

华夏希望债券型证券投资基金  
招募说明书（更新）

2008 年第 1 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

华夏希望债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2008年1月21日证监许可[2008]114号文核准募集。本基金基金合同于2008年3月10日正式生效。

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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，某一基金的特定风险等。华夏希望债券型证券投资基金是债券基金，风险低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎作出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2008年9月10日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年6月30日（财务数据未经审计）。

## 目录

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 一、绪言.....                  | 1   |
| 二、释义.....                  | 1   |
| 三、基金管理人.....               | 5   |
| 四、基金托管人.....               | 10  |
| 五、相关服务机构.....              | 13  |
| 六、基金的募集.....               | 35  |
| 七、基金合同的生效.....             | 35  |
| 八、基金份额的申购、赎回与转换.....       | 35  |
| 九、基金的投资.....               | 45  |
| 十、基金的业绩.....               | 54  |
| 十一、基金的融资、融券.....           | 54  |
| 十二、基金的财产.....              | 54  |
| 十三、基金资产的估值.....            | 55  |
| 十四、基金的收益与分配.....           | 59  |
| 十五、基金的费用与税收.....           | 60  |
| 十六、基金的会计与审计.....           | 62  |
| 十七、基金的信息披露.....            | 63  |
| 十八、风险揭示.....               | 67  |
| 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 70  |
| 二十、基金合同的内容摘要.....          | 72  |
| 二十一、基金托管协议的内容摘要.....       | 85  |
| 二十二、对基金份额持有人的服务.....       | 100 |
| 二十三、其他应披露事项.....           | 101 |
| 二十四、招募说明书存放及查阅方式.....      | 103 |
| 二十五、备查文件.....              | 103 |

## 一、绪言

《华夏希望债券型证券投资基金招募说明书（更新）》（以下简称“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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《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《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，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。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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

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：

|        |   |
|--------|---|
| 《基金合同》 | 指《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充        |
| 中国     | 指中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区) |
| 法律法规   | 指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件             |
| 《基金法》  | 指《中华人民共和国证券投资基金法》                           |
| 《销售办法》 | 指《证券投资基金销售管理办法》                             |

|           |  |
|-----------|--|
| 《运作办法》    | 指《证券投资基金运作管理办法》  |
| 《信息披露办法》  | 指《证券投资基金信息披露管理办法》  |
| 元         | 指中国法定货币人民币元  |
| 基金或本基金    | 指依据《基金合同》所募集的华夏希望债券型证券投资基金   |
| 招募说明书     | 指《华夏希望债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新   |
| 托管协议      | 指基金管理人与基金托管人签订的《华夏希望债券型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充                                      |
| 发售公告      | 指《华夏希望债券型证券投资基金基金份额发售公告》   |
| 《业务规则》    | 指《华夏基金管理有限公司开放式基金业务规则》   |
| 中国证监会     | 指中国证券监督管理委员会   |
| 银行监管机构    | 指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构  |
| 基金管理人     | 指华夏基金管理有限公司  |
| 基金托管人     | 指中国工商银行股份有限公司  |
| 基金份额持有人   | 指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者  |
| 基金代销机构    | 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基金销售与服务代理协议,代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构 |
| 销售机构      | 指基金管理人及基金代销机构  |
| 基金销售网点    | 指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点  |
| 登记结算业务    | 指基金登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等           |
| 基金登记结算机构  | 指华夏基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金登记结算业务的机构   |
| 《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                            |
| 个人投资者     | 指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人  |
| 机构投资者     | 指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织            |

|           |   |
|-----------|---|
| 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》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构     |
| 投资者       | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称                                     |
| 基金合同生效日   | 基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件,基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续,获得中国证监会书面确认之日                               |
| 募集期       | 指自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限  |
| 基金存续期     | 指《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间   |
| 日/天       | 指公历日  |
| 月         | 指公历月  |
| 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       | 指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日  |
| T 日       | 指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日   |
| T+n 日     | 指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)  |
| 认购        | 指在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为  |
| 发售        | 指在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为  |
| 申购        | 指基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理                       |
| 赎回        | 指基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理                       |
| 巨额赎回      | 指在单个开放日,本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日本基金总份额的 10%时的情形 |
| 基金账户      | 指基金登记结算机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户   |
| 交易账户      | 指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金   |

|          |   |
|----------|---|
|          | 交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户   |
| 销售服务费    | 指从基金资产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用   |
| 基金份额类别   | 指根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值  |
| 转托管      | 指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一销售机构交易账户转入另一销售机构交易账户的业务   |
| 基金转换     | 指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的公告规定的条件,向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的某一开放式基金(转出基金)的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他开放式基金(转入基金)的基金份额的行为 |
| 定期定额投资计划 | 指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式   |
| 基金收益     | 指基金投资所得的股票红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约  |
| 基金资产总值   | 指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和   |
| 基金资产净值   | 指基金资产总值扣除负债后的净资产值   |
| 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的过程  |
| 货币市场工具   | 指现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具             |
| 指定媒体     | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站  |
| 不可抗力     | 指合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件   |

### 三、基金管理人

#### (一)基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：凌新源

总经理：范勇宏

联系人：廖为

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-88066511

华夏基金管理有限公司注册资本为 13800 万元，公司股权结构如下：

| 持股单位       | 持股占总股本比例 |
|------------|----------|
| 中信证券股份有限公司 | 100%     |
| 合计         | 100%     |

#### (二)主要人员情况

##### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

王东明先生：董事长，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事长、中信基金管理有限责任公司董事长、中国国际信托投资公司董事、协理，中信控股有限责任公司董事、中信国际金融控股有限公司董事、中信资本市场控股有限公司董事。曾任中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事，北京华远经济建设公司副总经理，加拿大枫叶银行证券公司部门副经理，南方证券公司副总裁，华夏证券公司发行部副总经理等职务。

范勇宏先生：董事、总经理，博士。曾任华夏证券股份有限公司总裁助理、华北业务总监、华夏证券股份有限公司北京东四营业部总经理、中国建设银行总行干部。

王连洲先生：独立董事，学士。现已退休。《中华人民共和国证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在全国人大财经委员会和中国人民银行总行印制管理局工作。

龙涛先生：独立董事，硕士。现任海问投资咨询有限责任公司董事长、中央财经大学会计系副教授。曾在毕马威国际会计纽约分部从事审计和财务分析工作。



涂建先生：独立董事，学士。现任太平洋证券股份有限公司党委书记。曾任中国国际贸易促进委员会资产监督管理委员会资产管理中心主任。

滕天鸣先生：执行副总经理，硕士。曾任公司总经理助理和机构理财部总经理等。

方瑞枝女士：督察长，硕士。曾在中国金融出版社工作。

周伟明先生：监事，硕士。现任西南证券有限责任公司研究发展中心高级研究员、市场研究部经理、副总经理。曾任江苏联合信托投资有限公司研究发展部研究员、上海分部经理。

张鸣溪先生：监事，学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任北京证券有限责任公司投资银行部执行总经理、财务总监、华夏证券股份有限公司并购业务管理部常务副总经理、计划财务部副总经理、投资银行总部副总经理，中华会计师事务所注册会计师。

瞿颖女士：监事，硕士，中国注册会计师协会非执业会员。现任华夏基金管理有限公司稽核部总经理助理。曾就职于安永华明会计师事务所、泰康人寿保险公司。

## 2、本基金基金经理

韩会永先生，经济学硕士。曾任职于招商银行北京分行。2000年加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部副总经理、基金经理助理、华夏现金增利证券投资基金基金经理（2005年4月12日至2006年1月24日，2007年1月6日至2008年2月4日）。现任固定收益副总监、华夏债券投资基金基金经理(2004年2月27日起任职)，华夏希望债券型证券投资基金基金经理（2008年3月10日起任职）。

## 3、投资决策委员会（固定收益）成员：

杨爱斌先生：华夏基金管理有限公司固定收益总监。

滕天鸣先生：华夏基金管理有限公司执行副总经理。

韩会永先生：华夏基金管理有限公司固定收益副总监，华夏债券投资基金基金经理，华夏希望债券型证券投资基金基金经理。

唐俊先生：华夏基金管理有限公司固定收益部副总经理，基金经理。

乔巍先生：华夏基金管理有限公司固定收益部副总经理，基金经理。

## 4、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)基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定, 按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》的行为, 并建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为, 并建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 保证基金财产不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;
- (6)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;
- (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、行政法规有关规定, 由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

4、本基金管理人将加强人员管理, 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, 不从事以下行为:

- (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)依照法律、行政法规有关规定,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利益;

(2)不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、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。

#### (五)基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成,具体包括控制环境、风险评估、操作控制、信息沟通、内部稽核等要素。

##### 1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

(1)公司建立了科学的公司治理结构,在业界最早引入了独立董事制度,目前有独立董事3名。董事会下设资格审查委员会、薪酬委员会、审计委员会等专业委员会,其中审计委员会负责评价与完善公司内部控制体系。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会;

(2)公司各部门之间有明确的授权分工,既互相合作,又互相核对和制衡,形成了合理的组织结构;

(3)公司坚持稳健经营和规范运作,重视员工的职业道德的培养,制定和颁布了《员工合规行为守则》,并进行持续教育。

##### 2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后,对影响目标实现的不利因素(即风险)进行分析。对于不可控风险,风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务;对于可控风险,风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度,以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

##### 3、操作控制

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上,做到了业务操作流程的科学、合理和标准化,并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核;在岗位责任制度上,内部岗位分工合理、职责明确,不相容的职务、岗位分离设置,相互检查、相

互制约。

#### (1)投资控制制度

①投资决策与执行相分离。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例，在债券基金投资方面，投资决策委员会负责制订基金投资组合的久期和类属配置政策，基金经理在投资决策委员会确定的范围内，负责确定与实施投资策略、进行具体的证券选择、构建和调整投资组合并下达投资指令，交易管理部交易员负责交易执行。

②投资决策权限控制。基金经理对单只证券投资超过一定比例的，须提交书面报告，经投资总监或投资决策委员会(视投资比例而定)批准后才能执行。

③警示性控制。交易管理部对有问题的交易指令进行预警，并在投资组合中各类资产的投资比例将达到法规和公司规定的比例限制时进行预警。有问题的交易指令包括有操纵股价嫌疑、有与市场特定价位委托单大量对倒嫌疑的交易指令等，交易管理部发现该类指令时，向投资总监和监察稽核部门及时提出警示，基金经理须及时向投资总监和监察稽核部门说明情况，投资总监和监察稽核部门判断是否违规及是否停止交易。对投资比例的预警是通过交易系统设置各类资产投资比例的预警线，在达到接近限制比例前的某一数值时，系统自动预警，交易管理部及时向基金经理反馈预警情况。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司规定的禁止行为，制定证券投资限制表，包括受限制的证券和受限制的行为(如反向交易、对敲和单只证券投资的一定比例等)。基金经理构建组合时不能突破这些限制，同时交易管理部对此进行监控，通过预先的设定，交易系统能对这些情况进行自动提示和限制。

⑤一致性控制。对基金经理下达的投资交易指令、交易员输入交易系统的交易指令和基金会会计成交回报进行一致性复核，确保交易指令得到准确执行。

⑥多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控(包括上述警示性控制和禁止性控制)。交易管理部本身同时受投资总监、基金经理及监察稽核的三重监控：投资总监监控交易指令的正确执行和交易管理部监控职能的有效发挥；基金经理监控交易指令的正确执行；监察稽核部门监控有问题的交易。

#### (2)会计控制制度

①建立了基金会会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则，建立了基金会会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

### (3)技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行,公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

### (4)人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度,确保人力资源的有效管理。

### (5)监察制度

公司设立了独立的法律监察部门,负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度,以及对员工行为的监察。

## 4、信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,保证信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司所有业务均已做到了办公自动化,不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

## 5、内部稽核

公司设立了独立于各业务部门的稽核部,内部稽核人员定期检查和评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司各项内部控制制度的执行情况并提出相应的修改意见。

## 6、基金管理人关于内部控制的声明

- (1)本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;
- (2)上述关于内部控制的披露真实、准确;
- (3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系电话：010-66106912

联系人：蒋松云

## (二) 主要人员情况

截至2008年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工101人，平均年龄30岁，90%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

## (三) 基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2008年6月，托管证券投资基金95只，其中封闭式10只，开放式85只。托管资产规模年均递增超过90%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、履约类产品、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2008年初，中国工商银行先后被《全球托管人》、《环球金融》、《财资》、《证券时报》和《上海证券报》等国际国内媒体评选为2007年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，工商银行托管服务获得的该类奖项累计已经达到12项。

## (四) 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2007年，中国工商银行资产托管部再次通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资格认证SAS70（审计标准第70号）。通过SAS70国际专项认证，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，已经启动SAS70审计年度化、常规化的项目。

### 1、内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

## 2、内部风险控制组织结构

由中国工商银行专业稽核监察部门和资产托管部内设的稽核监察部门构成。专业稽核监察部门包括总行稽核监督局、监察室。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控保障部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。

## 3、内部风险控制原则

(1)合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整。

(5)有效性原则：必须根据国家政策、法律及工商银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则：设立专门履行基金托管人职责的管理部门；直接的操作人员和控制人员必须相对独立、适当分开；资产托管部内部设置独立的负责稽核监察部门专责内控制度的检查。

## 4、内部风险控制系统结构

中国工商银行内部控制纵向结构由决策控制、执行控制、监督控制组成，其横向结构由组织决策控制、资金营运控制、会计财务控制、资产管理控制、经营评价控制组成。纵横结构相互交错，由控制点到控制程序，进而形成相互依赖和制约、对整体经营活动具有全面控制功能的综合网络体系。

## 5、内部风险控制实施

(1)建立健全各项规章制度，制定各岗位职责、操作规则与程序，形成一套责权分明、平衡制约、规章健全、运作有序的内部控制机制。

(2)建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线。

(3)实行岗位分离、相互制约制度。

(4)对各类突发事件或故障建立完备有效的应急计划，对重要及关键岗位配备适当的人员备份。

## 6、资产托管部内部风险控制

中国工商银行资产托管部自1988年2月成立以来，在基金托管业务的运作过程中，逐步建立健

全各项规章制度，完善各项业务运作机制，形成了一套完整的相互制约的内控体系。

(1)建立了独立的负责稽核监察的部门，专责对业务运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行定期和不定期相结合的稽核和检查，定期独立出具稽核报告，报送总经理及中国证监会。

(2)完善组织结构，保证不同部门、不同岗位之间的相互制衡体系。

(3)建立健全规章制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、基金托管人与基金管理人签署的《华夏希望债券型证券投资基金托管协议》和有关基金法规的规定，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、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金投资的监督和检查自基金合同生效之后开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、《托管协议》或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 五、相关服务机构

### (一)销售机构

1、直销机构：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：凌新源

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-88066511



联系人：吴志军

## 2、代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

联系人：田耕

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

(2) 中国农业银行

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：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

联系人：客户服务中心

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

(3) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：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

联系人：客户服务中心

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

客户服务电话：95566

(4) 中国建设银行股份有限公司

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

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

联系人：王琳

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(5) 交通银行股份有限公司

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

法定代表人：蒋超良

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

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

客户服务电话：95559

(6) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：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

传真：0755-83195049、0755-82090817

联系人：王楠

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

(7) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：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

电话：010-65541405

传真：010-65541281

联系人：宋晓明

网站：<http://bank.ecitic.com>

客户服务电话：95558

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63602431

联系人：徐伟、汤嘉惠

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

客户服务电话：95528

(9) 深圳发展银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼

电话：0755-82088888

传真：0755-82080714

联系人：周勤

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

客户服务电话：95501

(10) 中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

客户服务电话：95595

传真：010-68560661

联系人：朱红

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

(11) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：11185

传真：010-66415194

联系人：陈春林

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

(12) 北京银行股份有限公司

住所：北京市金融大街丙 17 号北京银行大厦

办公地址：北京市金融大街丙 17 号北京银行大厦

法定代表人：阎冰竹

电话：010-66223251

传真：010-66223314

联系人：李娟

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

客户服务电话：010-96169

(13) 广东发展银行股份有限公司

住所：广州市农林下路 83 号

办公地址：广州市农林下路 83 号

法定代表人：李若虹

电话：020-38323832

传真：020-87311780

联系人：江璐

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

客户服务电话：95508

(14) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法人代表：林义相

电话：010-66045522

传真：010-66045500

联系人：陈少震

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

客户服务电话: 010-66045678

(15) 国泰君安证券股份有限公司

住所: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人: 祝幼一

电话: 021-38676666

传真: 021-38670666

联系人: 韩星宇

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

客户服务电话: 021-962588、400-888-8666

(16) 中信建投证券有限责任公司

住所: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 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: 400-888-8108

传真: 010-65182261

联系人: 权唐

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

(17) 国信证券有限责任公司

住所: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 9 楼

法定代表人: 何如

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133302

联系人: 林建闽

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

客户服务电话: 800-810-8868

(18) 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：400-888-8111、95565

(19) 广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：020-87555888-875

(20) 中信证券股份有限公司

住所：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

办公地址：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

传真：010-84865560

联系人：陈忠

网址：www.ecitic.com

客户服务电话：各地营业部咨询电话

(21) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：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：肖时庆

客户服务电话：800-820-1868

传真：010-66568536

联系人：李洋

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

(22) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

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

客户服务电话：021-962503、400-888-8001 或拨打各城市营业网点咨询电话

(23) 联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌

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

客户服务电话：400-888-8555，0755-25125666

(24) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54030294

联系人：李清怡

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

客户服务电话：021-962505

(25) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 22 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-68419867

联系人：谢高得

网址：www.xyjq.com.cn

客户服务电话：021-68419393 转 1098

(26) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：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：021-63219781

传真：021-51062920

联系人：李良

网址：www.95579.com

客户服务电话：400-888-8999、027-85808318

(27) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋九层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558335

传真：0755-82558335

联系人：吴跃辉

网址：www.axzq.com.cn

客户服务电话：0755-82825555 或拨打各城市营业网点咨询电话。

(28) 西南证券有限责任公司

住所：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层



法定代表人：范剑

客户服务电话：023-63786397

传真：023-63786312

联系人：杨卓颖

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

(29) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：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

电话：0571-85783715

传真：0571-85783771

联系人：王勤

网址：[www.96598.com.cn](http://www.96598.com.cn)

客户服务电话：0571-96598

(30) 湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 层

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康鹭

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

客户服务电话：400-888-1551

(31) 万联证券有限责任公司

住所：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

办公地址：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

法定代表人：李舫金

电话：020-37865026

传真：020-37865008

联系人：李俊

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

客户服务电话: 400-888-8133

(32) 国元证券股份有限公司

住所: 合肥市寿春路 179 号

办公地址: 合肥市寿春路 179 号

法定代表人: 凤良志

电话: 0551-2207938

传真: 0551-2634400-1171

联系人: 祝丽萍

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

客户服务电话: 全国: 400-888-8777、安徽地区: 96888

(33) 渤海证券有限责任公司

住所: 天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址: 天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人: 张志军

电话: 022-28451861

传真: 022-28451892

联系人: 王兆权

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

客户服务电话: 022-28455588

(34) 华泰证券股份有限公司

住所: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址: 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

电话: 025-84457777-893

传真: 025-84579879

联系人: 程高峰

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

客户服务电话: 400-888-8168、025-84579897

(35) 山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

客户服务电话：400-666-1618

(36) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

网址：www.zxwt.com.cn

客户服务电话：0532-96577

(37) 东吴证券有限责任公司

住所：江苏省苏州市石路爱河桥 28 号

办公地址：江苏省苏州市石路爱河桥 26 号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：www.dwzq.com.cn

客户服务电话：0512-96288、0512-65588066

(38) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

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

客户服务电话：95503

(39) 长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：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

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

联系人：匡婷

网址：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

客户服务电话：0755-33680000、400-666-6888

(40) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-68816000

传真：021-68815009

联系人：刘晨

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

客户服务电话：10108998 或拨打各城市营业网点咨询电话

(41) 广州证券有限责任公司

住所：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼六楼

法定代表人：吴志明

电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：樊刚正

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

客户服务电话: 020-961303

(42) 东北证券股份有限公司

住所: 长春市自由大路 1138 号

办公地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 矫正中

电话: 0431-85096709

传真: 0431-85096795

联系人: 潘锴

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

客户服务电话: 0431-96688、0431-85096733

(43) 南京证券有限责任公司

住所: 南京市鼓楼区大钟亭 8 号

办公地址: 南京市鼓楼区大钟亭 8 号

法定代表人: 张华东

客户服务电话: 025-83364032

传真: 025-83364032

联系人: 石健

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

(44) 上海证券有限责任公司

住所: 上海市西藏中路 336 号

办公地址: 上海市西藏中路 336 号

法定代表人: 蒋元真

电话: 021-51539888

传真: 021-65217206

联系人: 谢秀峰

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

客户服务电话: 021-962518

(45) 新时代证券有限责任公司

住所: 北京市西城区月坛大厦 15 层

办公地址：北京市西城区月坛大厦 15 层

法定代表人：马金声

客户服务电话：010-68084591

传真：010-68084986

联系人：戴荻

网址：www.xsdzq.cn

(46) 大同证券经纪有限责任公司

住所：山西省大同市大北街 13 号

办公地址：山西省太原市青年路 8 号

法定代表人：董祥

客户服务电话：0351-4167056

传真：0351-4192803

联系人：苏妮

网址：www.dtsbc.com.cn

(47) 国联证券股份有限公司

住所：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：范炎

电话：0510-82831662

传真：0510-82831589

联系人：袁丽萍

网址：www.glsc.com.cn

客户服务电话：400-888-5288、0510-82588168

(48) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法人代表：陈敬达

电话：0755-82450826

传真：0755-82433794

联系人：袁月

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

客户服务电话: 400-886-6338

(49) 国海证券有限责任公司

住所: 广西南宁市滨湖路 46 号

办公地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 张雅锋

电话: 0771-5539262

传真: 0771-5539033

联系人: 覃清芳

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

客户服务电话: 全国: 400-888-8100、广西: 96100

(50) 东莞证券有限责任公司

住所: 东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址: 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

电话: 0769-22119426

传真: 0769-22119423

联系人: 张建平

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

客户服务电话: 0769-961130、0769-22380828

(51) 国都证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人: 王少华

电话: 010-84183389

传真: 010-64482090

联系人: 黄静

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

客户服务电话: 800-810-8809

(52) 东海证券有限责任公司

住所：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼

办公地址：上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

联系人：邵一明

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：0519-8166222、0379-64912266

(53) 中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：平岳

电话：021-68604866

传真：021-50372474

联系人：张静

网址：www.bocichina.com.cn

客户服务电话：各地营业部咨询电话

(54) 恒泰证券有限责任公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：021-68405273

传真：021-68405181

联系人：张同亮

网址：www.cnht.com.cn

客户服务电话：0471-4961259

(55) 国盛证券有限责任公司

住所：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人：管荣升



电话：0791-6285337

传真：0791-6288690

联系人：徐美云

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

客户服务电话：0791-6285337

(56) 华西证券有限责任公司

住所：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：四川省成都市陕西街 239 号

法人代表：胡关金

电话：028-86126218

传真：028-86155733

联系人：王京红

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

客户服务电话：400-888-8818

(57) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283728

传真：0531-81283735

联系人：傅咏梅

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

客户服务电话：0531-82084184

(58) 世纪证券有限责任公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：段强

客户服务电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：刘军辉

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

(59) 第一创业证券有限责任公司

住所: 深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址: 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

电话: 0755-25832494

传真: 0755-25831718

联系人: 王立洲

网址: [www.fcsc.cn](http://www.fcsc.cn)

客户服务电话: 0755-25832523

(60) 金元证券股份有限公司

住所: 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人: 陆涛

电话: 0755-83025666

传真: 0755-83025625

联系人: 金春

网址: [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

客户服务电话: 400-888-8228

(61) 江南证券有限责任公司

住所: 南昌市抚河北路 291 号

办公地址: 南昌市抚河北路 291 号六楼

法定代表人: 姚江涛

电话: 0791-6768763

传真: 0791-6789414

联系人: 余雅娜

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

客户服务电话: 0791-6770351

(62) 泰阳证券有限责任公司

住所: 湖南省长沙市新建西路 1 号

办公地址：湖南省长沙市建湘路 479 号

法定代表人：乔林

电话：0731-2882331

传真：0731-2882331

联系人：彭博

网站：www.sunsc.com.cn

客户服务电话：0731-2889888

(63) 华林证券有限责任公司

住所：珠海市拱北夏湾华平路 96 号二层 202-203 房

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5 楼

法定代表人：段文清

电话：0755-82707853

传真：0755-82707850

联系人：骆扬

网址：www.chinalions.com

客户服务电话：各地营业部客户服务电话

(64) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

电话：021-68761616

传真：021-68767981

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

客户服务电话：400-888-8128

(65) 西部证券股份有限公司

住所：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

联系人：黄晓军

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

客户服务电话：029-87419999

(66) 信泰证券有限责任公司

住所：南京市长江路 88 号

办公地址：南京市长江路 88 号

法定代表人：钱凯法

客户服务电话：025-84784765

传真：025-84784830

联系人：舒萌菲

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

(67) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890619

传真：0931-4890118

联系人：李昕田

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

客户服务电话：0931-4980618、0931-4890100

(68) 财通证券经纪有限责任公司

住所：杭州市解放路 111 号金钱大厦

办公地址：杭州市解放路 111 号金钱大厦

法定代表人：陈海晓

电话：0571-87925129

传真：0571-87925129

联系人：乔骏

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

客户服务电话：0571-96336

(69) 中国建银投资证券有限责任公司

住所: 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

办公地址: 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

电话: 0755-82026521

传真: 0755-82026539

联系人: 刘权

网址: [www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

客户服务电话: 400-600-8008

(二) 登记结算机构

名称: 华夏基金管理有限公司

住所: 北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址: 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人: 凌新源

客户服务电话: 400-818-6666

传真: 010-88066511

联系人: 廖为

(三) 律师事务所

名称: 北京市德恒律师事务所

住所: 北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座十二层

法定代表人: 王丽

联系电话: 010-66575888

传真: 010-65232181

经办律师: 徐建军、李晓明

(四) 会计师事务所

名称: 中瑞岳华会计师事务所有限公司

住所: 北京西城区金融街 35 号国际企业大厦 A 座 8 层

办公地址: 北京西城区金融街 35 号国际企业大厦 A 座 8 层

法定代表人: 刘贵彬

联系人: 010-88091188

传真：010-88091199

联系人：罗军

经办注册会计师：罗军、黄简

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2008年1月21日证监许可[2008]114号文核准。

本基金为契约型开放式，基金存续期限为不定期。

本基金募集期间基金份额净值为人民币1.00元，按面值发售。

本基金自2008年2月14日至2008年3月5日进行发售。

本基金设立募集期共募集 9,322,690,505.32 份基金份额，有效认购户数为 168,327 户。

## 七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足《基金合同》生效条件，《基金合同》于 2008 年 3 月 10 日正式生效。自《基金合同》生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 八、基金份额的申购、赎回与转换

### (一) 申购与赎回办理的场所

#### 1、直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京、上海、深圳、广州的投资理财中心以及网上交易平台。

##### (1) 北京金融街投资理财中心

地址：北京西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 1 层（100032）

电话：010-88087226/27/28

传真：010-88087225

##### (2) 北京海淀投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村南大街 11 号光大国信大厦一层（100081）

电话：010-68458998/68458698/68458718

传真：010-68458598

##### (3) 北京朝阳投资理财中心

地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO B 座 0104（100022）

电话：010-58693528/16/26

传真：010-58693508

（4）北京东中街投资理财中心

地址：北京市东城区东中街 29 号东环广场 B 座一层（100027）

电话：010-64185181/82/83

传真：010-64185180

（5）北京科学院南路投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村科学院南路 9 号（新科祥园小区大门口一层）(100190)

电话：010-82523197/98/99

传真：010-82523196

（6）北京崇文投资理财中心

地址：北京市崇文区广渠门内大街幸福家园 4 号楼一层（100062）

电话：010-67146300/400

传真：010-67133146

（7）北京世纪城理财中心

地址：北京市海淀区蓝靛厂时雨园甲 2-4 号（100097）

电话：010-88892832/33/35

传真：010-88892830

（8）北京西三环投资理财中心

地址：北京市海淀区西三环北路甲 35 号(100089)

电话：010-68460370/0639/0796

传真：010-68460232

（9）北京亚运村投资理财中心

地址：北京市朝阳区惠忠里 103 号洛克时代广场 A 座一层（100101）

电话：010-84871036/37/38/39

传真：010-84871035

（10）北京望京投资理财中心

地址：北京市朝阳区望京南湖东园 122 楼博泰国际商业广场一层 F-36 号（100102）

电话：010-64743055/2505/0335/5375

传真：010-64746885

(11) 上海联洋投资理财中心

地址：上海市浦东新区长柳路 115 号（200135）

电话：021-68547366/7586/7566

传真：021-68547277

(12) 深圳投资理财中心

地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 108 室(518026)

电话：0755-82033033/88264716/88264710

传真：0755-82031949

(13) 广州天河投资理财中心

地址：广州市天河区天河北路 569 号芳草园首层（510630）

电话：020-38460001/1058/1152

传真：020-38461077

(14) 网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)。

## 2、代销机构

本基金代销机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“(一) 销售机构”的相关描述。

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、本基金发售公告或其他公告中列明。投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

### (二) 申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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并公告。



投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的,其基金份额申购、赎回价格为本基金下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

## 2、申购、赎回的开始时间

本基金已于2008年4月28日起开始办理日常申购、赎回等业务。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后,由基金管理人最迟于申购或赎回开始前2日在至少一种指定媒体公告。

## (三)申购和赎回的原则

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”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、本基金份额分为多个类别,适用不同的申购费率或销售服务费率,投资者在申购时可自行选择基金份额类别;

4、投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准;

5、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;

6、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。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## (四)申购和赎回的数额限制

1、投资者每次最低申购金额为1,000.00元(含申购费)。

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1,000.00份基金份额。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1,000.00份的,在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可根据市场情况,合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制,基金管理人进行前述调整必须提前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

## (五)申购和赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序,在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时,必

须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

## 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金登记结算机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后(包括该日)投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以登记结算机构或基金管理公司的确认结果为准。

## 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，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金登记结算机构及其相关基金销售机构在T+7日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

## (六)申购费与赎回费

1、对于A类基金份额，投资者在申购时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减，具体如下：

| 申购金额(含申购费)               | 前端申购费率      |
|--------------------------|-------------|
| 100万元以下                  | 1%          |
| 100万元以上(含100万元)-500万元以下  | 0.8%        |
| 500万元以上(含500万元)-1000万元以下 | 0.5%        |
| 1000万元以上(含1000万元)        | 每笔1,000.00元 |

申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2、本基金C类基金份额不收取申购费。

3、本基金A类、C类基金份额均收取赎回费，赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。赎回时份额持有不满30天的，收取0.1%的赎回费，持有满30天以上(含30天)的，赎回费为0。其中，所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

4、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定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2个工作日在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基

金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(七)申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

(1)当投资者选择申购A类基金份额时,申购份额的计算方法如下:

①申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下:

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

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

②申购费用为固定金额时,申购份额的计算方法如下:

$$\text{前端申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{前端申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

(2)当投资者选择申购C类基金份额时,申购份额的计算方法如下:

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T日C类基金份额净值}$$

(3)基金份额按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

例一:假定T日基金的A类基金份额净值为1.230元,C类基金份额净值为1.200元。四笔申购金额分别为1,000.00元、100万元、500万元和1000万元,申购A类基金份额;另有一笔申购金额为10万元,申购C类基金份额,则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下:

|                  | 申购1      | 申购2          | 申购3          | 申购4           | 申购5        |
|------------------|----------|--------------|--------------|---------------|------------|
| 申购金额(元, a)       | 1,000.00 | 1,000,000.00 | 5,000,000.00 | 10,000,000.00 | 100,000.00 |
| 适用前端申购费率(b)      | 1%       | 0.8%         | 0.5%         | -             | -          |
| 净申购金额(c=a/(1+b)) | 990.10   | 992,063.49   | 4,975,124.38 | 9,999,000.00  | 100,000.00 |
| 前端申购费(d=a-c)     | 9.90     | 7,936.51     | 24,875.62    | 1,000.00      | -          |
| 该类基金份额净值(e)      | 1.230    | 1.230        | 1.230        | 1.230         | 1.200      |
| 申购份额(=c/e)       | 804.96   | 806,555.68   | 4,044,816.57 | 8,129,268.29  | 83,333.33  |

2、赎回金额的计算

(1)当投资者赎回A类基金份额时,赎回金额的计算方法如下:

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日A类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

(2)当投资者赎回C类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日C类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例二：假定某投资者在T日赎回10,000份A类基金份额，持有期限10天，该日A类基金份额净值为1.250元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.250 = 12,500.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500.00 \times 0.1\% = 12.50 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500.00 - 12.50 = 12,487.50 \text{元}$$

例三：假定某投资者在T日赎回10,000份C类基金份额，持有60天，该日C类基金份额净值为1.225元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.225 = 12,250.00 \text{元}$$

(3)T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日公告。各个基金份额类别单独计算基金份额净值，计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。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。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### (八)申购和赎回的登记结算

投资者申购基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者登记权益并办理登记结算手续，投资者自T+2日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金登记结算机构在T+1日为投资者办理扣除权益的登记结算手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

#### (九)拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝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运作。
- 2、证券交易所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算。

3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况。

4、因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券即将上市或进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害已有基金份额持有人利益的。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或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。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

7、个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害。

8、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 6 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

#### (十)暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- 1、不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 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、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- 4、出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- 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，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，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，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第 4 款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定的媒体及基金管理人网站公告。投资者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。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

## (十一)巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请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。

### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，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者的全部赎回申请时，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者的赎回申请有困难或认为支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的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3)巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向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。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，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 20 个工作日，并应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

## (十二)重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，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 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个开放日的基金份额净值。

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,重复刊登暂停公告的频率可调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站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近一个开放日的基金份额净值。

### (十三)基金的转换

为方便基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

### (十四)转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从某一销售机构交易账户转入另一销售机构交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

### (十五)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

### (十六)基金的非交易过户

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。

基金登记结算机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经登记结算机构认可的其他情况下的非交易过户。其中,“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下,接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金登记结算机构要求提供的相关资料。

基金登记结算机构受理上述情况下的非交易过户,其他销售机构不得办理该项业务。对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

### (十七)基金的冻结与解冻

基金登记结算机构只受理国家有权机关依法要求或者基金份额持有人本人自愿要求的基金份额的冻结与解冻以及登记结算机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的,被冻结部

分产生的权益(仅限于红利再投资, 不包括现金分红)一并冻结, 被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

## 九、基金的投资

### (一)投资目标

在控制风险和保持资产流动性的前提下, 追求较高的当期收入和总回报。

### (二)投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具, 包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债、可转换债券、资产支持证券等。本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具(含可转债); 本基金还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具, 但上述非固定收益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外, 如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入本基金的投资范围。

### (三)投资策略

基金将坚持稳健投资, 在严格控制风险的基础上, 追求较高的当期收入和总回报。

#### 1、稳健资产配置

本基金80%以上的基金资产投资于债券类金融工具, 本基金股票投资比例上限不超过20%, 一般情况下保持在10%左右, 以便控制市场波动风险。随着股票市场的波动, 基金管理人还将采取风险预算策略, 在市场上涨幅度较大时止赢, 在市场下跌较快时止损, 以追求绝对回报为目标。

#### 2、债券投资策略

本基金将在保持组合低波动性的前提下, 运用多种积极管理增值策略, 追求绝对回报。绝对回报投资组合的目标在于资本金保值、持续性地以绝对正回报的方式实现增值。

##### (1)久期调整策略

本基金将根据对利率水平的预期, 在预期利率下降时, 增加组合久期, 以较多地获得债券价格上升带来的收益, 在预期利率上升时, 减小组合久期, 以规避债券价格下降的风险。

##### (2)收益率曲线策略

在久期确定的基础上, 根据对收益率曲线形状变化的预测, 采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略, 在长期、中期和短期债券间进行配置, 以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。



### (3)债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较高收益。其中,随着债券市场的发展,基金将加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资,主要通过信用风险的分析和管埋,获取超额收益。

### (4)骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况(通常是收益率曲线短端的 1-3 年,买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券,随着基金持有债券时间的延长,债券的剩余期限将缩短,到期收益率将下降,基金从而可获得资本利得收入。

### (5)相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间的市场利差等。金融债与国债的利差由税收因素形成,利差的大小主要受市场资金供给充裕程度决定,资金供给越充分上述利差将越小。交易所与银行间的联动性随着市场改革势必渐渐加强,两市之间的利差能够提供一些增值机会。

### (6)信用利差策略

企业债与国债的利差曲线理论上受经济波动与企业生命周期影响,相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动,另外在经济上升或下降的周期中企业债利差将缩小或扩大。管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。

### (7)回购放大策略

该策略在资金相对充裕的情况下是风险很低的投资策略。即在基础组合的基础上,使用基础组合持有的债券进行回购放大融入短期资金滚动操作,同时选择 2 年以下的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。

### (8)可转债投资策略

可转债不同于一般的企业债券,其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利,因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资于可转债,主要目标是降低基金净值的下行风险,基金投资的可转债可以转股,以保留参与股票升值的收益潜力。

#### ①积极管理策略

可转债内含选择权定价是决定可转债投资价值的关键因素。本基金将采取积极管理策略,重视对可转债对应股票的分析与研究,选择那些公司行业景气趋势回升、成长性好、估值水平偏低或合

理的转债进行投资，以获取收益。

#### ②一级市场申购策略

目前，可转债均采用定价发行，对于那些发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债，因供求不平衡，会产生较大的一、二级市场价差。因此，为增加组合收益，本基金将在充分研究的基础上，参与可转换债券的一级市场申购，在严格控制风险的前提下获得稳定收益。

#### (9)资产支持证券投资策略

对于资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

### 3、股票投资策略

#### (1)新股申购策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差，从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

#### (2)个股精选策略

本基金将主要采取自下而上的个股精选策略，投资于具备稳定内生增长、能给股东创造经济价值(EVA)的股票。基金将以超额收益( $\alpha$ 值)为目标，利用“多因素选股模型”，综合考察股票所属行业发展前景、上市公司行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，挑选出预期表现将超过大盘的个股，构建核心组合。

#### (3)组合动态调整策略

本基金将根据市场波动性及其走向趋势，采用时间平均法调整建仓节奏，控制建仓成本，同时设置止赢止损点，在组合获利达到既定目标时及时兑现，以实现基金每年的绝对收益目标。

基金在构建股票组合时，会根据最近一段时间市场走势，预先设定建仓节奏。如市场振荡较大时，基金将放慢建仓节奏，如市场趋势明显、振荡不大时，基金将加快建仓节奏。时间平均法可有效控制建仓成本，降低组合波动。另外，基金将监控股票组合的表现，根据对市场走势和宏观经济的预期，预先设定组合止赢点，在止赢点附近，基金将部分变现，降低股票仓位，以兑现收益。

### 4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，

在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

未来,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

#### (四)投资管理体制

公司实行投资决策委员会领导下的投资总监负责制。投资决策委员会是公司的最高投资决策机构,负责资产配置和重大投资决策等;投资总监全面负责公司的投资、研究、交易工作,向投资决策委员会报告;基金经理负责所管理基金的日常投资运作;交易管理部负责所有交易的集中执行。

#### (五)投资管理程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

##### 1、研究

本基金的债券投资研究依托公司整体的债券研究平台,由固定收益部负责。通过自上而下的宏观基本面和资金技术面分析、自下而上的债券信用利差分析、个券估值分析以及数量化的相对价值分析,研究员对未来市场利率和收益率曲线变化趋势、债券类属和行业配置提出分析意见,并经公司固定收益部久期和收益率曲线决策小组、类属和行业配置决策小组讨论后形成结论。公司的股票投资部负责股票投资的研究。

##### 2、资产配置决策

投资决策委员会负责判断一段时间内证券市场的基本走势,决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围。基金经理在投资决策委员会决定的资产配置比例范围内,结合基金风险预算的要求,决定基金的具体资产配置。

##### 3、组合构建

基金经理根据研究员提交的投资报告,结合自身的研究判断,决定具体的投资品种并决定买卖时机,其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批。

##### 4、交易执行

交易管理部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责,监控内容包括基金资产配置、个股投资比例等。

##### 5、风险与绩效评估

风险管理部定期和不定期对基金进行风险和绩效评估,并提供相关报告。风险报告使得投资决策委员会和基金经理能够随时了解组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略。绩效评估能

够确认组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

## 6、组合监控与调整

基金经理将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书更新中公告。

### (六)投资限制

#### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1)承销证券；
- (2)向他人贷款或提供担保；
- (3)从事承担无限责任的投资；
- (4)买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- (6)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；
- (7)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门修改或取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可相应调整投资禁止行为的规定，不受上述规定的限制。

#### 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1)持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (3)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (4)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(5)现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%;

(6)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(7)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(8)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(9)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(10)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;

(11)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门修改或取消上述限制的,履行适当程序后,本基金可相应调整投资组合限制的规定,不受上述限制。

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约定。由于证券市场波动、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产在 10 个交易日内增加 10 亿元以上,导致证券投资比例低于基金合同的约定时,基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后,可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。

#### (七)业绩比较基准

本基金业绩比较基准: 中信标普全债指数。

中信标普全债指数属于中信标普固定收益系列指数,该系列指数旨在追踪中国的国债、企业债、银行间债券和可转换债券市场。中信标普全债指数涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间市场上市的债券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。中信标普全债指数的编制方为中信标普指数信息服务有限公司,该公司网站(<http://www.spciticindex.com/>)提供指数编制方法、指数数据等相关指数信息。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### (八)风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

#### (九)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

#### (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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2008年7月16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2008年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 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  | 权益类投资             | 52,672,041.59    | 0.57%     |
|    | 其中：股票             | 52,672,041.59    | 0.57%     |
| 2  | 固定收益类投资           | 8,956,309,258.18 | 96.43%    |
|    | 其中：债券             | 8,956,309,258.18 | 96.43%    |
|    | 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      | 189,331,170.89   | 2.04%     |
| 6  | 其他资产              | 89,874,114.76    | 0.97%     |
| 7  | 合计                | 9,288,186,585.42 | 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 | 242,880.00    | 0.00%     |
| B  | 采掘业      | -             | -         |
| C  | 制造业      | 34,649,986.19 | 0.37%     |
| C0 | 食品、饮料    | 2,347,020.00  | 0.03%     |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 220,010.00    | 0.00%     |
| C2 | 木材、家具    | 971,774.61    | 0.01%     |

|     |                |               |       |
|-----|----------------|---------------|-------|
| C3  | 造纸、印刷          | 240,669.26    | 0.00% |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 9,599,788.66  | 0.10% |
| C5  | 电子             | 452,628.00    | 0.00% |
| C6  | 金属、非金属         | 299,994.50    | 0.00% |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 19,142,438.59 | 0.21% |
| C8  | 医药、生物制品        | 1,184,831.67  | 0.01% |
| C99 | 其他制造业          | 190,830.90    | 0.00% |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -             | -     |
| E   | 建筑业            | -             | -     |
| F   | 交通运输、仓储业       | -             | -     |
| G   | 信息技术业          | -             | -     |
| H   | 批发和零售贸易        | 1,074,994.10  | 0.01% |
| I   | 金融、保险业         | -             | -     |
| J   | 房地产业           | 16,051,492.23 | 0.17% |
| K   | 社会服务业          | 169,267.32    | 0.00% |
| L   | 传播与文化产业        | 483,421.75    | 0.01% |
| M   | 综合类            | -             | -     |
|     | 合计             | 52,672,041.59 | 0.57% |

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  | 000651 | 格力电器 | 500,000 | 15,650,000.00 | 0.17%     |
| 2  | 000002 | 万科A  | 960,000 | 8,649,600.00  | 0.09%     |
| 3  | 000826 | 合加资源 | 545,797 | 8,350,694.10  | 0.09%     |
| 4  | 600325 | 华发股份 | 696,321 | 7,401,892.23  | 0.08%     |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 78,000  | 2,347,020.00  | 0.03%     |
| 6  | 002242 | 九阳股份 | 47,488  | 1,920,414.72  | 0.02%     |
| 7  | 002252 | 上海莱士 | 47,641  | 1,184,831.67  | 0.01%     |
| 8  | 002251 | 步步高  | 22,142  | 1,074,994.10  | 0.01%     |
| 9  | 002240 | 威华股份 | 79,719  | 971,774.61    | 0.01%     |
| 10 | 002249 | 大洋电机 | 29,830  | 722,184.30    | 0.01%     |

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      | 236,276,060.00   | 2.55%     |
| 2  | 央行票据      | 7,537,946,000.00 | 81.51%    |
| 3  | 金融债券      | 698,300,000.00   | 7.55%     |
|    | 其中：政策性金融债 | 698,300,000.00   | 7.55%     |
| 4  | 企业债券      | 393,937,608.00   | 4.26%     |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -         |
| 6  | 可转债       | 89,849,590.18    | 0.97%     |
| 7  | 其他        | -                | -         |
| 8  | 合计        | 8,956,309,258.18 | 96.85%    |

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  | 0801031 | 08 央行票据 31 | 8,800,000 | 845,504,000.00 | 9.14%     |
| 2  | 0801035 | 08 央行票据 35 | 8,000,000 | 799,200,000.00 | 8.64%     |
| 3  | 0801046 | 08 央行票据 46 | 7,700,000 | 739,816,000.00 | 8.00%     |
| 4  | 0801047 | 08 央行票据 47 | 7,000,000 | 699,020,000.00 | 7.56%     |
| 5  | 0801034 | 08 央行票据 34 | 7,000,000 | 672,560,000.00 | 7.27%     |
|    | 0801049 | 08 央行票据 49 | 7,000,000 | 672,560,000.00 | 7.27%     |

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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 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。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 125,000.00    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 80,715,256.73 |
| 5  | 应收申购款   | 9,033,858.03  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 89,874,114.76 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例 |
|----|--------|------|---------------|-----------|
| 1  | 125709 | 唐钢转债 | 40,268,596.38 | 0.44%     |
| 2  | 110598 | 大荒转债 | 9,225,600.00  | 0.10%     |
| 3  | 110567 | 山鹰转债 | 2,650,606.00  | 0.03%     |
| 4  | 110971 | 恒源转债 | 1,142,910.40  | 0.01%     |
| 5  | 125960 | 锡业转债 | 935,831.16    | 0.01%     |

(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 | 002242 | 九阳股份 | 1,920,414.72 | 0.02% | 新发流通受限 |
| 2 | 002251 | 步步高  | 1,074,994.10 | 0.01% | 新发流通受限 |
| 3 | 002240 | 威华股份 | 971,774.61   | 0.01% | 新发流通受限 |
| 4 | 002249 | 大洋电机 | 722,184.30   | 0.01% | 新发流通受限 |
| 5 | 002252 | 上海莱士 | 674,996.67   | 0.01% | 新发流通受限 |

(6) 由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十、基金的业绩

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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### (一) 华夏希望(A类)

| 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    |
|---------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2008年3月10日至<br>2008年6月30日 | 0.90%  | 0.04%     | 0.50%      | 0.05%         | 0.40% | -0.01% |

### (二) 华夏希望(C类)

| 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    |
|---------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2008年3月10日至<br>2008年6月30日 | 0.80%  | 0.04%     | 0.50%      | 0.05%         | 0.30% | -0.01% |

## 十一、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## 十二、基金的财产

### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有:

- 1、银行存款及其应计利息;

- 2、清算备付金及其应计利息;
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息;
- 4、应收证券交易清算款;
- 5、应收申购款;
- 6、股票投资及其估值调整;
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息;
- 8、权证投资及其估值调整;
- 9、其他投资及其估值调整;
- 10、其他资产等。

#### (二)基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

#### (三)基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务,并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并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### (四)基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产;基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益,归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金登记结算机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权,不得与其固有资产产生的债务相互抵消;基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

### 十三、基金资产的估值

#### (一)估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产的价值,依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值,是计算基金申购与赎回价格的基础。

## (二)估值日

本基金的估值日为相关的证券交易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、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

## (四)估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后,将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人,基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核,复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公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。

## (五)估值方法

本基金按以下方式进行估值:

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

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

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

### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

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

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

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

3、因持有股票而享有的配股权,采用估值技术确认公允价值;

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

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

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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,按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### (六)基金份额净值的确认和估值错误的处理

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时,基金管理人应当立即纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应报中国证监会备案;当估值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,并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的,应先由基金管理人承担,基金管理人对其不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。

关于差错处理,合同的当事人按照以下约定处理:

##### 1、差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代理销售机构、或投资者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无法预见、无法避免、无法抗拒,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者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;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资产损失时,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资产损失时,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资产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;

(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、《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的交易数据的,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;

(5)基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当报告中国证监会;基金管理人及基金托管人基金份额净值计算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并报中国证监会备案。

#### (七)暂停估值的情形

- 1、与本基金投资有关的证券交易场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、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### (八)特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;
- 2、由于证券交易所及其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,基金管理人和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。

## 十四、基金的收益与分配

### (一)基金收益的构成

基金收益包括:基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财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有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### (三)基金收益分配原则

- 1、由于基金费用的不同,不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同,基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案,同一类别内的每一基金份额享有同等分配权;
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次分配比例不得低于可供分配收益的 20%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;
- 3、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,基金份额持有人可对 A 类、C 类基

金份额分别选择不同的分红方式，选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按红利发放日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、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；
- 6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 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

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

#### (五)收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

#### (六)基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将基金份额持有人的现金红利按红利发放日该类别的基金份额净值自动转为相应的同一类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十五、基金的费用与税收

### (一)基金运作费用

#### 1、基金费用的种类

- (1)基金管理人的管理费；
- (2)基金托管人的托管费；
- (3)销售服务费；
- (4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (6)基金份额持有人大会费用；
- (7)基金的证券交易费用；

(8)基金的银行汇划费用;

(9)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## 2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

### (1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

### (2)基金托管人的托管费

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

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

### (3)销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,A类不收取销售服务费,C类销售服务费年费率为0.3%。

各类别基金份额的销售服务费计算方法如下:

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H为各类别基金份额每日应计提的销售服务费

E为各类别基金份额前一日基金资产净值

R为各类别基金份额适用的销售服务费率

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基



金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中划出,经登记结算机构分别支付给各个基金销售机构。

(4)本条第(一)款第1项中第(4)至第(9)项费用根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- (1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- (2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- (3)《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
- (4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 4、费用调整

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

调高基金管理费率、基金托管费率须召开基金份额持有人大会审议,但根据法律法规的要求提高管理费、托管费的情形除外;调低基金管理费率、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2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

### (二)基金销售费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中的“(六)申购费与赎回费”与“(七)申购份额与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

### (三)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十六、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方;
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;
- 3、基金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。

## (二)基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的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,应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## 十七、基金的信息披露

(一)本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。

### (二)信息披露义务人

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。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,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应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三)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销售机构;
- 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。

(四)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。

(五)公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

(1)基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

(2)《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3)基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当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媒体和基金管理人网站上。

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载《基金合同》生效公告。

4、基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，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。

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

#### 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《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,并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 6、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

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媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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媒体上。

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媒体和基金管理人网站上。

《基金合同》生效不足 2 个月的,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。

基金定期报告在公开披露的第 2 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、临时报告

本基金发生重大事件,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的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件,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)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)变更基金销售机构;

(20)更换基金登记结算机构;

(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;

(26)本基金重新开始办理申购、赎回;

(27)基金份额的拆分;

(28)基金推出新业务或服务;

(29)中国证监会规定的其他事项。

#### 8、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案,并予以公告。召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前 30 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基金份额持有人大会,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、中国证监会规定的其他信息。

#### (六)信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、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。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### (七)信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构所在地，供公众查阅、复制。

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所在地，以供公众查阅、复制。

## 十八、风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金

投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资人应当认真阅读本基金“基金合同”、“招募说明书”等基金法律文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金,基金代销机构名单详见本基金的招募说明书以及相关公告。

本基金在认购期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值购买基金份额以后,有可能面临基金份额净值跌破1.00元、从而遭受损失的风险。

#### (一)投资于本基金的主要风险

##### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动,将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为债券投资风险和股票投资风险。

##### (1)债券投资风险主要包括:

###### ①利率风险

市场利率波动会导致债券市场的收益率和价格的变动,如果市场利率上升,本基金持有债券将面临价格下降、本金损失的风险,而如果市场利率下降,债券利息的再投资收益将面临下降的风险。

###### ②收益率曲线风险

如果基金对长、中、短期债券的持有结构与基准存在差异,长、中、短期债券的相对价格发生变化时,基金资产的收益可能低于基准。

###### ③利差风险

债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

###### ④信用风险

基金在交易过程中发生交收违约,或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降,造成基金资产损失的风险。

###### ⑤市场供需风险

如果宏观经济环境、政府财政政策、市场监管政策、市场参与主体经营环境等发生变化,债券市场参与主体可用资金数量和债券市场可供投资的债券数量可能发生相应的变化,最终影响债券市场的供需关系,造成基金资产投资收益的变化。

###### ⑥购买力风险

基金投资所取得的收益率有可能低于通货膨胀率,从而导致投资者持有本基金资产实际购买力

下降。

(2)股票投资风险主要包括:

①国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响,导致市场价格水平波动的风险。

②宏观经济运行周期性波动,对股票市场的收益水平产生影响的风险。

③上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化,从而导致股票价格变动的风险。

## 2、流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下,基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合,从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求,本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求,在管理现金头寸时,有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

## 3、积极管理风险

在精选个股的实际操作过程中,基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断,其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

## 4、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中,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或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记结算机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 5、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## (二)声明

1.本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金,须自行承担投资风险。

2.除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过代销机构销售,但是,本基金并不是代销机构的存款或负债,也没有经代销机构担保或者背书,代销机构并不能保证其收益或本金安全。



基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一)《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过:

(1)更换基金管理人;

(2)更换基金托管人;

(3)转换基金运作方式;

(4)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;

(5)变更基金类别;

(6)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);

(7)变更基金份额持有人大会召开程序;

(8)终止《基金合同》;

(9)其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案:

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金资产承担的费用;

(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3)在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的基金份额类别设置或调整各类别基金份额的申购费率、赎回费率、销售服务费率或收费方式;

(4)经中国证监会允许,基金管理人、代销机构、登记结算机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;

(5)经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;

(6)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(7)对《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或修改不涉及《基金合同》

当事人权利义务关系发生变化;

(8)除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自持有人大会决议生效之日起在至少一家指定媒体公告。

## (二)《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## (三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 60 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

### 4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估值和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7)对基金财产进行分配；

### (四)清算费用

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

### (五)基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六)基金财产清算的公告

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

#### (七)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。

## 二十、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》。

### “六、基金合同当事人的权利与义务

#### (一)基金管理人

##### 1、基金管理人简况

名称:华夏基金管理有限公司

住所:北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人:凌新源

设立日期:1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.38 亿元

存续期限:100 年

##### 2、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集基金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定的监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定的,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、委托、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定的决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12)在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下,制订和调整《业务规则》,决定和调整除调高管理费率 and 托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

(13)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;

(14)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;

(15)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(16)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(17)法律法规、《基金合同》及国务院证券监督管理机构规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(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;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定的,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(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、谨慎勤勉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基金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,不得利用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)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制半年度和年度基金报告;

(11)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;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、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,不向他人泄露;

(13)按《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基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)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;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《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,并在支付合理成本的条件下列得到有关资料的复印件;

(18)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;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)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时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

(23)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实施其他法律行为;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(26)法律法规、《基金合同》及国务院证券监督管理机构约定的其他义务。

## (二)基金托管人

### 1、基金托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号)

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

### 2、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1)自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- (2)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；
- (3)监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (4)以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；
- (5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；
- (6)以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；
- (7)提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (8)在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (9)法律法规、《基金合同》及国务院证券监督管理机构规定的其他权利。

### 3、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2)设立专门的基金托管部门，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)建立健全内部风险控制、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财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的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，不得利用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，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；

(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予以保密，不得向他人泄露；

(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10)对基金财务会计报告、季度、半年度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；

(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12)建立并保存基金份额持有人名册；

(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14)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；

(15)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；

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17)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；

(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金利益向基金管理人追偿;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(22)法律法规、《基金合同》及国务院证券监督管理机构约定的其他义务。

### (三)基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

(9)法律法规、《基金合同》及国务院证券监督管理机构规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1)遵守法律法规、《基金合同》;

(2)缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(3)在其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及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

(5)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;

(6)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(7)法律法规、《基金合同》及国务院证券监督管理机构约定的其他义务。

### 七、基金份额持有人大会



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的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(一)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)更换基金管理人；

(3)更换基金托管人；

(4)转换基金运作方式；

(5)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；

(6)变更基金类别；

(7)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外)；

(8)变更基金份额持有人大会程序；

(9)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(10)单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(11)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(12)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况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、基金托管费和其他应由基金资产承担的费用；

(2)法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3)在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的基金份额类别设置或调整各类别基金份额的申购费率、赎回费率、销售服务费率或收费方式；

(4)经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、登记结算机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(5)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(6)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(7)对《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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(8)除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二)会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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 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，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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(含 10%)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。

5、代表基金份额 10%以上(含 10%)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，单独或合计代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1)会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

(3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4)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；

(5)会务常设联系人姓名及联系电话。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议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，不影响表决意见的计票结果。

#### (四)基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定。

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，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1)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符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定。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)经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%(含 50%)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决，书面表决方式是指持有人需在派发或自制（如裁剪、打印、复印、复制）的书面表决票上填写表决意见并签字或盖章，并以书面方式提供持有人大会会议通知中要求的文件资料。召集人则应在持有人大会会议通知中公告书面表决的提交方式，如现场提交、邮寄、传真等。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1)会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，连续公布相关提示性公告；

(2)大会召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同地称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

(3)会议召集人在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；

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

(5)上述第(4)项中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、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记结算机构记录相符,并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定;

(6)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,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者;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。

#### (五)议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上(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。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

###### (2)通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工

作日内在监督人和公证机关监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,不影响基金份额持有人大会决议的效力。

#### (六)表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### (七)计票

##### 1、现场开会

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

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

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

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在监督人派出的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。如监督人经通知拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### (八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

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。

(九)法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (二)《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 60 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

### 4、基金财产清算程序：

(1)《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- (3)对基金财产进行估值和变现;
- (4)制作清算报告;
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7)对基金财产进行分配。

#### (四)清算费用

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

#### (五)基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六)基金财产清算的公告

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

#### (七)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。

### 二十一、争议的处理和适用的法律

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### 二十二、基金合同的效力

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅;投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件,但内容应以《基金合同》正本为准。”

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《华夏希望债券型证券投资基金托管协议》。

“一、托管协议当事人

(一)基金管理人

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：凌新源

成立时间：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

注册资本：1.38 亿元

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，及中国证监会批准的其他业务；因特网信息服务业

存续期间：100 年

(二)基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号(100032)

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号)

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务(银证转账)；保险兼业代理业务(有效期至 2008 年 9 月 4 日)；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发



行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

### 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### (一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债、可转换债券、资产支持证券等。本基金还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1)按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具（含可转债）；非固定收益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；

c、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

d、本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

e、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%;

f、本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

g、本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

h、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

i、本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

j、一只基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之二;一只基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过该基金资产净值的百分之十;经基金管理人和托管人协商,可对以上比例进行调整;

k、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;

l、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门修改或取消上述限制的,履行适当程序后,本基金可相应调整投资组合限制的规定,不受上述限制。

除投资资产配置外,基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

### (3)法规允许的基金投资比例调整期限

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上述的约定。

由于证券市场波动、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例,不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形,而导致证券投资比例低于基金合同约定的,基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后,可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下,至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施,便于托管人实施交易监督。

(4)本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

(5)相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

(1)承销证券；

(2)向他人贷款或提供担保；

(3)从事可能使基金承担无限责任的投资；

(4)买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

(6)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；

(7)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门修改或取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可相应调整投资禁止行为的规定，不受上述规定的限制。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

5、基金托管人依据有关法律法规的规定和《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。

(1)基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单,并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新,名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请,基金托管人于2个工作日内回函确认收到后,对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后,被确认调整的名单开始生效,新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,托管人有权报告中国证监会。

(2)基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式,经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任。

(3)基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,基金管理人与基金托管人协商一致后,可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿,如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程,则对于由于交易对手资信风险引起的损失,不承担赔偿责任。

6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿,如果基金托管人

在运作过程中遵循上述监督流程,则对于由于存款银行信用风险引起的损失,不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后,可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

#### 7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1)基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2)流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3)基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式进行确认。

(4)基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并于拟执行投资指令前将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5)基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督,并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险,基金托管人应承担连带责任。

(二)基金托管人应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。

(三)基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回函,进行解释或举证。

在限期内,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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《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投资指令违反法律、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,并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,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。

#### 四、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于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。

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》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人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及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内,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,并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此

所遭受的损失。

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和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

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。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，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。

## 五、基金财产保管

### (一)基金财产保管的原则

- 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。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认(申)购、基金投资过程中产生的应收财产，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责任。

### (二)募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的华夏基金管理有限公司基金募集专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，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的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

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事宜。

### (三)基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户,保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下,代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动,均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用,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其他任何银行账户;亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### (四)基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

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公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户,用于证券清算。

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。

#### (五)债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户,并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议,正本由基金托管人保管,基金管理人保存副本。

#### (六)其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### (七)基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库;其中实物证券也可存



入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### (八)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应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时,应保证基金一方持有两份以上的正本,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。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

### 八、基金资产净值计算和会计核算

#### (一)基金资产净值的计算

##### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

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该计算日基金总份额后的数值。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,由此产生的误差计入基金财产。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值;基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。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份额资产净值并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后,签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人,由基金管理人对外予以公布。

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。因此,就与本基金有关的会计问题,本基金的会计责任方是基金管理人,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。

#### (二)基金资产估值方法

##### 1、估值对象

基金的估值对象为基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产及负债。

## 2、估值方法

本基金按以下方式进行估值:

### (1)证券交易所上市的有价证券的估值

A、交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

B、交易所上市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,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

C、交易所上市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;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

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

### (2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

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

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

C、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(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3)因持有股票而享有的配股权,采用估值技术确认公允价值。

(4)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)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具

体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

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

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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見,按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (三)估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担,基金管理人对其不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的,由此造成的投资者或基金的损失,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误,另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误,进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失,以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其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,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和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。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时,相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对,如果最后仍无法达成一致,应以基金管理人的计算结果为准对外公布,由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任,基金托管人不负赔偿责任。

### (四)基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后,应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册,对相关各方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧,应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

#### (五)基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内,基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上,并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告;在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告;在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日,对报表加盖公章后,以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核;基金托管人在 3 个工作日内进行复核,并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年报完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 30 日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 45 日内复核,并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中,发现相关各方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后,基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书,相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致,基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告,基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、半年报告或年度报告复核完毕后,需盖章确认或出具相应的复核确认书,以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 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。

#### 十二、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册,包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须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的基金登记结算机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金托管人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册:《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册,并定期刻成光盘备份,保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 十八、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,除经友好协商可以解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点在北京,仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

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。

## 十六、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一)托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议,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、基金托管协议终止的情形

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、破产或有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、破产或有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。

## (二)基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 60 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

### 5、基金财产清算程序：

(1)《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估值和变现；

(4)基金清算组做出清算报告；

(5)会计师事务所对清算报告进行审计；

(6)律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7)将基金清算结果报告中国证监会；

(8)公布基金清算公告；

(9)对基金财产进行分配。

### 6、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。

### 7、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。”

## 二十二、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和代销机构提供。

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

### (一) 资料寄送

#### 1、基金账户对账单

基金管理人向发生交易的基金份额持有人以书面或电子形式定期或不定期寄送对账单。

#### 2、其他相关的信息资料

指随基金账户对账单不定期寄送的基金资讯材料,如基金新产品或新服务的相关材料、开放式基金运作情况回顾、客户服务问答等。

### (二) 红利再投资

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,注册登记机构将其所获红利按红利发放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) 定期定额投资

本基金可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务,即投资者可通过固定的代销机构,采用定期定额的方式申购基金份额,定期定额投资不受日常最低申购金额限制。定期定额具体实施时间和业务规则详见我公司发布在指定信息披露媒体及公司网站公告。

### (四) 基金转换

投资者可在同时销售转出基金、转入基金并开通基金转换业务的销售机构办理基金转换业务。基金转换需遵守转入基金、转出基金有关基金申购赎回的业务规则。办理基金转换业务的投资者可获得一定的费率优惠,具体业务规则和办理时间详见我公司发布在指定信息披露媒体及公司网站公告。

### (五) 网上交易

持有中国建设银行储蓄卡、中国农业银行金穗借记卡、兴业银行股份有限公司兴业借记卡、广东发展银行借记卡(理财通卡)、招商银行储蓄卡或浦发银行东方卡/活期账户一本通等银行卡的个人投资者,以及在华夏基金投资理财中心开户的个人投资者在与本公司达成网上交易的相关协议,接受本公司有关服务条款并办理相关手续后,即可登录本公司网站([www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)),办理

基金账户开立、基金认购、资料变更、分红方式变更、信息查询等各项业务。有关基金网上交易的具体业务规则请登录本公司网站查询。

#### (六) 电子邮件服务

投资者在申请开立本公司基金账户时如预留电子邮件地址并通过本公司网站订制电子邮件服务,可自动获得相应服务,内容包括基金份额净值、基金资讯信息、基金分红提示信息、定期基金报告和不定期公告等。未预留相关资料的投资者可办理资料变更后获得此项服务。

#### (七) 呼叫中心

##### 1、自动语音服务

呼叫中心自动语音系统提供每周7天、每天24小时的自动语音服务和查询服务,客户可通过电话查询最新公告信息、基金份额净值、基金账户余额等信息。

##### 2、人工电话服务

呼叫中心系统提供每周七天的人工服务。周一至周五的人工电话服务时间为8:30~21:00,周六至周日的人工电话服务时间为8:30~17:00(法定节假日除外)。

客户服务电话:400-818-6666

客户服务传真:010-88066511

#### (八) 网上客户服务中心

网上客户服务中心为投资者提供查询服务及资讯服务的平台。投资者可以通过网站了解公司信息、基金知识和基金业务规则,登录后,可以查询基金账户情况,更改个人信息,订制个性化服务内容。

公司网址:www.ChinaAMC.com

电子信箱:service@ChinaAMC.com

#### (九) 客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心语音留言、呼叫中心人工电话、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

## 二十三、其他应披露事项

(一) 本基金最新定期报告请见2008年8月26日公告的《华夏希望债券型证券投资基金2008年半年度报告》。



(二) 本基金管理人于 2008 年 2 月 21 日发布华夏基金管理有限公司关于运用自有资金进行基金投资的公告。

(三) 本基金管理人于 2008 年 3 月 11 日发布华夏希望债券型证券投资基金基金合同生效公告。

(四) 本基金管理人于 2008 年 3 月 22 日发布华夏基金管理有限公司公告。

(五) 本基金管理人于 2008 年 4 月 3 日发布华夏基金管理有限公司关于中国工商银行股份有限公司直销资金专户开户银行名称变更的公告。

(六) 本基金管理人于 2008 年 4 月 24 日发布华夏基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的通告。

(七) 本基金管理人于 2008 年 4 月 26 日发布华夏希望债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告。

(八) 本基金管理人于 2008 年 5 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于开通专户理财专用客户服务电话的公告。

(九) 本基金管理人于 2008 年 5 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中信银行股份有限公司为代销机构的公告。

(十) 本基金管理人于 2008 年 5 月 16 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中国建银投资证券有限责任公司为代销机构的公告。

(十一) 本基金管理人于 2008 年 5 月 30 日发布华夏基金管理有限公司关于寻找地震受灾地区基金份额持有人的公告。

(十二) 本基金管理人于 2008 年 6 月 16 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司基金定期定额及网上银行申购费率优惠活动的公告。

(十三) 本基金管理人于 2008 年 6 月 21 日发布华夏基金管理有限公司关于调整招商银行股份有限公司储蓄卡基金网上交易转换优惠费率的公告。

(十四) 本基金管理人于 2008 年 6 月 26 日发布华夏基金管理有限公司关于限制旗下部分开放式基金大额申购业务的公告。

(十五) 本基金管理人于 2008 年 6 月 30 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中国光大银行为代销机构的公告。

(十六) 本基金管理人于 2008 年 7 月 23 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国光大银行基金定期定额及网上银行申购费率优惠活动的公告。

(十七) 本基金管理人于 2008 年 8 月 9 日发布华夏基金管理有限公司公告。

(十八) 本基金管理人于 2008 年 9 月 13 日发布华夏基金管理有限公司公告。

(十九)本基金管理人于2008年9月16日发布华夏基金管理有限公司关于华夏债券投资基金、华夏希望债券型证券投资基金恢复办理正常申购业务的公告。

(二十)本基金管理人于2008年9月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下证券投资基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的提示性公告。

(二十一)本基金管理人于2008年9月17日发布华夏基金管理有限公司关于旗下证券投资基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》相关影响的公告。

#### 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和代销机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

#### 二十五、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人或基金托管人的办公场所。

(一)中国证监会核准华夏希望债券型证券投资基金募集的文件

(二)《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》

(三)《华夏希望债券型证券投资基金托管协议》

(四)法律意见书

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照

(六)基金托管人业务资格批件、营业执照

华夏基金管理有限公司

二〇〇八年十月二十五日