 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；
- 3) 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；
- 4) 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，但基金管理人无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。

## 十、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

### (一) 非交易过户

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者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、强制执行，及基金注册登记人认可的其它

行为。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”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。
- 3、“遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；
- 4、“自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金份额因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金份额划转至另一方名下；
- 5、“分家析产”指原属家庭共有（如父子共有、兄弟共有等）的基金份额从某一家庭成员名下划转至其他家庭成员名下的行为；
- 6、“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；
- 7、“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转；
- 8、“资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金份额随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；
- 9、“机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金份额分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金份额分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；
- 10、“企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企业持有的基金份额直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金份额的划转；
- 11、“强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人

持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册与过户登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册与过户登记人申请办理。

## **（二）转托管**

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购基金份额，但在赎回的情况下，必须向原申购的销售机构申请办理相应部分基金份额的赎回手续。

投资者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。投资者于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，投资者可于T+2日起赎回该部分基金份额。

## **（三）冻结与质押**

基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。

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

# **十一、基金的投资**

## **（一）投资目标**

本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略，实施全程风险管理，在保证资产良好流动性的前提下，在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。

## **（二）投资理念**

发掘市场价格和价值之间的差异，将中国经济长期增长的潜力最大限度地转化为基金资产的长期增值。本基金认为，中国资本市场处于高速发展的早期阶段，市场成熟度和有效性较低，企业内在价值和市场价格之间存在较大差距有待发掘。本基金将依托国际专业研究支持平台与本土研究团队的智慧，深入把握世界经济和行业周期及国内经济、行业背景与变革、企业微观运行等因素，通过走访企业，取得第一手资料，识别风险，精选证券。

### （三）投资方向

本基金为混合型基金。投资方向限于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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 50%-80%，债券投资 20%-50%，权证投资 0-3%；本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金股票投资的主要对象分为两类：第一类是经过严格筛选、符合本基金选股标准的优质且价格合理的上市公司，这部分上市公司是本基金的重点投资对象；第二类是公司现状不理想但基本面将发生实质性变化，并且这些都尚未充分反映在股价中的上市公司。

### （四）投资策略

本基金的投资策略分两个层次：第一层次为适度主动的资产配置，以控制或规避市场系统性风险；第二层次为积极主动的精选证券，以分散或规避个券风险。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。

#### 1. 资产配置策略

本基金采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定量分析和定性分析，形成对不同市场的预测和判断，适度主动地动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的比例，以规避或控制市场系统性风险，提高基金收益率。

#### 2. 精选证券策略

##### （1）精选股票策略

本基金管理人基于对国际市场投资管理经验的认识和对中国证券市场的实证分析，建立了精选股票分析决策支持系统，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，从定价指标（“向后看”）和盈利预测指标（“向前看”）两个方面，以基本面分析为主要手段，重视取得第一手资料，识别和控制风险，积极主动精选个股。

##### （2）精选债券策略

本基金的债券投资对象包括国债、金融债、企业债（包括可转换债）和债券回购等。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，在市场创新和变化中寻找投资机会，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式，确定和构造合理的债券组合。

### 3. 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。

## （五）投资管理程序

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。具体的投资管理程序如下：

1. 投资部策略分析师、股票分析师、定息产品分析师、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. 投资策略月会决定基金的资产配置比例和股票、债券的投资重点等；

3. 投资每周例会根据投资策略月会的决定，结合市场和公司基本面的变化，决定具体的投资策略；

4. 基金经理依据策略分析师的宏观经济分析和策略建议、股票分析师的行业分析和个股研究、定息产品分析师的债券市场研究和券种选择、定量分析师的定量投资策略研究，结合本基金产品定位及风险控制的要求，在权限范围内制定具体的投资组合方案；

5. 基金经理根据基金投资组合方案，向集中交易室下达交易指令；

6. 集中交易室执行基金经理的交易指令，对交易情况及时反馈，对投资指令进行监督；

7. 基金经理对基金投资组合及资金运用情况进行跟踪，并根据市场变化、

实际交易情况及各分析师的追踪研究和建议，在权限范围内及时调整投资组合；

8. 定量分析师负责开发和完善内部风险控制系统，并完成有关投资风险监控报告；

9. 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作出调整。

## （六）业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准是 MSCI China A 指数，债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。

基金业绩比较基准 = 65% MSCI China A + 35% 上证国债

本基金管理人认为，本基金的业绩比较基准所引述 MSCI China A 指数和上证国债指数符合下列条件：

- 1、合理、透明，为广大投资者所接受；
- 2、有一定市场覆盖率，并且不易被操纵；
- 3、业绩基准的编制和发布有一定的历史；
- 4、业绩基准有较高的知名度和市场影响力。

## （七）投资限制

1、本基金的投资组合遵循以下限制：

- 1) 投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；
- 2) 持有一家上市公司的股票，市值不超过基金资产净值的 10%；
- 3) 投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%；
- 4) 投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的 50%、不高于基金资产净值的 80%；
- 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，不超过该证券的 10%；
- 6) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- 7) 运用基金财产进行权证投资时，不得有下列情形：
  - a) 在任何交易日买入权证的总金额，超过上一交易日基金资产净值

的千分之五。

- b) 持有的全部权证，其市值超过基金资产净值的百分之三。
  - c) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有同一权证的总和，超过该权证的百分之十
- 8) 法律、法规或中国证监会规定的其他限制。

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投资不符合上述规定比例的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

2、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金的基金财产不得用于下列投资或活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 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) 参与股票发行申购，所申报的金额超过基金的总资产，基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 9) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 10) 以基金资产进行房地产投资；
- 11) 通过关联交易、利益输送等损害基金份额持有人的利益；
- 12) 从事证券信用交易；
- 13) 法律、法规、中国证监会及本基金合同规定的其他行为。

#### (八) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

本基金管理人接受基金份额持有人的委托，履行法律、法规、中国证监会及基金合同规定的义务，代表基金对所投资公司行使股东权利，但不谋求对上市公司的控股和直接管理，不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益，恪尽职守、合法合规行使股东权利，充分维护基金份额持有人的利益。

### （九）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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于 2011 年 9 月 20 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至 2011 年 6 月 30 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	7,683,308,537.52	72.33
	其中：股票	7,683,308,537.52	72.33
2	固定收益投资	2,137,170,116.50	20.12
	其中：债券	2,137,170,116.50	20.12
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	490,000,855.00	4.61
	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	207,142,880.11	1.95
6	其他各项资产	104,458,041.14	0.98
7	合计	10,622,080,430.27	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	101,399,239.50	0.96
C	制造业	2,704,732,387.24	25.54
C0	食品、饮料	319,809,987.22	3.02
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	454,478,746.85	4.29
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	951,426,263.42	8.98
C7	机械、设备、仪表	758,616,219.29	7.16
C8	医药、生物制品	220,401,170.46	2.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	391,404,024.77	3.70
F	交通运输、仓储业	445,394,113.03	4.20
G	信息技术业	936,252,595.54	8.84
H	批发和零售贸易	787,902,497.98	7.44
I	金融、保险业	1,237,486,542.82	11.68
J	房地产业	901,604,101.64	8.51

K	社会服务业	117,120,000.00	1.11
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	60,013,035.00	0.57
	合计	7,683,308,537.52	72.54

### 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	601989	中国重工	50,000,451	689,506,219.29	6.51
2	600406	国电南瑞	18,000,761	653,427,624.30	6.17
3	600016	民生银行	96,000,028	550,080,160.44	5.19
4	600153	建发股份	50,000,404	445,003,595.60	4.20
5	000002	万科A	50,000,354	422,502,991.30	3.99
6	600585	海螺水泥	15,001,224	416,433,978.24	3.93
7	600309	烟台万华	17,999,986	336,779,738.06	3.18
8	600048	保利地产	30,000,082	329,700,901.18	3.11
9	000063	中兴通讯	10,000,883	282,824,971.24	2.67
10	601288	农业银行	80,000,984	224,002,755.20	2.11

### 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	220,645,116.50	2.08
2	央行票据	1,072,070,000.00	10.12
3	金融债券	844,455,000.00	7.97
	其中：政策性金融债	844,455,000.00	7.97

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,137,170,116.50	20.18

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	1001095	10央票95	6,000,000	583,980,000.00	5.51
2	1001060	10央票60	4,000,000	390,120,000.00	3.68
3	030201	03国开01	3,500,000	346,115,000.00	3.27
4	100231	10国开31	2,000,000	199,220,000.00	1.88
5	010203	02国债(3)	1,152,780	113,975,358.60	1.08

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) 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	4,252,178.07
2	应收证券清算款	59,498,618.44
3	应收股利	3,888,047.82
4	应收利息	32,662,877.77
5	应收申购款	4,156,319.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,458,041.14

(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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年6月30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。

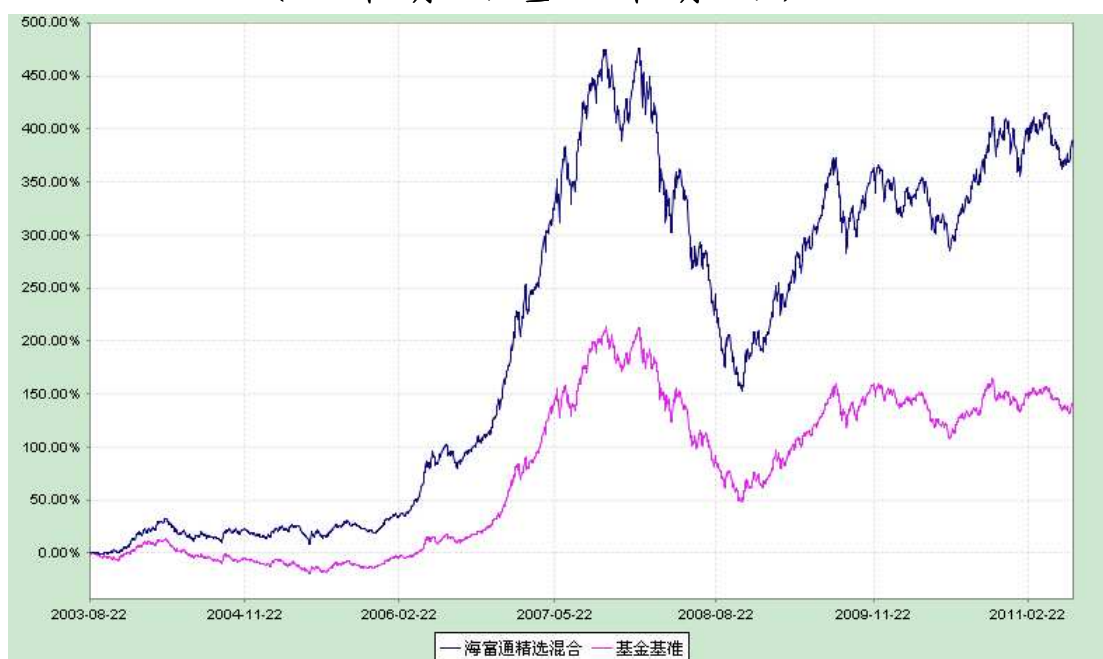
**(一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:**

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)	业绩比较基准收益率标准差 (4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2003年8月22日至	12.02%	0.56%	1.80%	0.72%	10.22%	-0.16%

2003年12月31日						
2004年1月1日至 2004年12月31日	4.50%	0.96%	-11.09%	0.87%	15.59%	0.09%
2005年1月1日至 2005年12月31日	8.48%	0.95%	-0.51%	0.89%	8.99%	0.06%
2006年1月1日至 2006年12月31日	118.08%	1.10%	75.60%	0.89%	42.48%	0.21%
2007年1月1日至 2007年12月31日	96.45%	1.63%	88.41%	1.53%	8.04%	0.10%
2008年1月1日至 2008年12月31日	-46.61%	1.97%	-45.76%	1.90%	-0.85%	0.07%
2009年1月1日至 2009年12月31日	56.02%	1.43%	57.89%	1.32%	-1.87%	0.11%
2010年1月1日至 2010年12月31日	8.72%	1.11%	-3.92%	1.01%	12.64%	0.10%
2011年1月1日至 2011年6月30日	-0.66%	1.02%	-1.86%	0.81%	1.20%	0.21%
自基金合同生效起 至今	389.39%	1.32%	140.55%	1.22%	248.84%	0.10%

## (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:

(2003年8月22日至2011年6月30日)



注: 按基金合同规定, 本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。本基金自2007年6月28日至2007年9月29日, 为持续营销后建仓期。建仓期满至今, 本基金投资组

合均达到本基金合同第十八条（三）、（六）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

## 十三、基金的财产

### （一）基金财产的构成

本基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款及其他投资等的价值总和。

### （二）基金财产的账户

本基金财产的账户，包括银行存款账户、证券交易清算备付金账户、证券账户、国债托管账户，法律法规另有规定的除外。本基金资产的账户由基金托管人按照有关规定开设，与基金管理人、基金托管人、销售机构、注册登记人自有的资产账户以及其他基金资产账户严格分开、相互独立。

### （三）基金财产的保管与处分

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。
- 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。
- 4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### （二）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

### （三） 估值对象

基金所持有的金融资产和承担金融负债。

### （四） 估值方法

#### 1、 股票估值方法

##### （1） 上市流通股票的估值

上市流通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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

##### （2） 未上市股票的估值

①首次发行的股票，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，按成本估值。

②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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

##### ④ 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第（1）条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第（1）条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第（1）条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$
（FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票

的市价； $D1$  为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数； $Dr$  为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天）。

## 2、债券估值办法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的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债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值：

(1) 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品

种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的,应对最近交易日的收盘价进行调整,确定公允价值进行估值。

(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) 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。

(4) 因持有股票而享有的配股权证,以配股除权日起到配股确认日止,若收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值,若收盘价低于配股价,则估值为零。

(5) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

#### 4、资产支持证券的估值方法

(1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,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) 全国银行间市场交易的资产支持证券,根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

#### 5、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

6、在任何情况下,基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如基金管理人认为上述估值方法对基金财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各因素的基础上,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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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,发现方应及时通知对方,以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值,以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### **（五） 估值程序**

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- （2）因不可抗力或其他情形致使基金管理人、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- （3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- （4）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；
- （5）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### **（七） 基金份额净值的确认和差错处理方式**

1.  $T$ 日基金份额净值 =  $T$ 日基金资产净值 /  $T$ 日基金总份额余额，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2. 当资产估值导致基金份额净值小数点后四位以内（不含本数）发生差错时，视为基金份额净值错误。基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误实际发生时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

### 3. 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、注册登记人、代销机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，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。

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无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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。

### 4. 差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

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；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，由此造成或扩大的损失有差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。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，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) 如果因基金管理人原因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，如果因基金托管人原因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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；

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、行政法规、本基金合同或其他规定，基金管理人或基金托管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，则基金管理人或基金托管人有权向出现差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。

#### 5. 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，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

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，需要修改基金注册登记人的交易数据的，由基金注册登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

#### (八) 特殊情形的处理

1. 基金管理人按(四)估值方法第 6 条进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2. 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管

人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十五、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

基金收益包括：

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。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照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

1. 每一基金份额享有同等分配权；
2. 基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；
3. 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
4. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
5. 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
6. 投资者可以选择现金分红或将所获红利再投资于本基金，如投资者未选择的，则默认方式为现金分红方式。如投资者选择采取红利再投资方式的，分红再投资部分以分红当日经除权后的基金份额净值为计算基准确定再投资份额；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；
7. 法律法规或监管机关另有规定的，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的范围、基金净收益、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（及有关手续费）等内容。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。

#### （五）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中规定。

2. 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记人可自动将该基金份额持有人的现金红利按分红登记日经除息后的基金份额净值转为基金份额。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

#### 1、与基金运作有关的费用

##### 1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算。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，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值

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，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3) 与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

## 2、与基金销售有关的费用

### 1) 申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

### 2) 赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

### 3) 转换费

本基金转换费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的转换”一章。

### 4) 销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费，用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

## 3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

## (二) 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资产的损失，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。

## (三) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告；此项调整无须召开基金份额持有人大会。

#### **（四） 基金的税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## **十七、 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基金会计责任人，基金管理人也可以委托基金托管人或具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务；

2. 基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；

3. 基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；

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. 基金管理人及基金托管人各自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. 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认；

8. 上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

### **（二） 基金的年度审计**

1. 基金管理人聘请具有证券从业资格的会计师事务所及其具有证券从业资格的注册会计师对基金年度财务报表进行审计；

2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人同意；

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，报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在5个工作日内公告。

## 十八、基金的信息披露

本基金的信息披露将严格按照《基金法》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》以及其它有关规定进行。应予披露的信息将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。

公开披露的基金信息包括:

- 1) 基金招募说明书;
- 2) 基金合同;
- 3) 基金托管协议;
- 4) 基金份额发售公告;
- 5) 基金募集情况;
- 6) 基金合同生效公告;
- 7) 基金资产净值、基金份额净值;
- 8) 基金份额申购、赎回价格;
- 9) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告;
- 10) 临时报告;
- 11) 基金份额持有人大会决议;
- 12) 基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动;
- 13) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 14) 澄清公告;
- 15) 中国证监会规定的其他信息。

### (一) 基金募集信息披露

- 1、 基金管理人应当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。
- 2、 本基金的基金合同生效后,基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的十五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。

## （二）基金运作信息披露

- 1、 基金管理人应当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。
- 2、 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。基金管理人应当在上述规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。
- 3、 基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，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。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。
- 4、 基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，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。
- 5、 基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，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。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。
- 6、 基金定期报告应当在公开披露的第二个工作日，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。
- 7、 基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两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。重大事件是指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下列事件：
  - 1) 基金份额持有人大会的召开；
  - 2) 提前终止基金合同；
  - 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百分之五十;
  - 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百分之三十;
  - 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百分之零点五;
  - 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) 开放式基金开始办理申购、赎回;
  - 22) 开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
  - 23) 开放式基金发生巨额赎回并延期支付;
  - 24) 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
  - 25) 开放式基金暂停接受申购、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。
- 8、 召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前三十日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。基金份额持有人依法自行召集持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。
- 9、 在基金合同期限内,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。

### （三）信息披露事务管理

- 1、基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。
- 2、基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。
- 3、招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。
- 4、基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以及基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

## 十九、基金的风险揭示

### （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）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。

## **（三）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。尽管本基金将坚持分散化投资和精选个股的原则，且基金管理人还将通过一系列措施加强对流动性风险的防范和控制，但不能保证完全避免此类风险。

此外，开放式基金在我国发展历史不长，在证券市场波动加剧时，基金投资者的赎回需求可能在短时间内大幅度增加，特别是可能发生巨额赎回的情形。我国股票市场在下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果这时出现较大规模的基金赎回申请，可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

## **（四）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。

### **（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份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记人、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）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。

## **二十、基金的终止与清算**

### **（一）基金的终止**

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

1. 存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人依照法律法规和本基金合同规定的程序宣布基金终止；

2. 基金经基金份额持有人大会表决终止的；

3. 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

4. 基金管理人职责终止，在六个月内没有新的基金管理人承接的；

5. 基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；

6. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

7. 法律、法规或中国证监会允许的其他情况。

基金终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金进行清算。

## **(二) 基金的清算**

### **1. 基金清算小组**

(1) 自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，清算小组必须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、由基金管理人选定的具有证券从业资格的注册会计师事务所、律师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在基金终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

(3) 基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

### **2. 清算程序**

- (1) 基金终止后，由基金清算小组统一接管基金资产；
- (2) 基金清算小组对基金资产进行清理和确认；
- (3) 对基金资产进行评估；
- (4) 对基金资产进行变现；
- (5) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (6) 公布基金清算公告；
- (7) 对基金资产进行分配。

### **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资产中支付。

### **4. 基金剩余资产的分配**

基金资产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；

(4) 按基金持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款(1)至(3)项规定清偿前,不分配给基金持有人。

## 5. 基金清算的公告

基金终止并报中国证监会核准后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;基金清算报告须经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案并公告。基金清算结果由基金清算小组于中国证监会批准3个工作日内公告。

## 6. 清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

# 二十一、基金合同的内容摘要

## (一) 基金份额持有人权利与义务

### 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) 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) 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;
- 8) 在不同的基金直销或代销机构之间转托管;
- 9) 要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制定的其他法律文件的规定履行其义务;
- 10) 法律、法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制定的其他法律文件规定的其他权利。

### 2、 基金份额持有人的义务

- 1) 遵守基金合同;
- 2) 缴纳基金认购、申购款项,承担基金合同规定的费用;

- 3) 以其对基金的投资额为限承担基金亏损或者终止的有限责任;
- 4) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动;
- 5) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## **(二) 基金管理人的权利与义务**

### **1、基金管理人的权利**

- 1) 自基金合同生效之日起,依照法律法规和本《基金合同》的规定独立运用和管理基金资产;
- 2) 遵照有关法律法规和本《基金合同》的规定,制订和调整开放式基金业务规则,决定基金的费率结构和收费方式;
- 3) 根据本《基金合同》获得基金管理费,收取或委托收取投资者申购费、赎回费及其他事先公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用;
- 4) 根据本《基金合同》的规定提议召开基金份额持有人大会;
- 5) 依据本《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反法律法规或本《基金合同》规定,并对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的,应呈报中国证监会和其他监管部门,并有权提议召开基金份额持有人大会,由基金份额持有人大会表决更换基金托管人,或采取其他必要措施保护基金投资者的利益;
- 6) 在基金托管人更换时,依据本《基金合同》的规定提名新的基金托管人;
- 7) 选择和更换基金代销机构,并对其基金代销业务行为进行必要的监督和检查;如果基金管理人认为代销机构的作为或不作为违反法律法规、本《基金合同》或基金代销协议的,基金管理人应行使法律法规、本《基金合同》或基金代销协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和采取救济措施,保护基金资产的安全和基金投资者的利益;
- 8) 选择和更换注册登记人,并对其注册登记代理行为进行监督;
- 9) 决定基金收益的分配方案;

- 10) 根据本《基金合同》的规定销售基金份额;
- 11) 代表基金对被投资公司依法行使股东权利;
- 12) 以基金的名义依法为基金进行融资,并以基金资产履行偿还融资和支付利息的义务;
- 13) 在法律法规和本《基金合同》规定的情形出现时,决定拒绝或暂停受理基金份额的申购、暂停受理基金份额的赎回;
- 14) 基金终止时,参加基金清算小组,参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 15) 法律法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## **2、基金管理人的义务**

- 1) 遵守本《基金合同》;
- 2) 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资产;
- 3) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金的投资、交易、销售和监察稽核,以专业化的经营方式管理和运作基金资产;
- 4) 建立健全内部风险控制、监察稽核、财务及人事管理等制度,确保所管理的基金资产和基金管理人的自有资产相互独立,确保所管理的不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立;
- 5) 接受基金托管人依据法律法规、本《基金合同》和托管协议进行的监督;
- 6) 依据法律法规和本《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会,执行基金份额持有人大会决议;
- 7) 按照法律法规和本《基金合同》的规定办理基金份额的认购、申购、赎回等业务和/或委托其他机构代理有关业务;
- 8) 按照法律法规及本《基金合同》的规定办理或委托其他机构办理基金的注册登记业务;
- 9) 负责为基金聘请注册会计师和律师;
- 10) 计算并公告基金资产净值及基金份额净值;

- 11) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规及本《基金合同》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；
- 12) 按照法律法规和本《基金合同》的规定，编制并公告基金季度报告、中期报告、年度报告等定期报告，履行信息披露及报告义务；
- 13) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- 14) 按规定向基金份额持有人分配基金收益；
- 15) 不谋求对基金资产所投资的公司控股和直接管理；
- 16) 除法律法规和本《基金合同》另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人管理、运作基金资产；
- 17) 因过错导致基金资产的损失，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- 18) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；
- 19) 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；
- 20) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 21) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；
- 22) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照本《基金合同》规定的时间和方式，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；
- 23) 法律法规和本《基金合同》规定的其他义务。

### **(三) 基金托管人的权利与义务**

#### **1、 基金托管人的权利**

- 1) 依法持有并保管基金的全部资产；
- 2) 依照本《基金合同》的规定获得基金托管费；
- 3) 监督基金的投资运作；
- 4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

- 5) 监督基金管理人, 如认为基金管理人违反了本《基金合同》的有关规定, 应呈报中国证监会和中国银监会, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;
- 6) 有权对基金管理人的违法、违规投资指令不予执行, 并向中国证监会报告;
- 7) 法律法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- 1) 遵守本《基金合同》;
- 2) 为基金份额持有人的最大利益处理基金事务; 保证恪尽职守依照诚实信用、勤勉尽责的原则, 谨慎、有效的持有并保管基金资产;
- 3) 设立专门的基金托管部门, 配备足够、合格的熟悉基金托管业务专职人员及符合要求的营业场所, 负责基金资产托管事宜;
- 4) 建立健全内部风险控制、监察稽核、财务及人事管理等制度, 确保基金资产的安全, 保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立; 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账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
- 5) 代表基金以基金的名义开设基金的证券账户、银行账户等基金资产账户, 严格执行基金管理人的投资指令, 认真办理基金投资的证券的清算交割及基金名下的资金往来;
- 6) 依法监督基金管理人的投资运作, 发现基金管理人的投资指令违法、违规的, 不予执行, 并向中国证监会报告;
- 7) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值;
- 8) 按规定制作相关账册并与基金管理人及时核对;
- 9) 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;
- 10) 采用适当、合理的措施, 使开放式基金份额的认购、申购、赎回等事项符合本《基金合同》等有关法律文件的规定;

- 11) 采取适当、合理的措施,使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合本《基金合同》等法律文件的规定;
- 12) 采用适当、合理的措施,使基金投资和融资的条件符合本《基金合同》等有关法律文件的规定;
- 13) 在基金定期报告内出具基金托管人意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本《基金合同》的规定进行;如果基金管理人未执行本《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;
- 14) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告,并报中国银监会和中国证监会;
- 15) 对基金商业秘密和基金份额持有人、投资者进行基金交易有关情况负有保密义务,不泄露基金投资计划、投资意向及基金份额持有人或投资者的相关情况及资料等;除法律、法规及本《基金合同》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) 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;
- 17) 按照有关规定,建立并保存基金份额持有人名册;
- 18) 按照有关规定,保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上;
- 19) 除法律法规及本《基金合同》另有规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金资产;基金托管人违反此义务,利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益,所得利益归于基金资产,造成基金资产损失的,承担赔偿责任;
- 20) 因过错导致基金资产的损失,应承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;
- 21) 基金管理人因过错造成基金资产损失的,基金托管人应为基金向基金管理人追偿;
- 22) 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中国银监会,并通知基金管理人;
- 23) 参加基金清算小组,参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分

配；

24) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

25) 法律法规和本《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或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

##### **1、 召开事由**

有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- 1) 修改基金合同，但本基金合同另有规定的除外；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 决定终止基金；
- 5) 与其他基金合并；
- 6) 转换基金运作方式；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 8) 基金管理人和基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 9) 代表基金份额百分之十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；
- 10) 中国证监会规定的其他情形。

##### **2、 召集方式**

- 1) 正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的开会时间、地点及权益登记日由基金管理人选择确定；
- 2) 在更换基金管理人、审议与基金管理人利益冲突的事项或基金管理人无法行使召集权的情况下，由基金托管人召集基金份额持有人大会；
- 3) 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十日内决定是否召集，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六十日内召

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；

- 4) 代表基金份额 10%以上（该比例以提出提议之时提请人所持有的基金份额与基金总份额之比例计算，下同）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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以自行召集基金份额持有人大会。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

### 3、 通知

召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前 30 天，在至少一种指定媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和方式；
- 2) 会议拟审议的事项；
- 3) 会议的议事程序以及表决方式；
- 4) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 5) 代理投票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；
- 6) 会务常设联系人姓名、电话；
- 7) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续。

采取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、书面表决意见的寄交、收取方式和截止时间。

#### 4、会议的召开方式

会议的召开方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表百分之 50% 以上基金份额的持有人参加，方可召开。

1) **现场开会。**由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。

亲自出席会议者应持有基金份额的凭证，受托出席会议者应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应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

2) **通讯方式开会。**通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- a) 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；
- b) 召集人收到的出具书面表决意见书的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50% 以上；
- c) 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代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者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、本《基金合同》和会议通知的规定。

#### 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，如修改本《基金合同》、决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、与其

他基金合并、转换基金运作方式、提高基金管理人或基金托管人报酬以及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不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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日前 10 天公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 或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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交会议通知中所列出事项的临时提案，临时提案应当在大会召开日前 15 天提交召集人。

召集人对于基金管理人和基金托管人提交的临时提案应当在大会召开日前 10 天公告。

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：

- a) 关联性。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提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。
- b) 程序性。大会召集人可以对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。

对于召集人决定不提交基金份额持有人大会表决的提案，该提案的提案人可在本次持有人大会后按本《基金合同》的规定自行召集持有人大会。

## 2) 议事程序

### a) 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 7 款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以所代表的基金份额 50%以上多数（不含 50%）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。

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、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### b) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 6、 表决

- 1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。
- 2) 在现场开会之情形下，亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者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应符合法律、法规、本《基金合同》和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份额。
- 3) 在通讯开会之情形下，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代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者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应符合法律、法规、本《基金合同》和会议通知的规定，否则其所代表的表决权不计入有效表决权份额。
- 4) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

- a) 一般决议。一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上（不含 50%）基金份额持有人通过方为有效；除下列 b) 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。
- b) 特别决议。特别决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（不含 2/3）通过方可作出。更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、决定终止基金等重大事项必须以特别决议通过方为有效。
- 5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 6) 采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。
- 7) 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
  - a) 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，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。
  - b) 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。
  - c) 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，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。

## 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的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 8、 生效与公告

基金份额持有人表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五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。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起5个工作日内在至少一种指定媒体予以公告。

### (五) 基金合同解除和终止的事由、程序

出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后终止：

- 1) 存续期间内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元，基金管理人宣布本基金终止；
- 2) 基金经基金份额持有人大会表决终止；
- 3) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 4) 因重大违法行为，基金被中国证监会责令终止；
- 5) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 6) 法律法规或中国证监会允许的其他情况。

本基金终止后，须按法律法规和本基金合同对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告后本基金合同终止。

### (六) 争议解决方式

本基金合同受中国法律管辖。

本基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争

议应当通过友好协商或者调解解决,如经友好协商或者调解不能解决的,可向中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会,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。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

#### **(七) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

本基金合同可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人 and 注册登记机构办公场所查阅;投资者可以按工本费购买本基金合同的复制件或复印件,也可直接登录基金管理人的网站([www.hftfund.com](http://www.hftfund.com))进行查阅。本基金合同的正本存放在基金管理人、基金托管人的住所。

## **二十二、基金托管协议的内容摘要**

### **(一) 托管协议的当事人**

#### **1、基金管理人**

基金管理人名称: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

注册资本:1.5亿元

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

组织形式:有限责任公司

营业期限:持续经营

#### **2、基金托管人**

基金托管人名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

住所:上海市浦东新区银城中路188号(邮政编码:200120)

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号(邮政编码:200120)

法定代表人：胡怀邦

注册资本：562.59 亿元

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

## **(二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查**

### **1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查**

#### **1) 监督和检查内容**

根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》和有关证券法规的规定，对基金的投资范围、投资对象、基金投资、融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间市场行为、基金管理人选择存款银行、基金投资的其他方面、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认、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行为进行监督和核查。

#### **2) 处理方式和程序**

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正，并通知基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，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 10 个工作日内，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 10 个工作日内纠正的，基

金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

## 2、基金管理人对于基金托管人的业务监督和核查

### 1) 监督和检查内容

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对于基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于：基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户/证券账户和债券托管账户；是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值；是否根据基金管理人指令办理清算交收；如遇到问题是否及时反馈，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为；是否对非公开信息保密。

### 2) 处理方式和程序

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、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的，应及时以书面形式通知基金托管人在 10 个工作日内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在 10 个工作日内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在 10 个工作日内纠正。

### **(三) 基金资产的保管**

#### **1、 基金资产保管的原则**

(1) 基金托管人应安全保管基金财产。

(2) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(3) 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

(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和独立。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，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，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，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。

对于因为基金投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，基金托管人仅限于保管资产的行使依据及有关记录，由于该机构破产、疏忽、欺诈、故意不当以及其它违约行为给基金造成损失的，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。

#### **2、 基金成立时募集资金的验证**

基金募集期满之日起 10 日内，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，由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进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到

资金当日出具相关证明文件。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

(3) 本基金银行存款账户的开立和使用，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基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。

(4) 基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

(5) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

(6) 基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户，及时核查基金银行存款账户余额。

### 4、基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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和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。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金

从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### 5、 债券托管账户的开立和管理

(1) 募集资金经验资后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### 6、 基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### 7、 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时，应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同

的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

#### **(四) 基金资产净值计算与复核**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额后的价值。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。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，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核盖章后，将复核结果以加密传真通知基金管理人，由基金管理人对外公布。待条件成熟后，双方可协商采用电子对账方式。

#### **(五) 基金份额持有人名册的登记与保管**

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记人负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

#### **(六) 争议解决方式**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

### **(七) 托管协议的修改和终止**

1、 本协议相关各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。修改后的新协议，应报中国证监会核准。

2、 发生以下情况，本托管协议终止：

(1) 《基金合同》终止；

(2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

(3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

(4) 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## **二十三、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. 投资者对账单

基金投资者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以书面或电子文件形式寄送，年度对账单由注册登记人在每年度结束后 20 个工作日内对所有持有人以书面或电子文件形式寄送。

2. 其他相关的信息资料

介绍国内外金融市场动态、投资机会和投资产品等。

### **(二) 红利再投资服务**

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金，注册登记人将基金份额持有人所获红利按权益登记日的基金份额净值

自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### **（三） 基金间转换服务**

投资者可在基金管理人管理的不同开放式基金间转换基金份额。

### **（四） 定期投资计划**

基金管理人利用直销网点或代销网点为投资者提供定期投资的服务。通过定期投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期投资计划的有关规则详见基金管理人公告。

### **（五） 在线服务**

基金管理人利用自己的网站为基金投资者提供与基金经理（或投资顾问）的定期在线交流服务；基金管理人还提供网上交易服务，具体操作详见网上交易业务规则。

### **（六） 咨讯服务**

投资者如果想了解申购和赎回等交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，请拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或登录公司网站进行咨询、查询。

#### **1. 客户服务电话**

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

传真：021-50479997

#### **2. 互联网站**

公司网址：<http://www.hftfund.com>

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

### **（七） 投诉受理**

投资者可以拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或致函，投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

### **（八） 网上开户与交易服务**

基金管理人已开通网上交易平台，投资者可登陆海富通基金网站（[www.hftfund.com](http://www.hftfund.com)）实现网上开户和交易（包括认购、申购、定期定额申购、转换、赎回等），并获得申购费率和部分转换费率优惠。海富通网上交易支持工商银行、农业银行、建设银行、兴业银行、浦发银行、中信银行等银行的借记卡

及天天盈账户，具体的费率优惠标准请参见相关公告。基金管理人将依据业务发展状况，逐步增加网上交易支持的银行卡种，并以公告形式告知投资者。

## 二十四、基金注册登记人

### （一）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者基金账户管理、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，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

注册登记人的更换程序：

1. 提名：由基金管理人提名。

2. 批准：新任注册登记人报中国证监会审查资格并批准后，原任注册登记人方可退任；

3. 公告：基金注册登记人更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日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：原基金注册登记人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人完成业务移交手续，向新任基金注册登记人提交完整的书面材料和电子数据；新任基金注册登记人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，原基金注册登记人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人处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金注册登记人业务移交产生的问题，原基金注册登记人仍有协助解决之义务。

**（二）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业务。**

### （三）基金注册登记人概况

基金注册登记人：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：北京市西城区太平桥大街 17 号

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。

## 二十五、基金管理人和基金托管人的更换

### （一）基金管理人的更换

#### 1、基金管理人更换的条件

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- 1) 被依法取消基金管理资格；
- 2) 被基金份额持有人大会解任；
- 3) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 4) 法律法规规定的其他基金管理人职责终止的情形。

基金管理人职责终止时，应当依照基金合同的规定召开基金份额持有人

大会，更换新的基金管理人；新基金管理人产生前由中国证监会指定临时基金管理人。

## 2、基金管理人的更换程序

- 1) 提名：由基金托管人或由代表 10% 或以上基金份额的基金份额持有人提名新任基金管理人；
- 2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的基金管理人形成决议；
- 3) 批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任，原任基金管理人经中国证监会批准方可退任；
- 4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内在至少一种指定媒体予以公告。如果基金托管人和基金管理人同时更换，中国证监会不指定、且没有中国证监会认可的机构进行公告时，代表 10% 以上基金份额并且出席基金持有人大会的基金份额持有人有权按基金合同的规定公告基金持有人大会决议；
- 5) 交接：原基金管理人应作出处理基金事务的报告，并向新任基金管理人办理基金事务的移交手续；新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值；
- 6) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果基金管理人要求，基金托管人和新任基金管理人应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

## (二) 基金托管人的更换

### 1、基金托管人更换的条件

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- 1) 被依法取消基金托管资格；
- 2) 被基金份额持有人大会解任；
- 3) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 4) 法律法规规定的其他基金托管人职责终止的情形。

基金托管人职责终止时，应当依照基金合同的规定召开基金份额持有人大会，更换新的基金托管人；新基金托管人产生前由中国证监会指定临时基金托管人。

## 2、 基金托管人的更换程序

- 1) 提名：由基金管理人或由代表 10% 或以上基金份额的基金份额持有人提名新任基金托管人；
- 2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的基金托管人形成决议；
- 3) 批准：新任基金托管人经中国证监会和中国银监会审查批准方可继任，原任基金托管人经中国证监会和中国银监会批准方可退任；
- 4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会和中国银监会批准后 5 个工作日内在至少一种指定媒体予以公告。如果基金托管人和基金管理人同时更换，中国证监会不指定、且没有中国证监会认可的机构进行公告时，代表 10% 以上基金份额并且出席基金份额持有人大会的基金份额持有人有权按基金合同的规定公告基金份额持有人大会决议。
- 5) 交接：原基金托管人应作出处理基金事务的报告，并与新任基金托管人进行基金资产移交手续；新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

## 二十六、 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、基金托管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。投资者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。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 二十七、 备查文件

(一) 本招募说明书的备查文件包括：

- 1、 中国证监会批准海富通精选证券投资基金设立的文件
- 2、 《海富通精选证券投资基金基金合同》
- 3、 注册登记协议
- 4、 《海富通精选证券投资基金托管协议》

- 5、 海富通基金管理有限公司募集设立海富通精选证券投资基金的法律意见书
- 6、 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、 基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、 《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(二) 备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。