

富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金  
更新招募说明书  
(2010 年第 1 号)

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2008 年 3 月 21 日证监基金字【2008】406 号文核准募集，本基金的基金合同于 2008 年 7 月 3 日生效。

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券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

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，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。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基金管理风险，某一基金的特定风险等。本基金为股票型基金，属证券投资基金中的较高风险与较高收益品种。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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2010 年 1 月 3 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目录

|        |                      |     |
|--------|----------------------|-----|
| 第一部分   | 绪言 .....             | 1   |
| 第二部分   | 释义 .....             | 2   |
| 第三部分   | 基金管理人 .....          | 6   |
| 第四部分   | 基金托管人 .....          | 15  |
| 第五部分   | 相关服务机构 .....         | 19  |
| 第六部分   | 基金的募集 .....          | 33  |
| 第七部分   | 基金合同的生效 .....        | 34  |
| 第八部分   | 基金份额的申购与赎回 .....     | 35  |
| 第九部分   | 基金份额的登记 .....        | 45  |
| 第十部分   | 基金的投资 .....          | 47  |
| 第十一部分  | 基金的业绩 .....          | 58  |
| 第十二部分  | 基金的财产 .....          | 59  |
| 第十三部分  | 基金资产估值 .....         | 61  |
| 第十四部分  | 基金的收益与分配 .....       | 69  |
| 第十五部分  | 基金费用与税收 .....        | 71  |
| 第十六部分  | 基金的会计与审计 .....       | 73  |
| 第十七部分  | 基金的信息披露 .....        | 74  |
| 第十八部分  | 风险揭示 .....           | 78  |
| 第十九部分  | 基金合同的终止与基金财产清算 ..... | 81  |
| 第二十部分  | 基金合同摘要 .....         | 83  |
| 第二十一部分 | 托管协议摘要 .....         | 99  |
| 第二十二部分 | 对基金份额持有人的服务 .....    | 113 |
| 第二十三部分 | 其它应披露事项 .....        | 116 |
| 第二十四部分 | 招募说明书的存放及查阅方式 .....  | 118 |
| 第二十五部分 | 备查文件 .....           | 119 |

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规的规定，以及《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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

## 第二部分 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：

|           |  |
|-----------|--|
| 基金或本基金：   | 指富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金；  |
| 基金合同：     | 指《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；                                  |
| 招募说明书：    | 指《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；   |
| 基金份额发售公告： | 指《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金份额发售公告》   |
| 托管协议：     | 指《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；                                       |
| 业务管理规则    | 指《国海富兰克林基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》   |
| 中国证监会：    | 指中国证券监督管理委员会；  |
| 中国银监会：    | 指中国银行业监督管理委员会；   |
| 《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日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订； |
| 《销售办法》：   | 指2004年6月25日由中国证监会颁布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；                    |
| 《运作办法》：   | 指2004年6月29日由中国证监会颁布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；                    |
| 《信息披露办法》： | 指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日施行的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时做出的修订；                     |
| 元：        | 指人民币元；   |

|            |  |
|------------|--|
| 基金管理人：     | 指国海富兰克林基金管理有限公司；   |
| 基金托管人：     | 指中国农业银行股份有限公司；   |
| 注册登记业务：    | 指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算及结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；              |
| 注册登记机构：    | 指根据《国海富兰克林基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》办理本基金注册登记的机构。本基金的注册登记机构为国海富兰克林基金管理有限公司或接受国海富兰克林基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记的机构； |
| 中国         | 指中华人民共和国、就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区；   |
| 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证券投资基金的其他投资者；   |
| 个人投资者：     | 指依据中国有关法律法规可以开放式投资于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证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构；   |
| 合格境外机构投资者： | 指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内证券市场的中国境外的机构投资者；  |
| 基金募集期限：    | 指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；  |
| 基金合同生效日：   | 指基金募集期满，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理                                |

|         |  |
|---------|--|
|         | 备案手续后，中国证监会的书面确认之日；  |
| 存续期：    | 指基金合同生效至终止之间的不定期期限；  |
| 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；  |
| 认购：     | 指在基金募集期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为；  |
| 申购：     | 指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；  |
| 赎回：     | 指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；                       |
| 基金转换：   | 指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为； |
| 转托管：    | 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个某一基金交易账户转入另一基金交易账户的行为；                         |
| 投资指令：   | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；                                 |
| 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；       |
| 销售机构：   | 指基金管理人及本基金代销机构；  |
| 基金销售网点： | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；   |
| 指定媒体：   | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；  |
| 基金账户：   | 指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户；                           |

|         |  |
|---------|--|
| 交易账户：   | 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖开放式基金份额的变动及结余情况的账户；  |
| 开放日：    | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；   |
| T 日：    | 指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；   |
| T+n日：   | 指T日后第n个工作日（不包括T日），n指自然数；   |
| 基金收益：   | 指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；   |
| 基金资产总值： | 指本基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；  |
| 基金资产净值： | 指基金资产总值减去基金负债后的价值；   |
| 基金份额净值  | 指基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的单位基金份额的价值；  |
| 基金资产估值： | 指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；  |
| 法律法规：   | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章、及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；  |
| 不可抗力：   | 指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，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、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。 |



## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市琅东滨湖路46号

办公地址：上海浦东富城路99号震旦国际大楼18楼

法定代表人：张雅锋

成立日期：2004年11月15日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]145号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.2亿元人民币

存续期限：50年

联系人：陈明月

联系电话：021-3855 5600

股权结构：国海证券有限责任公司持有51%股权，邓普顿国际股份有限公司持有49%股权

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员：

董事长张雅锋女士，中共党员，研究生，经济师。历任广西南方商业集团公司董事长兼总经理、党总支书记，广西壮族自治区证券办发行部主任，中国证监会南宁特派办处长、副主任等职。现任广西投资集团有限公司副总经理、国海证券有限责任公司董事长，国海富兰克林基金管理有限公司董事长。

副董事长Murray Lawrence Simpson 先生，大学本科学历。历任Franklin Resources, Inc. 首席法律顾问及董事，Pasadena Capital Corporation (投资公司)Pasadena, California 副执行总裁及首席法律顾问，富兰克林邓普顿投资(亚洲)有限公司执行董事及首席行政人员，Franklin Resources, Inc. 副执行总裁。现已退休。

董事温昌伟先生，中共党员，大学本科学历，高级经济师。历任广西梧州大酒店总经理，梧州地区电业公司总经理。现任广西桂东电力股份有限公司董事长

兼总裁。

董事梁国坚先生，大学本科学历。历任广西梧州远东美容保健用品有限公司董事长兼总经理，广西索芙特有限公司董事长。现任广西索芙特股份有限公司董事长兼总经理。

董事金哲非女士，中国科技大学计算机科学学士和澳大利亚国立大学博士，注册金融分析师，金融风险管理师。历任澳大利亚联邦科学与工业研究机构、美国哈佛大学计算机科学家，富兰克林邓普顿投资公司高级副总裁兼资产组合分析与投资风险部环球总管。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理。

独立董事平雷先生，中共党员，大学本科学历，高级工程师。历任广西壮族自治区体改委副主任、党委书记，广西壮族自治区证券管理委员会副主任，广西壮族自治区人大财经委主任委员。现已退休。

独立董事吴真先生，硕士。历任UDI（Eisenberg Group）美国公司对华总助，UDI（Eisenberg Group）欧洲总部对华总助，中国欧美深圳进出口公司总助，索芙特股份有限公司董事副总经理。现任Green View Group Co., Ltd.，董事总裁，兼索芙特股份有限公司董事。

独立董事Robert R. Williams先生，硕士。历任State Street Australia Limited，（澳洲雪梨）执行董事，State Street Asia，香港资深副总裁，State Street Corporation，（美国波士顿）副行政总裁。现任浙江网新恒天软件有限公司董事长（非执行）。

独立董事陈伟力女士，大学本科学历。历任美国斯坦福大学访问学者，中国新技术创业投资公司副总经理，中国国际技术智力合作公司总经理兼党委书记。现任天津市海运股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

监事会主席何雅玲女士，本科学历。曾在麦坚时律师事务所，隶属摩根大通资产管理的JF资产管理有限公司工作。现任富兰克林邓普顿投资(亚洲)有限公司首席法律顾问——亚洲区。

监事李慧女士，中共党员，硕士研究生学历。历任广西证券有限责任公司上海营业部财务部及交易部经理，广西证券有限责任公司稽核部总经理。现任国海证券有限责任公司稽核监察部总经理。

监事张志强先生，硕士研究生学历，特许金融分析师(CFA)。曾在美国Enreach

Technology Inc.、海通证券股份有限公司、友邦华泰基金管理有限公司工作。2007年4月加入国海富兰克林基金管理有限公司，现任首席数量分析师、投资风险控制部总经理和业务发展部总经理。

### 3、经营管理层人员

总经理金哲非女士，中国科技大学计算机科学学士和澳大利亚国立大学博士，注册金融分析师，金融风险管理师。历任澳大利亚联邦科学与工业研究机构、美国哈佛大学计算机科学家，富兰克林邓普顿投资公司高级副总裁兼资产组合分析与投资风险部全球总管。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理。

副总经理李雄厚先生，中山大学企业管理硕士。历任中国工商银行深圳市分行业务发展部高级经理、宝安证券营业部负责人、上海证券业务部筹建负责人，鹏华基金管理有限公司市场部渠道销售主管，招商基金管理有限公司营销管理部总监，友邦华泰基金管理有限公司副总经理，景顺投资管理有限公司（INVESCO HK）机构业务联席总监。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

### 4、督察长

督察长吴显玲女士，管理学硕士，经济师。历任中国人民银行广西壮族自治区金融管理处主任科员，广西证券交易中心副总经理（主持全面工作），广西证券登记有限责任公司总经理，广西证券有限责任公司副总经理，国海证券有限责任公司副总经理，现任国海富兰克林基金管理有限公司督察长。

### 5、本基金基金经理基本情况

#### 现任基金经理

张晓东先生，美国多米尼克学院亚太政治及经济分析硕士和上海交通大学应用数学学士，十七年的投资经历。他曾就职位于美国旧金山的纽堡（Newport）太平洋投资管理公司，创立并管理纽堡大中华基金（股票），后担任香港阳光国际管理公司董事。张先生在香港的中信资本资产管理部担任董事期间创立并管理中信资本大中华基金，该基金为中信集团在海外发行的第一只股票型对冲基金。2004年10月张晓东先生加入国海富兰克林基金管理有限公司，目前任本基金与富兰克林国海弹性市值基金基金经理。

#### 历任基金经理

无，该基金自成立以来一直由张晓东先生任基金经理，没有发生基金经理变更。

## 6、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：金哲非女士（公司总经理），兼任投资决策委员会主席；张惟闵先生（投资总监）；潘江先生（基金经理）；张晓东先生（基金经理）；朱国庆（基金经理）；黄林（基金经理）；刘怡敏女士（基金经理）；赵晓东先生（基金经理）；张志强（投资风险控制部总经理、业务发展部总经理）。吴显玲女士（督察长）有权列席投资决策委员会的任何会议。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 三、基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

## 四、基金管理人的承诺

1、基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

## 2、基金管理人不得从事下列行为：

- (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，由中国证监会规定禁止的其他行为。

## 3、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

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

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的风险管理和内部控制制度

### 1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险。

针对上述各种风险，本基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

(2) 识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在的风险以及风险存在和发生的原因。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可

能与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一定的风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对级别较低的风险加以监控，对较为严重的风险实施一定的管理计划，对于后果极其严重的风险，则及时准备相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时了解公司风险管理状况，并向其寻求咨询意见。

## 2、内部控制制度

### (1) 内部控制的原则

①全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

②独立性原则。基金管理人设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

③相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

④重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

### (2) 内部控制的主要内容

基金管理人内部控制的主要内容包括：业务控制、资金管理控制、会计系统控制、信息技术系统控制、信息披露控制、监察稽核控制、人事控制等。

#### ①业务控制

业务控制包括市场开发业务控制、投资管理业务控制、开放式基金业务控制、金融创新业务控制等。

市场开发业务控制主要包括：针对市场开发的各项业务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，同时加强内部牵制，防止错误及舞弊行为发生；制定基金销售的标准化流程，选用先进的电子销售系统，以不断提高基金销售的服务质量和避免差错事故的发生；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；实施对客户的审查制度，对客户情况及资金情况进行严格的审查，事先明确双方的权利与义务，防范新的电子交易方式下的各种风险。

研究业务控制主要包括：研究工作保持独立、客观；建立了严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立了投资对象备选库制度，研究部门根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库；建立了投资分析例会制度，沟通信息，交流经验，研究对策，提高投资决策的准确性和及时性；建立了研究报告质量评价体系。

投资决策业务控制主要包括：投资决策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；明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策；建立了投资决策审批制度。投资决策委员会负责审核基金经理提出的资产配置计划，包括各种证券的持仓比例以及行业分布比例。基金经理按经审核同意的投资方案开展业务，不做出超过其授权范围的投资决策；建立了投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；建立了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包括：基金交易实行集中交易制度，基金经理不直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易；制定了基金投资交易业务的标准化流程并注意流程在各部门之间的衔接和监控，并有书面凭证；建立了交易员交易上限控制制度。中央交易室针对个别交易员的从业经验及能力设置相应交易限额，交易限额在交易系统上设定并由交易系统自动监控，以避免因交易员经验不足、执行交易量过大等因素对交易执行质量可能造成的不良影响；建立了完善的交易记录制度，每日投资组合列表等及时核对并存档保管。

## ②资金管理控制

资金管理控制主要包括：基金资金独立于基金管理人的自有资金。基金管理人的自有资金与基金资金分开并互为封闭，不相互转款、拆借、垫付，不混合使用；坚持了资金营运安全性、流动性和效益性相统一的经营原则。资金的筹措和使用严格按照法律法规及基金管理人有关规定执行并统一管理，以提高资金使用效益，并注意其安全性和流动性。

## ③会计系统控制

基金管理人采取了适当的会计控制措施，明确会计凭证、会计账簿和财务会计报告的处理程序，以确保基金管理人会计核算系统的正常运转。具体内容包括：

基金管理人建立了凭证制度，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；基金管理人建立了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；基金管理人建立了复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

#### ④信息技术系统控制

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，编写了完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证了信息技术系统的可稽性；信息技术系统投入运行前，已经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

#### ⑤信息披露控制

信息披露控制包括：基金管理人按照《中华人民共和国公司法》、《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》及其配套的信息披露内容与格式准则和编报规则等法律法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，能够保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时；基金管理人公开披露的信息包括：招募说明书、基金合同、托管协议、定期报告、临时报告、法律法规以及中国证监会规定应予披露的其他信息。基金管理人严格执行信息披露的作业流程，各部门各司其职，并承担其相应的责任。

#### ⑥监察稽核控制

监察稽核控制包括：基金管理人设立了督察长，全权负责基金管理人的监察稽核工作。督察长的任命符合中国证监会的任职条件，经董事会聘任，报中国证监会核准。督察长对董事会负责，任期由基金管理人章程规定；根据基金管理人监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席基金管理人相关会议，调阅基金管理人相关档案，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。督察长对于在稽核监察中所掌握的信息资料负有保密责任。督察长定期和不定期向董事会报告基金管理人内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议；督察长独立出具监察季报、年报及其他报告，直接报送董事会和中国证监会，同时抄送总经理。如发现基金管理人重大违规行为，立即向基金管理人的董事会和中国证监会及相关派出机构报告。



### ⑦人力资源管理控制

人力资源管理控制包括：本基金管理人建立了合理的员工报酬体系，合理确定员工报酬水平。过低的报酬会影响人力资源的质量和运行效益，而过高的报酬会损害基金管理人的利益，所以确定工资制度时坚持了效益优先，兼顾公平的原则；基金管理人建立了管理人员的选聘和培养制度。制定科学的管理人员选聘政策和方法，使优秀人才脱颖而出；制定管理人员培养制度，不断提高其管理水平；制定了员工的业绩评价和激励方案，充分调动了其积极性。

### ⑧内幕交易和关联交易控制

内幕交易和关联交易控制包括：严格规范和界定禁止员工从事的活动，并要求员工严格遵守；完善电脑监控系统，在线实时监控基金的投资、交易活动，防止利用基金财产对敲作价等操纵市场的行为，尤其注意观察大额买卖股票的现象；设置投资限制表。按内幕交易的明确规定限制买卖的股票，对限制表中的股票严禁购买，监察稽核部门根据限制表监控基金投资；对员工行为进行监察，防止出现与基金从业人员操守不符的行为，以及有关法律法规禁止基金从业人员从事的行为；对员工加强职业道德教育。

实现集中交易制度、防火墙制度、信息控制制度，从制度上防止内幕交易的发生。

### 3、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变化及公司发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

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

成立日期：2009 年 1 月 15 日

注册资本：2600 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的

SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 130 名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止2009年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共67只，包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景福、基金天华、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首

选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金，国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，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。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会**总体**负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

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；业务管理实行严格的复核、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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市琅东滨湖路46号

办公地址：上海浦东富城路99号震旦国际大楼18楼

法定代表人：张雅锋

联系人：鞠莉莉

联系电话：021-3855 5678

传真：021-6887 0708

#### 2、代销机构：

##### (1) 中国农业银行股份有限公司

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

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

##### (2) 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

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

联系人：田耕

公司网站：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

##### (3) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

(4) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(5) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

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：010-6555 7013

传真：010-6555 0827

联系人：金蕾

客户服务电话：95558

公司网址：www.ecitic.com

(6) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：翟鸿祥

电话：010-85238423

传真：010-85238680

联系人：陈宇

客户服务电话：95577

公司网站：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(7) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：万丽

客户服务电话：95555

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

(8) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：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

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560661

客户服务电话：95595

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

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：吴海鹏、董云巍

客户服务电话：95568

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

(10) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：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： 021-63604199

联系人：徐伟、虞谷云

客户服务电话：95528

公司网站： [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(11) 宁波银行股份有限公司

住所： 宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

电话：021-63586210

传真：021-63586215

联系人： 胡技勋

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

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

(12) 国海证券有限责任公司

注册地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

联系人：武斌

客户服务电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）

公司网站： [www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

(13) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：傅咏梅

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

(14) 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

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

客户服务电话：400-8888-666

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

(15) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：400-8888-001、021-962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

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

(16) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：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：胡长生

客户服务电话：4008-888-888

电话：010-6656 8047

联系人：李洋

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

(17) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

客户服务电话：400-8888-123

联系人：谢高得

业务联系电话：021-38565775

业务联系人：杨盛芳

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

(18) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

客户服务电话：021-962505

联系人：邓寒冰

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

(19) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 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

客户服务电话：400-8888-555，0755-25125666

联系人：盛宗凌

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

(20) 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 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

客户服务电话：95565、400-8888-111

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

(21) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

开放式基金业务传真：010-65182261

联系人：权唐

客户服务电话：400-8888-108

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

(22) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招银大厦 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-84683893

传真：010-84865560

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

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

(23) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

营业网点（北京）：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

传真：010-66045500

客户服务电话：010-66045678

联系人：莫晓丽

联系人电话：010-66045529

公司网站：[www.txsec.com](http://www.txsec.com) 、 [www.txjijin.com](http://www.txjijin.com)

(24) 山西证券股份有限公司

注册地址：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：0351-8686709

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张治国

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(25) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888-875

客户服务电话：95575

开放式基金业务传真：(020) 87555305

联系人：肖中梅

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

(26) 财富证券有限责任公司

地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

电话：(0731) 4403319

传真：(0731) 4403439

联系人：郭磊

客户服务电话：0731-4403319

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

(27) 东北证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：0431-96688-0

网址：www.nesc.cn

(28) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭8号

法人代表：张华东

联系电话：025-83364032

联系人：徐翔

传真：025-83320066

客户服务电话：400-828-5888

公司网站：www.njzq.com.cn

(29) 中信金通证券有限责任公司

住所：杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

办公地址：杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

法定代表人：刘军

联系人：王勤

联系电话：0571-85783715

传真：0571-85783771

客户服务电话：0571-96598

网址：www.96598.com.cn、www.bigsun.com.cn

(30) 华泰证券有限责任公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-248

联系人：张小波

客户咨询电话：025-84579897

客户服务电话：95597

公司网站：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(31) 湘财证券有限责任公司

地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：李梦诗

联系人电话：021-68634518-8631

客户服务电话：400-888-1551

公司网站：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)、[www.eestart.com](http://www.eestart.com)

(32) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825555

传真：021-68801119

基金业务联系人：张勤

联系电话：021-68801217

客户服务电话：400-8001-001

公司网站：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(33) 江南证券有限责任公司

注册地址：南昌市抚河北路291号

通讯地址：南昌市抚河北路291号五楼

法定代表人：姚江涛

传真：0791-6789414

联系人：余雅娜

客户服务电话：0791-6768763

公司网站：www.scstock.com

(34) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

通讯地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2207957

传真：0551-2207965

联系人：王邦金

客户服务电话：95578

公司网站：www.gyzq.com.cn

(35) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号

通讯地址：上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人：蒋元真

联系人：谢秀峰

联系电话：021-53519888

客户服务电话：021-962518

公司网站：www.962518.com

(36) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

通讯地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明



电话：021-22169081  
传真：021-22169134  
联系人：刘晨  
客户服务电话：400-8888-788  
公司网站：www.ebscn.com

(37) 江海证券经纪有限责任公司  
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号  
通讯地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号  
法定代表人：孙名扬  
电话：0451-82269286  
传真：0451-82269286  
联系人：葛新  
客户服务电话：400-6662-288  
公司网站：www.jhzq.com.cn

(38) 国信证券股份有限公司  
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层  
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层  
法定代表人：何如  
电话：0755-82130833  
传真：0755-82133302  
联系人：齐晓燕  
客户服务电话：95536  
公司网址：www.guosen.com.cn

(39) 宏源证券股份有限公司  
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号  
法定代表人：汤世生  
电话：010-62294608-6460

传真：010-62296854

联系人：李巍

客户服务电话：4008-000-562（全国）

公司网站：www.hysec.com

（40）华宝证券经纪有限责任公司

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人：陈林

电话：021-50122222

传真：021-50122200

联系人：严俊权

客户咨询电话：400-820-9898

公司网站：www.cnhbstock.com

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

## 二、注册登记机构

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市琅东滨湖路46号

办公地址：上海浦东富城路99号震旦国际大楼18楼

法定代表人：张雅锋

电话：021-3855 5601

联系人：董卫军

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：廖海

经办律师：廖海、黎明

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区东昌路568号

办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-6123 8888

传真：021-6123 8800

经办注册会计师：薛竞 单峰

## 第六部分 基金的募集

本基金募集期为 2008 年 5 月 8 日至 2008 年 6 月 30 日，本次募集的净销售金额为 758,977,333.76 元人民币，认购款项在募集期间产生的银行利息共计 233,337.95 元人民币。

本次募集有效认购总户数为 21,735 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，本基金在募集期募集的有效认购份额为 758,977,333.76 份，利息结转的基金份额为 233,337.95 份，两项合计共 759,210,671.71 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。经中国证券监督管理委员会核准，本基金的基金合同于 2008 年 7 月 3 日生效。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

经中国证券监督管理委员会核准，本基金合同已于 2008 年 7 月 3 日正式生效。

### 二、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，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人的直销网点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基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以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。

### 二、申购与赎回的开放日及开放时间

#### 1、申购、赎回开始日

本基金日常申购自2008年8月4日起开始办理，日常赎回自2008年9月26日起开始办理。

#### 2、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。具体业务办理时间即开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并在调整前两个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体及基金管理人网站上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额

申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体及基金管理人网站上予以公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间即开放时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在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按销售机构规定的其它方式查询申购与赎回的成交情况。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、代销网点和直销网上交易投资者每次申购本基金的最低金额为人民币1,000元（含申购费）。直销柜台投资者首次申购本基金的最低金额为人民币100,000元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币1,000元，已在直销柜台有该基金认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于1,000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前依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金的申购费率如下：

| 申购金额（含申购费）              | 费率      |
|-------------------------|---------|
| 100万元以下                 | 1.50%   |
| 100万元（含）以上，<br>500万元以下  | 1.20%   |
| 500万元（含）以上，<br>1000万元以下 | 1.00%   |
| 1000万元（含）以上             | 1000元/笔 |

2、本基金的赎回费率如下：

| 持有时间       | 赎回费率  |
|------------|-------|
| 1年以下       | 0.60% |
| 1年（含1年）至2年 | 0.30% |



|            |       |
|------------|-------|
| 2年（含2年）至3年 | 0.10% |
| 3年（含3年）以上  | 0     |

### 3、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费 = 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

例二：假定T日本基金的份额净值为1.2000元，三笔申购金额分别为1万元、100万元和500万元，则各笔申购负担的申购费用和获得的该基金份额计算如下：

| 申购1                   | 申购2      |            | 申购3          |
|-----------------------|----------|------------|--------------|
| 申购金额（元，A）             | 10,000   | 1,000,000  | 5,000,000    |
| 适用申购费率（B）             | 1.50%    | 1.20%      | 1.00%        |
| 申购费（D=A-C）            | 147.78   | 11,857.71  | 49,504.95    |
| 净申购金额<br>(C=A/(1+B))  | 9,852.22 | 988,142.29 | 4,950,495.05 |
| 申购份额（E =<br>C/1.2000） | 8,210.18 | 823,451.91 | 4,125,412.54 |

### 4、基金赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额 = 赎回份数 × T日基金份额净值

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

例三：假定某投资者在T日赎回10,000份，该日该基金份额净值为1.2500元，其在认购/申购时已交纳认购/申购费用，持有年限不足1年，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额 = 赎回份数 × T日基金份额净值

= 10,000 × 1.2500 = 12,500元

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

$$=12,500 \times 0.6\% = 75 \text{元}$$

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

$$=12,500 - 75 = 12,425 \text{元}$$

5、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。

6、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申购费后，以申请当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

7、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乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

8、基金份额净值的计算公式为：基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 基金份额总数。基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

9、本基金的申购费由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用

10、赎回费由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等必要手续费。

11、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率和收费方式（包括但不限于在基金合同约定的范围内提高或者降低招募说明书列明的申购、赎回费率），费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前两个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体和基金管理人网站上公告。

12、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

13、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，对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、申购和赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者T日申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

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

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

## 八、巨额赎回的认定及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招

募说明书规定的其他方式，在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

(4) 暂停接受和延缓支付：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，但延缓期限不得超过20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体公告。

## 九、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- (5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 基金连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- (5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续

开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第3项所述情形，按基金合同的相关条款处理。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。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公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(1) 如果发生暂停的时间为1天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过1天但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前2个工作日，在指定媒体和基金管理人网站上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1个开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少重复刊登暂停公告1次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2个工作日，在指定媒体和基金管理人网站上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1个开放日的基金份额净值。

## 十、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的公告或更新的招募说明书中确定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，该等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。

## 十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。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基金合同的规定制定并公告。

## 十二、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。基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。非交易过户只能由注册登记机构办理。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”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；

“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

## 十三、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的标准收取转托管费。

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

## 十四、基金的冻结与解冻

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金账户或基金份额的冻结与解冻。

基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。

#### 十五、基金份额质押及其他基金业务

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。

## 第九部分 基金份额的登记

### 一、基金份额注册登记业务

本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金份额销售业务的确认、清算及结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

### 二、基金份额注册登记业务办理机构

本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在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、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

### 三、基金份额注册登记机构的权利

基金份额注册登记机构享有以下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在中国证监会指定媒体上公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

### 四、基金份额注册登记机构的职责

注册登记机构履行如下职责：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回与转换等业务记录 15 年以上；



4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金造成的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；

5、按基金合同和招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、转托管和提供其他必要服务；

6、法律法规规定的其他义务。

## 第十部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金以富兰克林邓普顿基金集团环球资产管理平台为依托，针对证券市场发展中的结构性特征，投资于具有估值优势和成长潜力的上市公司的股票以及各种投资级债券，争取达到基金财产长期稳定增值的目的。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为国内依法公开发行的股票、债券以及中国证券监督管理委员会允许基金投资的其他金融工具，其中，股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的股票；债券投资范围包括国内国债、金融债、企业债和可转换债券等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合的范围为：股票资产占基金资产的60%—95%，债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%—40%，其中，基金保留的现金以及投资于到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

### 三、投资理念

当宏观经济或市场结构出现较大变化时，行业与企业的成长模式和盈利能力往往会随之发生变化，进而影响行业板块与上市公司的投资价值与估值水平。具有核心竞争力、占据行业垄断地位、处于成长拐点或成长转型阶段的上市公司，往往能在价值重构的过程中获取估值溢价，深化投资价值。本基金通过深刻的价值挖掘，专注投资于此类价值深化上市公司的股票，争取为投资者获取超越业绩基准的投资回报。

### 四、投资策略

本基金采取“自下而上”的选股策略和“自上而下”的资产配置策略相结合的主动投资管理策略。

“自下而上”的方法主要通过财务模型和估值手段建立选股标准，充分挖掘具有估值优势和成长潜力的上市公司，并根据市场环境的变化、市场出现的各种套利机会及对未来发展趋势的判断，确定最终的股票组合。

“自上而下”的组合构建方法，主要是从宏观经济形势，到行业的发展趋势，再到上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析，确定本基金的资产配置。

具体分解为如下几个环节：

#### 1、股票选择策略

本基金运用双层次价值发现模型进行股票选择。首先运用数量化的估值方法辨识上市公司的“初级价值”，并选取出估值水平低于市场平均的价值型股票形成初级股票池；之后透过分析初级股票池中上市公司的盈利能力、资产质量、成长潜力等各项动态指标，发掘出目前价值低估、未来具有估值提升空间的股票，也就是在初级价值股票中进行价值精选、发掘上市公司的“深化价值”以形成次级股票池。

具体选股策略如下：

(1) 寻找具有“初级价值”的股票形成初级股票池：股票分析员针对上市公司的估值水平进行分析，挑选出具有估值优势股票，具体的选股标准包括P/E或P/B处于市场平均水平以下等。

(2) 寻找具有“深化价值”的股票形成次级股票池：股票分析员针对宏观经济周期性波动的过程中，上市公司的投资价值加剧分化的特点，着重评估公司内部及外部竞争能力的变化，并关注公司治理结构和公司透明度的变化，通过建立财务模型和估值手段，寻找出具有估值提升潜力的上市公司。具体的选股标准包括主营业务收入增长率和息税前利润增长率超过相应周期内GDP平均增长率的上市公司；或者具有正的边际主营业务收入增长率或边际息税前利润增长率的上市公司。

#### (3) 构建股票组合

本基金基金经理对次级股票池中的股票进行逐一分析和比较，挑选出其中投资价值最大的股票构建具体的股票组合。

在评估上市公司内部和外部竞争能力方面，首先从业绩增长的驱动因素角度分析企业在产能扩张、产品提价、产品升级、生产和销售模式升级、技术创新、管理能力提升等方面是否具备内部竞争力；然后从企业产品的供需状况、价格波

动趋势、成本变动趋势、政策发展趋势等方面分析公司的外部竞争力。

在评估上市公司治理结构和透明度方面，重点关注企业是否具备完善的管理层激励和约束机制、是否实行有效和及时的信息披露措施，以及与大股东之间是否存在不当的关联交易、是否有内幕交易记录、管理层的诚信记录和财务透明度等。

## 2、资产配置策略

本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场资金构成及流动性情况，通过深入的数量化分析和基本面研究，制定本基金股票、债券、现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。

具体资产配置策略如下：

（1）通过运用宏观经济分析中的量化模型和基本面分析预测宏观经济趋势，确定相应大类资产配置比例。

（2）分析行业的长期利润趋势，及行业内不同公司的移动壁垒造成的不同价值链地位，结合对应的估值水平，确定行业板块的配置比例。

（3）采取风险预算管理方法，定期评估各类资产和行业板块的相对风险水平，确保取得超额收益下的整体组合的总体风险维持在合理的限度内。

## 3、债券投资策略

债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理、识别收益率曲线中价值低估的部分以及识别各类债券中价值低估的种类（例如企业债存在信用升级的潜力）。为了有助于辨别出恰当的债券久期，并找到构造组合达到这一久期的最佳方法，基金管理人将集中使用基本面分析和技术分析，通过对个券的全面和细致的分析，最后确定债券组合的构成。

## 4、权证投资策略

在确保与基金投资目标相一致和有效管理风险的前提下，本着谨慎可控的原则，依据现代金融投资理论，通过对权证标的证券的基本面研究，并结合期权定价模型估计权证理论价值，同时结合对未来走势的判断，充分考虑权证的风险和收益特征，在严格控制风险的前提下，评估权证投资价值，谨慎投资。对权证的建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上，主要用于锁定收益和控制风险。

## 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：85% X沪深300指数+ 15% X中债国债总指数（全价）

沪深300指数衡量股票投资部分的业绩，中债国债总指数（全价）衡量基金债券投资部分的业绩。

由于沪深300指数具有市场代表性强、普通投资者比较熟悉等特征，所以本基金选择沪深300指数衡量股票投资部分的业绩。

中债国债总指数是业内最常用的一种评判债券投资收益的基准指数之一，由于其权威性、便利性、及时性的特点，本基金债券部分的业绩比较基准选择中债国债总指数（全价）。

## 六、风险收益特征

本基金为价值型股票证券投资基金，具有较高风险和较高收益的特征，其预期的收益和风险都高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

## 七、投资决策流程

本基金通过对不同层次的决策主体明确授权范围，建立完善的投资决策运作体系：

（1）投资决策委员会会议：基金管理人投资决策层，对投资总监提交的投资策略和资产配置进行讨论，并对重大投资决策做出决定。

（2）行业及风格配置会议：由投资总监主持，基金经理和研究部总监参加。按照投资决策委员会决议，根据最新的市场动态以及来自分析员的最新推荐，评估投资组合的构成以及资产配置和投资策略。风险控制经理将从风险预测和策略有效性的角度提出建议。当观点达成一致时，对投资组合的调整才能够付诸实施。当观点没有达成一致的情况下，由投资总监最终决策。

（3）投资组合会议：由投资总监主持，基金经理和研究分析部研究员参加会议。审议研究员提出的公司分析报告，确定进入或剔除出股票购买清单的股票名单。

（4）基金经理根据行业及风格配置会议的资产配置指令和购买清单审议会议作出的结论构建投资组合。在构建投资组合的过程中，基金经理必须严格遵守

基金合同的投资限制及其他要求，同时其对组合调整的幅度必须在被授权的范围内进行。

(5) 风险管理和业绩分析报告会：风险控制经理提供最新的风险管理和业绩分析报告。针对现有的投资组合，所有的风险控制规则都需要得到检验，从而保证在投资框架允许的范围内进行投资。

(6) 基金经理根据风险管理和业绩分析定期报告，以及最新信息和研究结果做出投资组合的适当调整。

## 八、投资限制

本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%；

(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

(3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

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

(5) 保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(6) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，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%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

(7) 本基金投资资产支持证券的，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%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

(8) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(9) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的除外。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 九、 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、投资未经中国证监会批准的非公开发行证券，或预付任何形式的保证金；
- 9、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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 十、 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、 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；
- 3、 有利于基金财产的安全与增值；

- 4、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。

#### 十一、基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

#### 十二、基金投资组合报告

本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。

本基金的托管人—中国农业银行根据本基金合同规定，于2009年10月23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，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截止2009年9月30日，本报告财务资料未经审计。

##### 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  | 权益投资    | 1,027,659,108.09 | 71.05        |
|    | 其中：股票   | 1,027,659,108.09 | 71.05        |
| 2  | 固定收益投资  | -                | -            |
|    | 其中：债券   | -                | -            |
|    | 资产支持证券  | -                | -            |
| 3  | 金融衍生品投资 | -                | -            |



|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 4 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计      | 208,135,379.03   | 14.39  |
| 6 | 其他资产              | 210,634,766.93   | 14.56  |
| 7 | 合计                | 1,446,429,254.05 | 100.00 |

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码  | 行业类别           | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|-----|----------------|----------------|--------------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | -              | -            |
| B   | 采掘业            | 57,370,138.32  | 4.37         |
| C   | 制造业            | 618,356,878.33 | 47.10        |
| C0  | 食品、饮料          | 29,361,212.30  | 2.24         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | -              | -            |
| C2  | 木材、家具          | -              | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | 76,738,080.85  | 5.84         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 175,151,809.89 | 13.34        |
| C5  | 电子             | -              | -            |
| C6  | 金属、非金属         | 30,723,735.72  | 2.34         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 174,693,075.85 | 13.31        |
| C8  | 医药、生物制品        | 131,688,963.72 | 10.03        |
| C99 | 其他制造业          | -              | -            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -              | -            |

|   |          |                  |       |
|---|----------|------------------|-------|
| E | 建筑业      | 11,236,947.30    | 0.86  |
| F | 交通运输、仓储业 | -                | -     |
| G | 信息技术业    | 58,079,153.48    | 4.42  |
| H | 批发和零售贸易  | 45,677,652.20    | 3.48  |
| I | 金融、保险业   | 160,338,988.96   | 12.21 |
| J | 房地产业     | 38,166,580.00    | 2.91  |
| K | 社会服务业    | 38,432,769.50    | 2.93  |
| L | 传播与文化产业  | -                | -     |
| M | 综合类      | -                | -     |
|   | 合计       | 1,027,659,108.09 | 78.27 |

### 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<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 000792 | 盐湖钾肥  | 1,326,031 | 65,810,918.53 | 5.01                 |
| 2  | 000963 | 华东医药  | 4,195,614 | 64,612,455.60 | 4.92                 |
| 3  | 600030 | 中信证券  | 2,348,600 | 58,738,486.00 | 4.47                 |
| 4  | 600718 | 东软集团  | 2,915,628 | 58,050,153.48 | 4.42                 |
| 5  | 601088 | 中国神华  | 1,889,662 | 57,370,138.32 | 4.37                 |
| 6  | 600320 | 振华重工  | 5,348,095 | 52,143,926.25 | 3.97                 |
| 7  | 600694 | 大商股份  | 1,272,358 | 45,677,652.20 | 3.48                 |
| 8  | 600486 | 扬农化工  | 1,214,563 | 40,189,889.67 | 3.06                 |
| 9  | 600963 | 岳阳纸业  | 4,653,360 | 39,600,093.60 | 3.02                 |
| 10 | 000069 | 华侨城 A | 2,077,447 | 38,432,769.50 | 2.93                 |

### 4. 报告期末按券种分类的债券投资组合 报告期末未持有债券。

#### 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

报告期末未持有债券。

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

报告期末本基金未投资资产支持证券。

#### 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

报告期末本基金未持有权证。

#### 8. 投资组合报告附注

1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形：

根据青海盐湖钾肥股份有限公司2009年2月26日发布的《青海盐湖钾肥股份有限公司受到有关部门相关处罚的提示性公告》，盐湖钾肥因未及时严格履行监管部门制订的氯化钾销售临时指导价格，受到500万元的经济处罚。

本基金对盐湖钾肥投资决策说明：本公司的投研团队经过充分调研，本基金通过长期跟踪该公司认为盐湖钾肥符合本基金价值投资的理念，对该股的投资决策遵循公司投资制度的规定。

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

#### 3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 458,450.80     |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 34,531.44      |
| 5  | 应收申购款   | 210,141,784.69 |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| 6 | 其他应收款 | -              |
| 7 | 待摊费用  | -              |
| 8 | 其他    | -              |
| 9 | 合计    | 210,634,766.93 |

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未持有流通受限的股票

## 第十一部分 基金的业绩

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，但不保证基金一定盈利。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。

截止到 2009 年 9 月 30 日基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较：

| 阶段                                      | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率<br>③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|---|------------|-------------------|------------------------|-----------------------|--------|--------|
| 2008 年 7 月 3 日<br>— 2008 年 12 月<br>31 日 | -7.84%     | 0.73%             | -27.31%                | 2.54%                 | 19.47% | -1.81% |
| 2009 年 1 月 1 日<br>— 2009 年 3 月 31<br>日  | 32.75%     | 1.75%             | 31.69%                 | 1.98%                 | 1.06%  | -0.23% |
| 2008 年 7 月 3 日<br>— 2009 年 3 月 31<br>日  | 22.34%     | 1.17%             | -4.28%                 | 2.40%                 | 26.62% | -1.23% |

## 第十二部分 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。

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；
- 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、其他投资及其估值调整；
- 9、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金额。

### 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其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，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。

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。

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

## 第十三部分 基金资产估值

### 一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### 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

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### 四、估值方法

#### 1、股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 未上市股票的估值。

①送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

②首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管



理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易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；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易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估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

（5）在银行间同业市场交易的债券、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；并在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（6）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（5）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（5）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（7）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值办法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，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。

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

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

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

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券按国家有关规定进行估值。根据有关法律法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金资产估值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

基金的日常估值由基金管理人进行。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照法律法规和本基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核；如基金托管人复核无误，则签章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。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. 基金管理人应在每个工作日对基金资产估值。基金管理人每工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

根据有关法律法规，开放式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，如经基金管理人和基金托管人在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 六、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。

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、或基金投资者自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错责任方应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

由于不可抗力原因造成基金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，如果因基金管理人的行为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，如果因基金托管人的行为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；

(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有责任的当事人进行追索，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；

(5)基金管理人及基金托管人基金资产净值计算错误偏差达到基金资产净值0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

#### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1)当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；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、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，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。

(2)当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1)本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

2)若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金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，其中基金管理人承担50%，基金托管人承担50%；

3)如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

4)由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金

管理人负责赔付；

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响；

(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者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## 七、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其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、中国证监会认定的其它情形。

## 八、基金资产净值的确认

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工作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。

## 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(4)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，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。

注：根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008]38号）等相关规定和要求，以及基金合同、招募说明书的规定，自2008年9月16日起，对旗下基金已持有的长期停牌股票，采用《中国证券业协会基金估值小组关于停牌股票估值的参考方法》中的“指数收益法”进行估值。

## 第十四部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益的构成

本基金的收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券价差、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基金收益。

### 二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### 三、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
3. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；
4. 本基金收益每年最多分配4次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%；
5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
6. 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. 本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。



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

#### 六、收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担;如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用,注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为基金份额。

## 第十五部分 基金费用与税收

### 一、与基金运作有关的费用

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

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照合理的价格确定，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：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为1.5%

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：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为0.25%

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. 上述(一)中3到8项费用由基金托管人根据其他有关法律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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

(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。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。调高基金管理费率和基金托管费率，须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前两个工作日在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

## 二、与基金销售有关的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第六部分：基金的募集”中“七、认购方式与费率结构”中的相关规定。本基金的申购费、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“第八部分：基金份额的申购、赎回”中的“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”中的相关规定。不同基金间转换的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。基金认购费、申购、赎回费和基金转换费由基金投资者承担，不列入基金财产。

## 三、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。

## 第十六部分 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核算制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人及基金托管人分别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和基金托管人同意。
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。基金管理人应当在更换会计师事务所后的2日内公告。

## 第十七部分 基金的信息披露

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至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证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。

### 一、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，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体和基金管理人网站；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各自公司网站上。

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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的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。

### 二、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报刊和网站上。

### 三、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。

### 四、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前2日在指定媒体及基金管理人网站上公告。

### 五、基金资产净值、基金份额净值公告

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之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## 六、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

1、基金年度报告：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和基金管理人网站上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：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、基金季度报告：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。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 七、临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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

生重大影响的事件，包括：

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

27、中国证监会规定的其他事项。

## 八、公开澄清

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

## 九、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。

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。

## 十、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、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。



## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的风险

本基金是一只主动型投资的股票型基金，属于基金类型中具有较高风险和较高收益的基金品种，本基金的风险与预期收益都高于混合型基金。

#### （一）投资于本基金的主要风险

##### 1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

##### （5）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

##### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，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，导致基金资产损失。

3、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

4、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率

#### 5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### 7、操作或技术风险

指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、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 8、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### 9、本基金的特定风险

本基金选股指标包括财务和估值指标，这些指标只能采取历史的会计数据，在此基础上确定了最终的股票池。因此，可能存在部分公司会计数据的动态变化带来的因实际股票池和模拟股票池不同而造成的投资业绩的波动。其次，在股票的评级上采取了整体最优价值评价体系，由于该体系可能存在权重设置和指标提取可靠程度上的风险，从而影响股票评级和实际表现的差异。同时，在产品模拟

测试方面，由于模拟绩效依赖了资产配置比例的一些前提性的假设，因此可能存在产品测试中的模拟绩效和实际绩效差异的风险。

#### 10、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

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

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 基金合同的终止与基金财产清算

### 一、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、基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；
- 4、基金合并；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 二、基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算小组

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

(2) 基金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。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行评估和变现；
- (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。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金剩余财产的分配

基金剩余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）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 6. 清算期限为6个月

#### 7、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

#### 8、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十部分 基金合同摘要

### 一、基金合同当事人的权利义务

#### (一) 基金份额持有人的权利和义务

1、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，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额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、基金合同规定的其他权利。

#### 3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规及基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (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) 返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人、基金托管人及基金代销机构处获得的不当得利；
- (5) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (6) 执行基金份额持有人大会的决议；

(7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利和义务

### 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) 获得基金管理人报酬；

(3) 依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，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，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(5) 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、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(7) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(8) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

(11) 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；

(12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(13) 法律法规规定的其他权利。

### 2、基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理或者委托经由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、赎回和注册登记事宜；

(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基金管理人的财产相互独立，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；

(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) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，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) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(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) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；

(27) 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；

(28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利和义务

#### 1、基金托管人的权利

(1) 获得基金托管费；

(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，依法保管基金财产；

(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，对基金财产、其他基金合同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基金合同当事人的利益；

(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；

(8) 法律法规规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

(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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，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，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

(8) 对基金财务会计报告、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；

(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不少于15年；

(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，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

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

### (二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(5) 变更基金份额持有人大会议事程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 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；

(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，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(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，不需召开基金份额持有人大会：

(1)调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金财产承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、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)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。

### (三)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（以上含本数，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起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。

(四) 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日在指定媒体和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和出席方式；

(2) 会议拟审议的主要事项；

(3) 会议形式；

(4) 议事程序；

(5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

(6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；

(7) 表决方式；

(8) 会务常设联系人姓名、电话；

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

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

(五) 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，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。

## 2. 召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，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；

2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在25个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按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；

2) 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

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

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份

额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在25个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

#### (六) 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。

(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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前35日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有30日的间隔期。

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

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

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

(4) 单独或合并持有权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，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

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

大会由基金管理人授权代表主持。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。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。

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

### (2) 通讯方式开会

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

## 3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 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及其代理人所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

#### (2) 特别决议



特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；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。

#### (八) 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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3

名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

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

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

##### 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

(九)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，并在生效后方可执行。

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的决定。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2个工作日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

4. 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

### 三、基金合同的变更、终止与基金资产的清算

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。但根据法律法规的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。

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因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；
- ②基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；
- ③因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。
- ④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) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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. 基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；
3. 基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；
4. 基金合并；
5. 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

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

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

用必要的工作人员。

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

## 2. 基金财产清算程序

- (1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2)对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估价和变现；
- (4)制作清算报告；
- (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)公布基金清算报告；
- (9)对基金剩余财产进行分配。

## 3. 清算费用

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

## 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5. 清算期限为6个月

## 6. 基金财产清算的公告

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

## 7. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

#### 四、争议解决方式

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

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。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### 五、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，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 第二十一部分 托管协议摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

住所：广西南宁市琅东滨湖路46号

法定代表人：张雅锋

成立时间：2004年11月15日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2004]145号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.2亿元人民币

存续期间：50年

#### （二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：项俊波

成立时间：2009年1月15日

组织形式：股份有限公司

注册资金：2600亿元人民币

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；证券投资基金托管；社保基金托管；企业年金托管；委托资产托管；信托资产托管；基本养老保险个人账户基金托管；农村社会保障基金托管；投资连接保险产品的托管；收支账户的托管；合格境外机构投资者（QFII）境内证券投资托管。

存续期间：持续经营。

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。

(二) 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、融券比例进行监督。

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

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

(五) 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。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担任何责任,并将在发现后立即报告中国证监会。

(六) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后

应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（七）对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对于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。

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

（三）基金管理人发现基金托管人重大违规行为，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。

#### 四、基金财产的保管

##### （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。如果基金财产（包括实物证券）在基金托管人保管期间损坏、灭失的，应由该基金托管人承担赔偿责任。
- 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。
- 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。

##### （二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。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，基金托管人应提供充分协助。
- ##### （三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户，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。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

4、基金资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、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。

#### （四）基金证券账户的开立和管理

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

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

3、基金托管人以自身法人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。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、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。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

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

基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）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，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）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、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。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。托管人对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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，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。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 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0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

##### 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金

托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### 2. 估值方法

#### （1）股票估值方法：

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

2) 未上市股票的估值。

①送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

②首次发行未上市的股票，按成本价估值；

③公开发行且在发行时明确一定期限锁定期的股票，锁定期内按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，锁定期内按下列方式估值：

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

当估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按照下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$

其中；FV为估值日该非公开发行股票的价值；

C为该股票的初始取得成本；

P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

D1为该股票锁定期所含的交易天数；

Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

3) 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则

按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(2) 债券估值办法：

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

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

3) 未上市债券，除可分离交易可转换债券分离的债券部分，按其成本价估值；

4) 未上市的可分离交易可转换债券分离的债券部分，按公允价估值；

5) 在银行间债券市场交易的债券采用估值技术确定公允价值；并在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第1)－5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第1)－5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率

曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(3) 权证估值方法：

1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的权证投资按公允价估值；

2) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第1)小项规定的方法对基金资产进

行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第1)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4) 其他有价证券按国家有关规定进行估值。

根据有关法律法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金资产估值的计算结果对外予以公布。

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

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第4)小项或债券估值方法的第6)小项或权证估值方法的第2)小项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；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、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，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。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明,份额净值出错且造成基金份额持有人损失的,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,其中基金管理人承担50%,基金托管人承担50%。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金份额净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误,进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失,由基金管理人负责赔付。

由于基金托管人提供的信息错误,基金管理人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误,进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失,由基金托管人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(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。如果行业有通行做法,双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1)基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、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

障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时；

(4) 如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

(5) 中国证监会认定的其他情形。

#### (五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### (六) 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### (七) 基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### (1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后5个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起15个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起60日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起90日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年报或者年度报告。

###### (2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托



管人在复核过程中，发现双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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。基金托管人复核完毕，应出具相应的复核确认书。

## 六、基金份额持有人名册的保管

本基金的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、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和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。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为基金存续期间及基金合同终止后15年，法律法规另有规定的除外。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。

## 七、争议解决方式

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

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

人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）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后生效。

### （二）基金托管协议终止的情形

1. 本基金合同终止；
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。

### （三）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算小组

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

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

(3) 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。

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

#### 2. 基金财产清算程序

- (1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 编制清算报告；

- (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) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿:

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

### 5. 清算期限为6个月

### 6. 基金财产清算的公告

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

### 7. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十二部分 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,并将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。主要的服务项目如下:

### 一、基金份额注册登记服务

本基金管理人同时兼任本基金的注册登记机构,在公司内部设立了专门的运营部门负责基金份额持有人的注册与过户登记业务,配备先进、高效的电脑系统及通讯系统,准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户业务、汇总和储存并管理基金的所有认购、申购和赎回信息,确保基金份额持有人的注册与过户登记工作的准确和顺利进行。

### 二、资料寄送

1、每次申购交易结束后,投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单;

2、每次认购交易结束后,投资者可在T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询交易情况,最终确认份额以基金成立后的确认份额为准。

3、本公司默认的对账单方式为月度电子邮件形式对账单,基金投资人也可选择按季度或年度发送。我司将在每期结束后的5 个工作日内向投资者发送基金账户对账单或其他重要资料。本公司提示,凡无法接收电子邮件对账单的投资者,须在开户成功后与本公司客户服务中心联系(4007004518(免长途费)、95105680(免长途费)和021-38789555),我们在核对投资者联系方式完整无误后,可为基金投资者保留纸质对账单的寄送方式。纸质对账单的寄送将按基金持有人的不同频率选择(季度、半年度、年度),为每期内有交易的投资者寄送。

### 三、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除息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。基金份额持有人可以随时选择更改基金分红方式。

#### 四、定期定额投资

本基金将通过销售机构为基金份额持有人提供定期定额投资的服务，即基金份额持有人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则详见相关公告。

#### 五、资讯服务

##### 1、手机短信服务

基金份额持有人可以通过本基金管理人网站和客户服务热线人工应答预留手机号码，按需要定制短信内容并选择发送频率，我们将根据定制要求提供相应服务。

##### 2、电子邮件服务

基金份额持有人可以在本基金管理人网站注册，登录定制所需要的各类公开信息。如果留下个人邮箱，将会收到定制的信息。

#### 六、客户服务中心

##### 1、客户服务电话

呼叫中心自动语音系统提供每周7天、每天24小时的自助语音服务和查询服务，客户可通过电话收听最新公告信息、基金份额净值、自助查询基金账户余额信息、交易确认情况等。同时，呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。

##### 2、网上客户服务中心

网上客户服务中心为基金份额持有人提供查询服务、资讯服务以及相互交流的平台。注册登录后，基金份额持有人可以查询个人账户资料，包括基金持有情况、基金交易明细、基金分红实施情况等；此外，还可以修改个人账户资料，查询热点问题及其解答，查阅投资刊物，或提交投诉和建议等等。

公司网址：[WWW.FTSFUND.COM](http://WWW.FTSFUND.COM)

电子信箱：[SERVICE@FTSFUND.COM](mailto:SERVICE@FTSFUND.COM)

#### 七、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、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。基金份额持有人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。

## 八、服务渠道

1、咨询电话：4007004518（免长途费）、95105680（免长途费）和021-3878 9555

2、网站及在线客服：WWW.FTSFUND.COM

3、传真：021-6887 0708 /021-6888 3069

4、电邮：[SERVICE@FTSFUND.COM](mailto:SERVICE@FTSFUND.COM)

5、其他，如邮寄等。

## 第二十三部分 其它应披露事项

- 1、2009年7月10日，国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金开通网上直销业务及相关申购费率优惠的公告
- 2、2009年7月20日，关于增加交通银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构的公告
- 3、2009年7月21日，富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金2009年第2季度报告
- 4、2009年7月28日，关于增加东莞银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构及开通定期定额投资业务的公告
- 5、2009年8月15日，富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2009年第2号）
- 6、2009年8月17日，关于国海富兰克林基金管理有限公司在南京证券有限责任公司开通旗下开放式基金基金转换业务的公告
- 7、2009年8月28日，富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金2009年半年度报告及摘要
- 8、2009年9月3日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分开放式基金通过江海证券有限公司开办定期定额投资业务的公告
- 9、2009年9月4日，关于增加东海证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构的公告
- 10、2009年9月17日，国海富兰克林基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告
- 11、2009年9月23日，关于国海富兰克林基金管理有限公司在东海证券有限责任公司开通旗下开放式基金基金转换业务的公告
- 12、2009年9月23日，关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金拟投资创业板上市证券的公告
- 13、2009年10月9日，关于增加广发华福证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告
- 14、2009年10月14日，关于国海富兰克林基金管理有限公司在天相投资顾问有限公司开通旗下开放式基金基金转换业务的公告

- 15、2009年10月22日，富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金第一次分红预告
- 16、2009年10月22日，关于国海富兰克林基金管理有限公司在江海证券有限公司开通旗下开放式基金基金转换业务的公告
- 17、2009年10月24日，国海富兰克林基金管理有限公司副总经理任职公告
- 2009年10月26日，富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金第一次分红公告
- 18、2009年10月28日，富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金2009年第3季度报告
- 19、2009年11月13日，国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金代销机构名称变更的公告
- 20、2009年11月20日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分开放式基金通过国信证券股份有限公司开办定期定额投资业务的公告



## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书在编制完成后,将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点,供公众查阅。投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

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。

## 第二十五部分 备查文件

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

（一）中国证监会核准富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金募集的文件

（二）《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金合同》

（三）《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金托管协议》

（四）关于申请募集富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金之法律意见书

（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

（七）中国证监会要求的其他文件

国海富兰克林基金管理有限公司

2010年2月12日