

# 宝盈中证100指数增强型证券投资基金招募说明书

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金的募集已于 2009 年 11 月 23 日经中国证监会证监许可【2009】1218 号《关于核准宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金募集的批复》审核同意，本招募说明书亦经过中国证监会核准，但中国证监会对本基金的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资人投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。

基金管理人的过往业绩并不预示其未来业绩。

投资有风险，投资人认购基金时应认真阅读本招募说明书。

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，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券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，由于基金投资者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基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

## 目 录

一、绪言 .....	4
二、释义 .....	5
三、基金管理人 .....	8
四、基金托管人 .....	21
五、相关服务机构 .....	24
六、基金的募集 .....	31
七、基金合同的生效 .....	33
八、基金份额的申购和赎回 .....	34
九、基金份额的非交易过户、基金份额转换与冻结与质押 .....	40
十、基金的投资 .....	41
十一、基金的财产 .....	46
十二、基金资产估值 .....	47
十三、基金的收益与分配 .....	52
十四、基金的费用与税收 .....	54
十五、基金的会计与审计 .....	56
十六、基金的信息披露 .....	57
十七、风险揭示 .....	61
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	63
二十、基金合同的内容摘要 .....	66
二十一、基金托管协议的内容摘要 .....	82
二十二、对基金份额持有人的服务 .....	88
二十三、其它应披露事项 .....	90
二十四、招募说明书的存放及其查阅方式 .....	91
二十五、备查文件 .....	92

## 一、绪言

《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书》(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》及其他有关规定以及《宝盈中证 100 指数增强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。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。基金合同的当事人应按照《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

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金
2. 基金管理人：指宝盈基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书：指《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7. 基金份额发售公告：指《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金份额发售公告》
8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10. 《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
14. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
15. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
16. 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
17. 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
18. 合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市

场的中国境外的机构投资者

19. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

22. 销售机构：指直销机构和代销机构

23. 直销机构：指宝盈基金管理有限公司

24. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

26. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

27. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为宝盈基金管理有限公司或接受宝盈基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

28. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

30. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

33. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35. T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

36. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

37. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39. 《业务规则》：指《宝盈基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所

管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

40. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

41. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

43. 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公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

44. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

45. 定期定额投资计划：指投资人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人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

46. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

47. 元：指人民币元

48. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

49. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

50. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

53. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

54. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

##### 1、基金管理人基本情况

名称：宝盈基金管理有限公司

注册地址：深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层

成立时间：2001 年 5 月 18 日

法定代表人：李建生

总经理：陆金海

办公地址：深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层

注册资本：10000 万元人民币

电话：0755—83276688

传真：0755—83515599

联系人：葛俊杰

##### 2、基金管理人股权结构及组织结构

本基金管理人是经中国证监会证监基金字[2001]9 号文批准发起设立，现有股东包括中铁信托有限责任公司、成都工业投资集团有限公司、中国对外经济贸易信托有限公司。其中中铁信托有限责任公司持有本公司 49%的股权，成都工业投资集团有限公司持有 26%的股权，中国对外经济贸易信托有限公司持有 25%的股权。

公司下设十七个部室，分别是投资部、研究部、海外投资部、金融工程部、集中交易室、特定客户资产管理部、市场部、华北营销中心、华东营销中心、华南营销中心、电子商务部、基金运营部、监察稽核部、公司财务部、总经理办公室、北京办事处和上海办事处；此外，还设立了投资决策委员会、风险控制委员会和信息技术治理委员会。

公司以“规范管理求效益、诚信创新谋发展、回报和服务创品牌”为经营理念，坚持“诚实守信、勤勉尽责”的企业精神，立足专业、追求卓越，致力于开拓基金及证券市场业务，为基金份额持有人谋取更大利益。

#### (二) 证券投资基金管理情况

截至 2009 年 9 月 30 日，本基金管理人共管理一只封闭式证券投资基金：基金鸿阳；七只开放式证券投资基金：宝盈鸿利收益证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金、宝盈资源优选股票型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金。

### (三) 主要人员情况

#### 1、公司高级管理人员

##### (1) 董事会:

李建生女士，董事长，1954年生，中共党员，本科。曾在黑龙江建设兵团、铁道部基建总局工作。1989年始历任中国铁路工程总公司副处长、高级会计师、副总会计师，现任中铁信托有限责任公司董事长，中国中铁股份有限公司副总裁、财务总监兼总法律顾问。

景开强先生，董事，1958年生，硕士研究生，高级会计师。1985年7月至1989年10月在中铁二局机筑公司广州、深圳、珠海项目部任职，历任助理会计师、会计师、财务主管；1989年11月至2001年4月在中铁二局机筑公司财务科任职，历任副科长、科长、总会计师；2001年5月至2003年10月在中铁二局股份公司任财会部部长，中铁二局集团专家委员会财务组组长；2003年11月至2005年10月在中铁八局集团公司任总会计师、总法律顾问、集团公司专家委员会成员；现任中铁信托有限责任公司总经理。

陈赤先生，董事，1966年生，中共党员，经济学博士。1988年7月至1998年5月任西南财经大学公共与行政管理学院教研室副主任；1998年5月至1999年3月在四川省信托投资公司人事部任职；1999年3月至2000年10月在四川省信托投资公司峨眉山办事处任总经理助理，2000年10月至2003年6月在和兴证券有限责任公司工作；2003年6月开始任衡平信托投资有限责任公司总裁助理兼研究发展部总经理，现任中铁信托有限责任公司副总经理兼董事会秘书。

钟鸣先生，董事，1974年生，MBA毕业。曾任中山新艺电子有限公司总经理特别助理、成都电子研究所研究室主任。现任成都工业投资集团有限公司副总经理。

张一冰女士，董事，1967年生，中共党员，陕西财经学院硕士。1989年7月起，在中国华大理工技术公司计财部任职；1990年5月至1999年5月，在中国对外经济贸易信托投资公司计财部、综合部和证券部任职；1999年6月，任香港第一太平银行投资银行部副总裁；2001年4月起，在中国对外经济贸易信托投资公司先后担任投资银行部、稽核法律部总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部总经理。

曾康霖先生，独立董事，1938年生，中共党员，西南财经大学教授。1951年至1956年，在四川省泸县税务局工作；1956年至1960年，在西南财经大学学习；1960年至今，在西南财经大学任教，现任西南财经大学中国金融研究中心名誉主任，博士生导师。

陈雨露先生，独立董事，1966年生，中共党员，中国人民大学博士，教授。1989年起，历任中国人民大学教师、副教授、教授、财政金融系主任助理、副主任、财政金融学院常务副院长、院长，现任中国人民大学副校长。

陈小悦先生，独立董事，1947年生，清华大学汽车工程专业博士。1988年至1990年在清华大学经济管理学院任党委副书记、讲师、院长助理；1990年至1992年，在加拿大西安大略

大学商学院进修；1992年至今，在清华大学经济管理学院任职，历任院长助理、副教授、财务与金融研究组主任、副院长、会计系系主任、教授、博士生导师，其中2000年8月至2007年1月兼任清华大学会计研究所所长；1999年5月至2007年1月在北京国家会计学院，历任副院长、院长；2007年1月至今任清华大学会计研究所所长。

陆金海先生，董事，总经理，1970年生，中共党员，厦门大学金融专业经济学博士。1999年9月至2001年10月，在清华大学经济管理学院会计系开展博士后研究工作。2001年10月起就职于南方基金管理公司，历任金融工程部总监、信息技术部总监、投资策略与风险控制部总监。2006年4月起任宝盈基金管理有限公司总经理。

## （2）监事会

王慧女士，监事长，1965年生，MBA。1986年8月至1990年6月在四川师范大学化学系任教。1990年6月至1997年6月在蜀都大厦股份公司并负责销售业务。1997年6月至2001年9月在成都托管有限公司工作，担任办公室主任、资产经营部经理、副总经理。2001年9月至2009年6月在成都工业投资集团有限公司工作并担任常务副总经理，现任成都银行副行长。

王连洲先生，独立监事，1939年生，副研究员。1964年至1983年，在中国人民银行印制局工作，曾担任计划处副处长；1983年至2000年，在全国人大财经委员会工作，主要从事金融立法，先后担任办公室财金组副组长、组长、办公室副主任、研究室巡视员。2000年11月退休。

杨凯先生，员工监事，1974年生，中山大学岭南学院MBA。2003年7月至今，在宝盈基金管理有限公司工作，先后担任市场部总监助理，市场部总监。目前，其担任宝盈基金管理有限公司总经理助理、特定客户资产管理部总监。

## （3）其他高级管理人员

于志先生，副总经理，1963年生，中共党员，硕士。1988年至1990年，中国中化集团总公司储运部；1990年至1991年，新加坡海皇船务公司租船部高级执行人员；1991年至1994年，中国中化集团石油投资部部门经理；1994年至2000年，中化巴哈马石油有限公司副总经理；2000年至2002年，宝盈基金管理有限公司基金经理助理；2002年至2005年，香港中化汇富资产管理公司副总经理；2005年至2006年，中国对外经济贸易信托投资公司证券部副总经理。2006年10月加入宝盈基金管理有限公司，现任公司副总经理。

胡东良先生，副总经理，1963年生，中共党员，硕士。1988年7月至1994年2月，在北京农业大学农业经济与管理学院任教；1994年2月至2003年6月，历任南方证券投资银行业务部北京分部项目经理、上海分公司投资银行部副经理、投资银行业务总部总经理助理、投资银行业务总部副总经理兼北京部总经理；2003年6月至2007年3月，汉唐证券有限公司副总裁；2007年4月加入宝盈基金管理有限公司任总经理助理。2009年1月起任公司副总经理。

刘传葵先生，督察长，1968年生，民革党员，经济学博士，高级经济师，深圳市政府特殊津贴专家。1990年7月—1992年8月，中国人民银行赣州市支行干部、团支书；1994年5月—1997年10月，深圳投资管理公司总裁秘书、研究部总助；1997年11月—2000年5月，广发证券发展研究中心（深圳）负责人；2000年5月—2002年3月，平安证券综合研究所副所长；2002年10月—2004年5月，长信基金研究总监、市场发展总部总监；2004年5月至今，历任宝盈基金管理有限公司首席经济师兼研究部总监、首席经济师兼监察稽核部总监；2007年5月起代为履行宝盈基金管理有限公司督察长职责；2007年7月起担任宝盈基金管理有限公司督察长。

## 2、基金经理简历

温胜普先生，1981年1月生。经济学硕士，2006年7月加入宝盈基金管理有限公司，任金融工程部风险管理岗。

## 3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

陆金海先生：宝盈基金管理有限公司总经理。

高峰先生：宝盈基金管理有限公司总经理助理。

陆万山先生：宝盈基金管理有限公司投资执行总监、宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理。

余述胜先生：宝盈基金管理有限公司研究部总监、宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理。

杨宏亮先生：宝盈基金管理有限公司金融工程部总监、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈资源优选股票型证券投资基金基金经理。

夏和平先生：宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理。

陈若劲女士：宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理。

## （四）基金管理人职责

根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定，本基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制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、中国证监会规定的其他职责。

#### （五）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》禁止的行为发生：

- (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) 向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄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；

- (8) 除按本公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；

- (9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 故意损害基金投资人及其它同业机构、人员的合法权益；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 信息披露不真实，有误导、欺诈成分；
- (15) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### (六) 基金管理人的内部控制制度

公司内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

为保证公司规范、稳健运作，有效防止和化解公司经营过程中的风险，最大程度保护基金持有人的合法权益，根据《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规及《宝盈基金管理有限公司章程》，制定《宝盈基金管理有限公司内部控制大纲》，作为公司经营管理的纲领性文件，是制定各项规章制度的基础和依据。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

#### 1、内部控制目标

公司实行内部控制的目标是：

- (1) 保证公司经营管理的合法合规性；
- (2) 保证基金持有人和资产委托人的合法权益不受侵犯；
- (3) 实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；
- (5) 保护公司最重要的资本：公司声誉。

#### 2、内部控制原则

公司内部控制遵循以下原则：

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

(2) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(3) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；

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

(5) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行修改和完善。

### 3、公司内部控制制度体系及管理

公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务的需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，后者的内容不得与前者相违背。

公司各项制度的制订必须满足以下几个要求：

- (1) 符合国家法律、法规和监管部门的有关规定；
- (2) 符合公司业务发展的需要；
- (3) 符合全面、审慎、适时性原则；
- (4) 授权、监督、报告、反馈主线明确；
- (5) 权利与职责、考核、奖惩相对应。

公司董事会下设风险控制委员会，负责公司整体风险控制的目标和政策，监督风险控制措施的落实情况，并对公司日常经营、高级管理人员行为的合法合规性进行评估。同时，公司设督察长、总经理下设风险控制委员会、监察稽核部定期对公司制度进行检查、评价，并出具专题报告。督察长的专题报告报董事会，董事会向公司总经理提出修改意见，并由总经理负责落实。总经理下设风险控制委员会、监察稽核部的报告报公司总经理，总经理向有关机构、部门提出修改意见，由相关机构和部门负责落实。各机构、各部门定期对涉及到本机构、本部门的制度进行检查和评价，并负责落实有关事项。

### 4、内部控制基本内容

公司内部控制的内容包括环境控制、业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计

系统控制、监察稽核控制以及其他方面控制。

#### (1) 公司环境控制

公司环境控制主要包括治理结构控制、授权控制、内部交易控制和关联交易控制等。

①治理结构的控制是指公司建立健全科学的法人治理机构，主要内容为：严格按照现代企业制度的要求，建立符合公司发展需要的健全的组织结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，保护投资者利益和公司合法权益；建立决策科学、运营规范、管理高效的运营机制，包括建立民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统；建立相互监督、相互制约的部门、岗位及业务流程，形成严密有效的内控防线。

②公司业务授权制度主要包括：股东会、董事会和监事会必须充分履行各自职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行。公司章程对股东会、董事会和监事会的职权范围和运作方式，对董事、监事的职责作了明确规定，保证了股东会、董事会和监事会有效运作；公司实行董事会领导下的总经理负责制，公司各部门在总经理授权范围内行使相应职能。公司制定了总经理工作细则，对总经理的权限、工作方式、总经理决定的执行和反馈等作了明确规定，公司各部门均向总经理负责；各项业务和管理程序必须遵守管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须在其业务授权范围内进行。

③公司内幕交易控制主要内容包括：对内部交易行为的范围作明确规定，明确禁止内幕交易行为的发生。公司投资管理制度明确禁止内幕交易，监察稽核部对此定期进行检查；公司加强对员工职业道德教育和对员工行为的检查，防止违反监管机构关于基金从业人员行为的规范，或公司员工行为准则的行为；建立集中交易制度、防火墙制度、信息控制制度和投资限制制度等，防止基金投资中内幕交易的发生；建立和完善电脑监控系统，由监察稽核部实时监控基金的投资和交易活动，尤其是大额买卖和频繁买卖现象。

④公司关联交易控制主要内容包括：健全公司治理结构，建立合理的决策程序，充分发挥独立董事的作用。公司规定关联交易需经股东会多数同意，并需独立董事同意；严格分离公司自有资金和基金资金的运作，由监察稽核部定期跟踪公司自有资金运用情况，避免利益冲突的发生；加强投资过程中关联交易的控制，通过设置股票投资限制名单、利用电脑系统加强对投资行为的控制等措施，防止侵害基金投资人合法权益和公司利益的关联交易。

#### (2) 业务控制

业务控制是指以公司开展的各项业务为对象的控制，主要包括投资管理业务控制和市场开发业务控制。

##### ①投资管理业务控制

投资管理是公司的主要业务，为此公司根据《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作

办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等国家有关法律法规，按照投资管理业务的性质和特点，并结合公司具体情况，制定了严格的管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示了不同业务可能存在的风险点并应当采取的控制措施。

公司投资管理业务控制主要包括研究业务控制、投资决策业务控制、基金交易业务控制等。

研究业务控制的主要内容包括：研究工作应保持独立、客观，为此公司独立设立研究部，在组织架构上保证其独立性；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；公司在多年积累的基础上，集合全体研究员的智慧，归纳和总结出《宝盈基金行业和上市公司研究指引》，作为公司研究的指导；根据基金合同要求和各基金的投资风格，在充分研究的基础上建立了公司股票池，并建立各基金的股票备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系：公司对研究报告的要求做到客观、独立，并结合其质量和数量，以及基金经理对研究报告的评价进行综合考核。

投资决策业务控制主要内容包括：投资决策须严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求；健全投资决策授权制度，明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策；公司实行投研团队负责制，通过建立基于投资决策委员会、投资人员、研究人员、风险管理人员四位一体的客观化投资研究平台、相互制衡的决策机制，强调团队协作，减少主观判断失误，确保投资的客观化。公司基金管理的最高决策机构为投资决策委员会，由 5 人以上单数构成，其表决机制为集体决策、有效制衡，主任委员有一票否决权；基金经理的投资权限有严格限定，必须按投资决策委员会决定的资产配置构建组合，重大投资项目还需根据其投资权限经过投资决策委员会或其执行委员批准；集中交易室和监察稽核部则对投资权限制度实行有效的监控；投资决策应当有充分的投资依据，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持，并有决策记录；公司投资管理制度要求重大投资项目必须有公司内部研究报告支持，并经投资决策委员会或其执行委员批准。上述过程均要求以书面形式进行，相关记录要求永久保存；建立投资风险评估与管理制，在设定的风险权限额度内进行投资决策；建立科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

基金交易业务控制主要内容包括：基金交易实行集中交易制度，公司设立集中交易室，基金投资的所有交易均需通过集中交易室进行，基金经理不得直接进行交易；同时，公司在集中交易室设集中接单员，基金经理的交易指令均需通过集中接单员统一接收和分配，从而防止了可能的交易违规行为；公司建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；公司在交易环节已建立预警机制，并设定了基金交易的限制措施，超过交易权限的，系统自动禁止执行。交易员每日向基金经理反馈交易信息，发现异常情况的，则向监察稽核部和投资总监报告；投资指令应当进行审核，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法

违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员；公司执行公平的交易分配制度，确保不同投资者的利益能够得到公平对待；公司交易系统设定的交易原则为“时间优先、价格优先”；在时间、价格均相同的情况下，则采用公平交易机制，从而保证了公平对待各基金；建立完善交易记录制度，每日投资组合列表等应当及时核对并存档保管；公司对场外交易、网下申购等特殊交易制定了相应的流程和规则。

## ②市场开发的业务控制

主要内容包括：建立明确的职责分工，实行岗位分离制度，保证各项业务的有效性和可靠性，同时加强内部制衡机制，防止错误和舞弊行为发生；完善产品设计流程，新产品开发必须符合国家法律、法规的规定，新产品推出前应进行充分的可行性论证，进行风险识别，提出风险控制措施，并按决策程序报批；制定基金销售的标准化流程，并选用先进的电子销售系统，不断提供基金销售的服务质量和避免差错的发生。制定统一的客户资料和销售资料管理制度，妥善保管各类资料，并对客户资料严格保密；制定注册登记业务规则和工作流程，做好账户管理工作，加强对交易与非交易过户的注册登记过户，加强对账户、注册登记资料的管理，加强对有关账户、注册登记信息的传递管理。

## (3)信息披露控制

按照法律、法规和中国证监会有关规定，公司建立了完善的信息披露制度，由监察稽核部指定专人进行信息的组织、审核和发布，保证了公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

## (4)信息技术系统控制

根据国家有关法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，公司制定了严格的信息系统的管理规章、操作流程、岗位手册和风险控制制度。

公司信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写完整的技术资料；公司的办公系统和交易系统等均设定了不同的权限，并根据员工岗位授予不同权限。同时公司通过内外网分离制度、防火墙制度等管理措施，确保系统安全运行。公司计算机机房、设备、网络等硬件要求应当符合监管机构的有关标准。基金运营部建立了设备运行和维护责任制，严格划分业务操作、技术维护等方面的职责，从而保证了系统的完全、稳定运行。

公司规定信息技术系统设计、软件开发等技术人员的权限仅限于系统维护，不得介入实际的业务操作，并要求其密码口令定期更换，数据库和操作系统的密码口令则分别由不同人员保管。

信息数据涉及到基金投资信息和投资人个人信息，属公司重要机密材料。为此，公司制定了相应的信息数据管理制度，确保信息数据的安全、真实和完整；相关信息要求每日备份，计算机交易数据的授权修改程序需经部门负责人和监察稽核部同意。

对电子信息系统控制包括：

①电子信息系统的的项目立项、设计、开发、测试、运行和维护整个过程实施明确的责任管理，严格划分软件设计、业务操作和技术维护等方面的职责；

②强化电子信息系统的相互牵制制度，建立系统设计、软件开发等技术人员与实际业务操作人员相互独立制；

③建立计算机系统的日常维护和管理，禁止同一人同时掌管操作系统口令和数据库管理系统口令；

④建立电子信息系统的安全和保密制度，保证电子信息数据的安全、真实和完整，并能及时、准确的传递到各职能部门；

⑤严格计算机交易数据的授权修改程序，建立电子信息数据的定期查验制度；

⑥指定专人负责计算机病毒防范工作，建立定期病毒检测制度等。

#### (5) 会计系统控制

依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律法规，公司制订了基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，从而建立了对各个风险控制点的会计系统控制。

公司会计部门严格贯彻岗位分离、人员分离制度，在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责，严禁需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程。

公司管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，从而保证了不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。同时，公司基金会计核算独立于公司会计核算。

公司主要通过以下会计控制措施确保会计核算系统的正常运转：

凭证制度：通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任。

账务组织和账务处理体系：正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序。

复核制度：重要信息要求双人复核，以防止会计差错的产生。

#### (6) 监察稽核控制

公司设立督察长，负责组织指导公司的监察稽核工作，对董事会负责。督察长经董事会聘任，其任免需报中国证监会核准。

为保证督察长切实履行职责，公司规定督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。同时，督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

公司设立监察稽核部，具体开展监察稽核工作，对总经理负责。为保证监察稽核部切实履行职责，公司制定了监察稽核制度，对监察稽核的操作程序和组织纪律等作了明确规定。监察

稽核部定期向管理层和中国证监会报告内部控制制度的执行情况，发现违规行为及时报告。

#### 5、内部控制措施

内部控制措施是落实公司风险控制理念，确保公司运作和基金投资合法合规的重要环节，为此公司根据现有业务环节，制定了一整套内部控制措施，主要包括：

为落实“自上而下”再“自下而上”的风险控制理念，管理层承诺对风险控制负有全部责任，确保公司制定的各项内控制度应适用于公司所有部门、业务环节及岗位，并能贯彻执行。

为落实“全员参与”理念，公司明确划分了各岗位职能权职，层层落实控制措施：

①投资决策、投资执行、交割、评价由不同部门负责，以达到层层控制的效果。

②重要的交易事项由交易主管复核，确保其正确与安全。

对公司风险控制制度、程序通过不同形式、不同层面的培训，使公司员工熟知并采用：

①订立切实可行的内控制度与标准运用程序。

②对员工进行风险控制培训。

③在公司办公系统公布公司规章及信息库，方便员工取阅参考。

④加强员工风险意识培训，培养其对风险的高度敏感性。

建立管理风险的关键指标监控系统：

①定期检查内部控制制度执行情况时，对于不符规定或未达控制标准的事项作持续的跟踪。

②通过检查内部控制制度的执行情况，对内部控制制度定期作自我评估，审查各业务程序是否符合现实情况的要求，并随时修正。

建立独立的内部与外部稽核制度：

①设立独立的监察稽核部门，制定稽核制度，并由专人负责实施。

②必要时，公司可通过会计师事务所等专业机构进行外部稽核，推动公司风险控制的不断完善。

建立信息保密制度：

①公司建立严格的防火墙制度，尤其是公司的投资研究部门、会计清算部门和信息技术部门，要求对掌握的基金投资和投资人信息严格保密，从而维护投资人权益。

②非业务相关人员，不得取阅客户或基金管理的相关资料。

③交易时间内严禁基金经理、交易员等与投资业务有关的人员使用个人的通讯设备，移动电话须交监察稽核部统一保管。

建立危机处理机制：

①制定危机处理计划，并通过演练确保其可行性。

②成立危机处理领导小组和工作小组，保证危机处理计划的有效执行。

③根据行业和公司业务发展，定期检查危机处理计划的可行性和有效性。

6、基金管理人关于内部控制制度声明

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆千元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：HK0939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000 股(包括 224,689,084,000 股 H 股及 9,000,000,000 股 A 股)。

2008 年，中国建设银行的综合盈利能力和资产质量继续同业领先，截止 2008 年 12 月 31 日，中国建设银行实现净利润 926.4 亿元，较上年增长 34%；平均资产回报率为 1.3%，平均股东权益回报率为 20.7%，分别较上年提高 0.16 个百分点和 1.18 个百分点，居全球银行业最好水平；每股盈利为 0.4 元，比上年增长 0.10 元；总资产达到 75,554.52 亿元，比上年增长 14.51%；资产质量稳步上升，不良贷款额和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为 2.21%，较上年下降 0.39 个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为 131.58%，较上年提升 27.17 个百分点。

中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约、悉尼设有代表处，纽约分行、伦敦子银行正式

获颁营业执照。中国建设银行在香港拥有建行亚洲和建银国际两家全资子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）31,896 台，居全球银行业首位。

2008 年，中国建设银行在英国《金融时报》公布的「全球 500 强」中列第 20 位；在美国《财富》杂志公布的全球企业 500 强中由上年的第 230 位上升至第 171 位；被《福布斯（亚太版）》评为“亚太地区最佳上市公司 50 强”；被《银行家》杂志评为“中国商业银行竞争力（财务指标）第一名”和“最佳商业银行”；被美国《环球金融》杂志评为“最佳公司贷款银行”和“最佳按揭贷款银行”；荣获香港上市公司商会“公司管治卓越奖”、《亚洲银行家》杂志“零售风险管理卓越奖”、中国民政部颁发的“中华慈善奖-最具爱心内资企业奖”和香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”等奖项。

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

## （二）主要人员情况

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

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

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

截止到 2009 年 9 月 30 日，中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等 6 只封闭式证券投资基金，以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华一道琼斯 88 指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票（LOF）、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、

上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合（LOF）、华夏中小板 ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票（LOF）、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票（LOF）、华宝兴业行业精选股票、工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票（QDII）、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票（QDII）、海富通中国海外股票（QDII）、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信 2026 周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票（QDII）、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票（LOF）、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合、长城双动力股票、上投摩根中小盘股票、华商收益增强债券、泰达荷银品质生活股票、光大保德信均衡精选股票、银河行业优选股票、海富通领先成长股票、诺德增强收益债券、工银瑞信沪深 300 指数、信诚经典优债债券、国泰双利债券、民生加银品牌蓝筹混合、信达澳银稳定价值债券、中欧稳健收益债券、万家精选股票、浦银安盛精致生活混合、长盛同庆可分离交易股票、富国优化增强债券、长城景气行业龙头混合、天治趋势精选混合、民生加银增强收益债券、中欧价值发现股票、长信恒利优势股票、宝盈货币、博时策略混合、信诚优胜精选股票、易方达沪深 300 指数、中银中证 100 指数、鹏华精选成长股票、金元比联价值增长股票、诺德成长优势股票、大摩领先优势股票、农银汇理策略价值股票、华宝兴业中证 100 指数、华安上证 180ETF 联接等 124 只开放式证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业

务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

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

### （二）监督流程

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

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

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

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

1、直销机构：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 20 层 D 区

法定代表人：李建生

电话：0755-83276688

传真：0755-83515880

联系人：方仲姬

## 2、代销机构

(1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

客户服务电话：95533

公司网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

客户服务电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市海淀区复兴路甲 23 号

客户服务电话：95599

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

(4) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

客户服务电话：95559

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

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

客户服务电话：95555

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

(6) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

客户服务电话：010-96169（北京） 022-96269（天津） 021-53599688（上海）

公司网址：<http://www.bankofbeijing.com.cn>

(7) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

客户服务电话：40066-99999

公司网址: <http://www.18ebank.com/>

(8) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区商城路618号

客户服务电话: 4008888666

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

(9) 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市新中街68号

客户服务电话: 4008888108

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

(10) 招商证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层

客户服务电话: 95565

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

(11) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路98号

客户服务电话: 4008888001

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

(12) 申银万国证券股份有限公司

注册地址: 上海市常熟路171号

客户服务电话: 021-962505

公司网址: [www.sywg.com.cn](http://www.sywg.com.cn)

(13) 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特8号长江证券大厦

客户服务电话: 4008888999

公司网址: [www.cjsc.com.cn](http://www.cjsc.com.cn)

(14) 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

客户服务电话: 0755-82825555

公司网址: [www.essences.com.cn](http://www.essences.com.cn)

(15) 中信金通证券有限责任公司

注册地址: 浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

客户服务电话: 0571-96598

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

(16) 万联证券有限责任公司

注册地址: 广州市中山二路18号电信广场36—37层

客户服务电话: 4008888133

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

(17) 渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市河西区宾水道3号

客户服务电话: 022-28455588

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

(18) 中信万通证券有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区香港东路316号

客户服务电话: 96577

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

(19) 东吴证券有限责任公司

注册地址: 江苏省苏州市爱河桥路28号

客户服务电话: 0512-96288

公司网址: [www.dwjq.com.cn](http://www.dwjq.com.cn)

(20) 东方证券股份有限公司

注册地址: 上海市中山南路318号2号楼

客户服务电话: 021-962506

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

(21) 国联证券有限责任公司

注册地址: 江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层

客户服务电话: 0510-82588168

公司网址: [www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(22) 浙商证券有限责任公司

注册地址: 浙江省杭州市杭大路1号

客户服务电话: 95105665

公司网址: [www.stocke.com](http://www.stocke.com)

(23) 平安证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦

客户服务电话: 95511

公司网址: [www.xmpb.com](http://www.xmpb.com)

(24) 东海证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

客户服务电话: 0519-8166222

公司网址: [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(25) 宏源证券股份有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐建设路2号

客户服务电话: 010-62294600

公司网址: [www.ehongyuan.com](http://www.ehongyuan.com)

(26) 齐鲁证券有限公司

注册地址: 山东济南市经十路128号

客户服务电话: 95538

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

(27) 第一创业证券有限责任公司

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场 B 座26层

客户服务电话: 0755-25832686

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

(28) 金元证券有限责任公司

注册地址: 海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

客户服务电话: 4008888228

公司网址: [www.jyzq.com.cn](http://www.jyzq.com.cn)

(29) 江南证券有限责任公司

注册地址: 江西省南昌市抚河北路291号

客户服务电话: 0791-6768763

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

(30) 厦门证券有限公司

注册地址: 厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

客户服务电话: 0592-5163588

公司网址: [www.xmzq.com.cn](http://www.xmzq.com.cn)

(31) 世纪证券有限责任公司

注册地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦41层

客户服务电话: 0755-83199599

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

(32) 中国国际金融有限公司

注册地址: 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

客户服务电话: 010-85679238

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

(33) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

客户服务电话: 4008008899

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

(34) 广发华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层

客户服务电话: 0591-96326

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

(35) 天相投资顾问有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701

客户服务电话: 010-66045666

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

(36) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼

客户服务电话: 4008888788

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

## (二) 注册登记机构

注册登记人名称: 宝盈基金管理有限公司

住所: 深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层

法定代表人: 李建生

电话: 0755-83276688

传真: 0755-83515509

联系人: 陈静瑜

## (三) 律师事务所和经办律师

律师事务所名称: 广东华瀚律师事务所

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗东路宝安广场 A 座 16 楼 G、H 室

办公地址: 深圳市罗湖区笋岗东路宝安广场 A 座 16 楼 G、H 室

法定代表人：李兆良

经办律师：杨忠、戴瑞冬

电话：0755-82687860

传真：0755-82687861

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：汪棣、单峰

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人宝盈基金管理有限公司依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，本次募集已经中国证监会证监许可【2009】1218号《关于核准宝盈中证100指数增强型证券投资基金募集的批复》核准。

### （一）基金类别

股票指数型。

### （二）基金存续期

不定期。

### （三）基金份额发售面值

本基金每份基金份额发售面值为1.00元。

### （四）基金募集期

自基金份额发售之日起至基金募集结束之日，但最长不得超过3个月，具体发售时间见发售公告。

### （五）募集场所及方式

本基金通过基金管理人直销网点与中国建设银行股份有限公司等代销机构相关营业网点公开发售。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

具体销售城市名单和联系方式请见《宝盈中证100指数增强型证券投资基金份额发售公告》。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤消。本基金代码为：“213010”。

### （六）发售对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律法规禁止投资证券投资基金的除外）及合格境外机构投资者。

### （七）预期募集规模

本基金最低募集规模为2亿份基金份额，不设最高募集规模上限。

### （八）认购费用

认购金额 M	认购费率
M<100 万	1%

100 万 $\leq$ M<300 万	0.6%
300 万 $\leq$ M<500 万	0.2%
500 万 $\leq$ M	固定费用 1000 元

#### （九）基金认购份额的计算

本基金认购采用金额认购的方式。最低认购金额为1000元。认购份额采用四舍五入的方法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。认购款项在认购期间存入专门账户，期间产生的利息将折算为基金份额归基金持有人所有，其中利息以注册登记人的记录为准。

本基金认购份额的计算如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{利息}) / \text{基金份额初始面值}$$

例：某投资人投资100,000元认购本基金，对应认购费率为1%，假设该笔认购产生利息50元，则其可得到的认购份额为：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 1\%) = 99,009.90 \text{元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 \text{元}$$

$$\text{认购份额} = (99,009.90 + 50) / 1.00 = 99,059.90 \text{份}$$

#### （十）基金认购程序及认购金额的限制

基金投资人可在基金募集期间的任一交易日到基金销售网点认购本基金，首次认购之前必须持有效证件先开立宝盈基金管理有限公司基金账户和销售网点交易账户，并持银行划款单据在该销售网点填写《宝盈开放式基金交易类业务申请表》办理基金认购手续。

在基金募集期内，投资者可多次认购基金份额，首次认购的最低金额为人民币 1000 元，每次追加认购的最低金额为人民币 1000 元。

#### （十一）募集期间认购资金利息的处理方式

投资者的认购资金在基金募集期形成的利息，在基金合同生效时折算成基金份额，归投资者所有。其中利息的具体金额，以本基金的注册登记机构计算并确认的结果为准。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金募集期内，在基金募集总份额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币，且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在聘请法定验资机构验资后向中国证监会办理基金备案手续。

基金管理人在募集期间达到基金的备案条件，办理完毕基金备案手续后，基金合同生效；否则基金合同不生效。本基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入商业银行，不得动用。认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

若本基金在募集期间未能达到基金合同的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人应承担全部募集费用，并将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在募集期结束后 30 天内退还基金认购人。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金合同生效后的存续期内，有效基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 八、基金份额的申购和赎回

### （一）申购、赎回场所

本基金的销售机构包括本基金管理人和本基金管理人委托的基金代销机构。

投资者应当在本基金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。

### （二）申购、赎回办理时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的时间（即开放日）为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。在开放日的具体业务办理时间由基金管理人与销售机构约定后另行公告。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整，但此项调整不应投资者利益造成实质影响。基金管理人将有关调整的公告同时报中国证监会备案，并在实施日3个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### 2、申购的开始时间

自基金合同生效日起不超过三个月开始办理申购。

#### 3、赎回的开始时间

自基金合同生效日起不超过三个月开始办理赎回。

4、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开放日3个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

## 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记结算机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

## 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

### (五) 申购与赎回的数额限制

基金投资者每次申购本基金，最低申购金额为 1000 元。

基金份额持有人可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，单笔赎回最低份数为 500 份，若某投资人在该销售网点托管的基金份额不足 500 份或某笔赎回导致该持有人在销售网点托管的基金份额少于 500 份，则全部基金份额必须一起赎回。

基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，调整结果必须至少在 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### (六) 基金的申购费与赎回费

#### 1、申购费用

根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》的规定，基金申购费用是支付给基金销售机构的手续费，按申购金额的一定比例收取，由投资人承担，不列入基金资产。本基金在申购时收取申购费用，申购费率按申购金额的增加而递减。

具体费率如下：

申购金额 M	申购费率
M<100 万	1.2%
100 万≤M<300 万	0.8%
300 万≤M<500 万	0.3%
500 万≤M	固定费用 1000 元

基金管理人有权规定投资人在赎回基金份额时收取该部分基金份额的申购费用，具体办理规则和费率由基金管理人届时在公告或更新的招募说明书中明确后执行。

## 2、赎回费用

本基金的赎回费用按持有期递减，最高不超过赎回总金额的 0.50%。赎回费用的 75%作为注册登记费，剩余 25%留作基金资产。具体费率如下：

赎回期限 (N)	赎回费率
N < 1 年	0.5%
1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
N ≥ 2 年	0

3、基金管理人在法律法规规定的范围内调整申购、赎回费率的，应事先报中国证监会核准或备案。基金管理人在经中国证监会核准或备案后，应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日通知基金托管人并在至少一种指定报刊和网站公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(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必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## (七) 申购份额与赎回金额的计算

### 1、本基金申购份额的计算：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

例：某投资者投资 10 万元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 = 100,000 / (1 + 1.2%) = 98,814.23 元

申购费用 = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 元

申购份额 = 98,814.23 / 1.016 = 97,258.10 份

### 2、本基金赎回支付金额的计算：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

例：某投资者赎回 10,000 份本基金，假设赎回当日的基金份额净值为 1.056 元，持有期不足一年，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额 = 10,000 × 1.056 = 10,560 元

赎回费用 = 10,560 × 0.5% = 52.80 元

净赎回金额=10,560-52.80=10,507.20元

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金份额净值的计算，保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入。具体计算公式为：

基金份额净值 = 基金资产净值 / 发行在外的基金份额总份数。

4、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

#### （八）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记人在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，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，注册登记人在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，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个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 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。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开

放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤消。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，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：当发生巨额赎回并决定采取顺延赎回措施时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式，在三个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上予以公告。

本基金连续两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，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近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，基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

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。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回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) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常工作。
- (2) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- (4) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

(5) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常工作。
- (2) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- (3) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- (4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- (5) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### (十一) 基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

#### (十二) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 九、基金份额的非交易过户、基金份额转换与冻结与质押

### （一）基金份额的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记结算机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及登记结算机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记结算机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记结算机构的规定办理，并按基金登记结算机构规定的标准收费。

### （二）基金份额的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

（三）基金登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记结算机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（四）根据相关法律法规的规定，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

## 十、基金的投资

### (一) 投资目标

在基金合同规定的范围内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%、基金总体投资业绩超越中证 100 指数的表现。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证 100 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### (三) 投资策略

本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。

#### 1、资产配置策略

本基金将不低于 80% 的基金资产投资于中证 100 指数成份股和备选成分股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。

本基金将根据市场的实际情况，在基金合同规定的范围内适当调整主动投资部分基金资产的配置比例，以争取实现对标的指数的超越。

#### 2、股票投资策略

##### (1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，指数化投资部分将按照中证 100 指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略，通过公司内部的数量化选股模型，选出流动性高投资价值好的品种，预期股票市场向上时对该类品种进行积极配置，预期股票市场向下

时对股票进行低配或者不配并视情况适当提高固定收益类产品的配置。

## （2）指数化投资部分股票组合的调整

本基金所构建的指数化投资部分股票投资组合将根据中证100指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对该部分股票投资组合及时进行调整。

### 2) 不定期调整

①如果预期目标指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否提前纳入部分备选成份股；

②当成份股发生配股、增发、分红等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时该部分调整股票投资组合；

③根据本基金的申购和赎回情况，对该部分股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

④因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素，使得本基金无法依照目标指数权重购买某成份股。本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否买入相关的替代性股票；

⑤根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时调整，并相应对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运作；

⑥根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，并在法律法规允许的范围之内辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

## （3）主动投资部分股票组合的调整

### 1) 在成份股内进行有限度调整。

本基金通过公司内部的数量化选股模型，判断成份股的流动性和投资价值。综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，本基金将有限度地对成份股进行增强性投资。

### 2) 对非成份股进行有限度调整。

本基金在充分研究的基础上，选出流动性高投资价值好的非成份股。

在预期股票市场向上时，精选其中的部分或者大部分股票进行积极配置。

在预期股票市场向下时，对非成份股进行低配或者不配。

此外，本基金还将及时把握一级市场上新股申购与增发的盈利机会，并适度进行成份股与

相应可转换债券之间的套利操作，以求提高资金运用效率。

### 3、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理的需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

在预期股票市场向下时，本基金也可以对包括到期日在一年以内的政府债券在内的各类固定收益类产品进行配置。

本基金债券投资将采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等策略。

### 4、金融衍生产品投资策略

本基金采用市场公认的定价技术，适当参与金融衍生产品的投资，以实现以下目的：

- ①对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险；
- ②适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用；
- ③利用金融衍生产品的杠杆作用，减少现金及债券对跟踪指数的拖累。

#### (四) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

中证 100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5%

中证 100 指数是从沪深 300 指数样本股中挑选规模最大的 100 只股票组成样本股，它流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用，能够作为指数基金的标的指数。

如果中证 100 指数被停止编制及发布，或中证 100 指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致中证 100 指数不宜继续作为标的指数或证券市场上有其他代表性更强、更合适作为投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的标的指数和业绩比较基准；并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准后予以公告。

#### (五) 风险收益特征

本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。

#### (六) 投资限制

##### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财

产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资不受此限；

(2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资不受此限；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(5) 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%；

(6) 中证 100 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

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

(8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(9) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 3%；

(10) 如果法律法规或者监管机构以后允许基金投资股票指数期货及其它金融衍生工具时，投资比例遵从法律法规和监管机构的规定；

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，基金管理人在履行适当程序后，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

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

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

#### (七) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 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；

2. 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；

3. 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；

4. 有利于基金财产的安全与增值；

5. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (八) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十一、基金的财产

### (一) 基金资产总值

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

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### (四) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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

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

## 十二、基金资产估值

### (一) 估值日

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

### (二) 估值方法

#### 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、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。

4、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。

5、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。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四) 估值程序

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

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

### (五) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1. 差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统

故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

## 2. 差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(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，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

#### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

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

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (七) 基金净值的确认

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

#### (八) 特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 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. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔

偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十三、基金的收益与分配

### (一) 基金利润的构成

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

### (二) 基金可供分配利润

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

### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；
3. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；
4. 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
6. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
7. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### (五) 收益分配的时间和程序

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

2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 十四、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，

按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十五、基金的会计与审计

### (一) 基金的会计政策

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

### (二) 基金的审计

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

## 十六、基金的信息披露

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

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

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### (一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

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

### (二) 基金合同、托管协议

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

### (三) 基金份额发售公告

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

### (四) 基金合同生效公告

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

### (五) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

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

2. 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

### (六) 基金份额申购、赎回价格公告

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

### (七) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

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

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

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

4. 基金合同生效不足2个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5. 基金定期报告应当按有关规定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。

### (八) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响

的事件时，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过50%；
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%；
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
14. 重大关联交易事项；
15. 基金收益分配事项；
16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；
18. 基金改聘会计师事务所；
19. 基金变更、增加或减少代销机构；
20. 基金更换注册登记机构；
21. 本基金开始办理申购、赎回；
22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### (九)澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份

额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(十) 基金份额持有人大会决议

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

(十一) 中国证监会规定的其他信息

(十二) 信息披露文件的存放与查阅

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

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

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，从而引起证券价格波动，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。利率风险是债券投资所面临的主要风险。

4、信用风险：债券发行人出现违约、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的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

### （二）管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验技能、判断、决策等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，可能因为基金管理人的因素导致基金收益水平与指数跟踪偏差。

### （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。不断变化的申购和赎回，尤其是发生大额申购和赎回时，即使市场行情没有发生显著变化的趋势，本基金也要进行证券买卖。市场的流动性是变化的，不同时间段、不同的证券，其流动性都各不相同。如果市场流动性较差，导致本基金无法顺利买进或卖出，或者必须付出较高成本才能买进或卖出，这样，就在两个方面产生了风险：

1、当发生巨额申购时，本基金由于不能顺利买进，使得本基金的持仓比例被动地发生变化，可能导致行情上涨时不能实现预期的投资收益目标，影响本基金的最终投资业绩；

2、当发生巨额赎回时，如果市场流动性较差，本基金为了兑现持有人的赎回，必须以较高的代价卖出，从而影响本基金的投资业绩。

### （四）本基金特有的风险

本基金不低于基金资产的 80%投资于中证 100 指数成份股，基金在多数情况下将维持较高的股票投资比例，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

本基金的投资运作存在不符合相关法律、法规的规定和基金合同的可能性而带来的风险。

本基金运作过程中，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。

（五）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如技术系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、上市公司经营风险：上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，经营不善可能导致其债务偿还能力下降甚至出现债券违约等信用风险。

## 十八、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. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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变更后公布，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承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

### (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4. 中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

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

(2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

#### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

#### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、基金合同的内容摘要

### （一）前言

#### 1. 订立本基金合同的目的、依据和原则

(1) 订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

(2) 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规。

(3) 订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

2. 基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与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，如与基金合同不一致或有冲突，均以基金合同为准。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。

基金管理人和基金托管人自本基金合同生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

3. 宝盈中证100指数增强型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

4. 基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同不一致或有冲突，以基金合同为准。

### （二）基金合同当事人的权利、义务

#### 1. 基金管理人的权利

(1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 发售基金份额；

- (4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (8) 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、融券；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15) 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；
- (16) 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；
- (17) 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；
- (18) 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；
- (19) 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；
- (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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 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；
- (24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### 3. 基金托管人的权利

- (1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 4. 基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关法律法规另有规定或有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应对直接损失承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 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；
- (20) 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业监督管理机构，并通知基金管理人；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### 5. 基金份额持有人的权利

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 6. 基金份额持有人的义务

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

#### (三) 基金份额持有人大会

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

#### 2. 召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

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

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，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承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3. 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

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

人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

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

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

#### 4. 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)基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

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

(2)采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表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，不影响计票和表决结果。

#### 5. 基金份额持有人出席会议的方式

##### (1)会议方式

- 1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

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

3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4)会议的召开方式由召集人确定。

(2)召开基金份额持有人大会的条件

1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%，下同)；

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

2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

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

召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；

⑤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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

6. 议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

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

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

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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

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

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

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的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，则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议

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

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

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

8. 计票

(1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举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；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人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；如监督人经通知但拒绝到

场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### 9. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第2条所规定的第1)–8)项召开事由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，关于本章第2条所规定的第9)、10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

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

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

#### 10. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

##### (四) 基金收益分配的原则

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

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

3. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%；

4. 若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

7. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

##### (五) 基金收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### （六）基金的费用种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （七）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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

##### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （八）基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的80%，现金或者到期

日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （九）基金的投资限制

#### 1. 组合限制

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

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%，但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资不受此限；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资不受此限；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（5）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%；

（6）中证100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；

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

（8）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（9）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的5%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 3%；

（10）如果法律法规或者监管机构以后允许基金投资股票指数期货及其它金融衍生工具时，投资比例遵从法律法规和监管机构的规定；

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，基金管理人在履行适当程序后，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

#### 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

(十) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### 1. 基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- 1) 转换基金运作方式；
- 2) 变更基金类别；
- 3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 4) 变更基金份额持有人大会程序；
- 5) 更换基金管理人、基金托管人；
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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公布，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承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案, 并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行, 并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## 2. 本基金合同的终止

有下列情形之一的, 本基金合同经中国证监会核准后将终止:

(1) 基金份额持有人大会决定终止的;

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

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

(4) 中国证监会规定的其他情况。

## 3. 基金财产的清算

(1) 基金财产清算组

1) 基金合同终止时, 成立基金财产清算组, 基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

(2) 基金财产清算程序

基金合同终止, 应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:

- 1) 基金合同终止后, 发布基金财产清算公告;
- 2) 基金合同终止时, 由基金财产清算组统一接管基金财产;
- 3) 对基金财产进行清理和确认;
- 4) 对基金财产进行估价和变现;
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书;
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会;

8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；

9) 公布基金财产清算结果；

10) 对基金剩余财产进行分配。

(3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

(4) 基金财产按下列顺序清偿：

1) 支付清算费用；

2) 交纳所欠税款；

3) 清偿基金债务；

4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款1)－3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

(6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

(十一) 争议的处理

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

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

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

(十二) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

鉴于宝盈基金管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力，拟募集发行宝盈中证100指数增强型证券投资基金；

鉴于中国建设银行股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力；

鉴于宝盈基金管理有限公司拟担任宝盈中证100指数增强型证券投资基金的基金管理人，中国建设银行股份有限公司拟担任宝盈中证100指数增强型证券投资基金的基金托管人；

为明确宝盈中证100指数增强型证券投资基金的基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本托管协议；

除非另有约定，《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义；若有抵触应以基金合同为准，并依其条款解释。

### （一）托管协议当事人

#### 1. 基金管理人（或简称“管理人”）

宝盈基金管理有限公司

#### 2. 基金托管人（或简称“托管人”）

中国建设银行股份有限公司

### （二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

#### 1. 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

（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，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督。

（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，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。

（4）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(5) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

(6) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(7) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

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

(9) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,由此造成的损失由基金管理人承担。

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

## 2. 基金管理人有关基金托管人的业务监督、核查

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

(2) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期

限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

### (三) 基金资产的保管

#### 1. 基金资产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

#### 2. 基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

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

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

#### 3. 基金的银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合

法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

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

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

#### 4. 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

(2) 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

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

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### 5. 债券托管专户的开设和管理

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

#### 6. 其他账户的开立和管理

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

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可

存入中央国债登记结算有限责任公司、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，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人、基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

### （四）基金资产净值的计算和复核

#### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

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

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### 2. 复核程序

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

3. 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （五）基金份额持有人名册的保管

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

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。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。

#### （六）争议解决方式

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

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

#### （七）托管协议的效力

双方对托管协议的效力约定如下：

1. 基金管理人在向中国证监会申请发售基金份额时提交的托管协议草案，应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会核准的文本为正式文本。

2. 托管协议自基金合同成立之日起成立，自基金合同生效之日起生效。托管协议的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3. 托管协议自生效之日起对托管协议当事人具有同等的法律约束力。

4. 本协议一式八份，协议双方各持二份，备存二份，上报中国证监会和银行业监督管理机构各一份，每份具有同等法律效力。

#### （八）托管协议的变更、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，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

##### 2. 基金托管协议终止出现的情形

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

## 二十二、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。以下是主要的服务内容：

### （一）注册登记服务

基金管理人委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资人办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，基金转换和非交易过户，基金份额持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### （二）客户服务热线

基金管理人为基金投资人提供客户服务热线服务，电话号码：4008888300（免长话费）；服务时间：每个工作日9：00—17：30；

服务内容：业务咨询、基金净值查询、账户信息查询、订制电子邮件服务、最新活动咨询、传真服务、信函补寄、接受和处理投诉和建议、订制手机短信服务等。

### （三）短信服务

基金投资人交易结束后（T工作日），基金管理人将于T+1工作日为投资人发送交易确认短信；每周末提供周基金净值短信服务；不定期提供公司活动等信息。

### （四）资讯服务

基金管理人将以网站发布、邮寄、电子邮件等形式，提供《宝盈之窗》、《宝盈每周快讯》等理财资讯服务。

### （五）对账单服务

基金管理人向发生交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期寄送对账单。

1. 纸质对账单：月度对账单向当月开户的客户和有交易的金、钻卡客户邮寄；季度对账单向本季度内开户或交易的客户邮寄；年度对账单向全体客户邮寄；

2. 电子对账单：每月月初向拥有有效邮箱信息的客户发送上月电子对账单。

### （六）多种购买基金收费方式选择

基金管理人为基金投资者提供多种收费方式购买本基金，满足基金投资者多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

### （七）网站查询、电子交易服务

公司官方网站（[www.byfunds.com](http://www.byfunds.com)）及电子商务平台爱宝网（<http://ibao.byfunds.com>）为基金投资者提供账户信息查询服务和网上基金电子交易服务。

（八）定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人可利用直销网点或代理销售网点为投资人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，计划具体内容以另行公告为准。

宝盈基金管理有限公司客户服务中心联系方式

宝盈基金管理有限公司客户服务热线： 400-8888-300

宝盈基金管理有限公司网址： [www.byfunds.com](http://www.byfunds.com)

宝盈基金管理有限公司客户服务电子信箱： [public@byfunds.com](mailto:public@byfunds.com)

## 二十三、其它应披露事项

无。

## 二十四、招募说明书的存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

- (一)《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金合同》
- (二)《宝盈中证100指数增强型证券投资基金托管协议》
- (三)法律意见书
- (四)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五)基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六)《关于核准宝盈中证100指数增强型证券投资基金募集的批复》

存放地点：上述备查文件存放在基金管理人的办公场所。

查阅方式：投资者可以在办公时间免费查询；也可按工本费购买本基金备查文件复制件或复印件，但应以基金备查文件正本为准。

宝盈基金管理有限公司

二〇〇九年十二月