

华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金

更新的招募说明书

2011 年第 2 号

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一一年八月

华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金招募说明书（更新）

重要提示

华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2008 年 4 月 11 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准友邦华泰价值增长股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】543 号）和 2008 年 5 月 29 日《关于友邦华泰价值增长股票型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2008】214 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2008 年 7 月 16 日正式生效。

本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起，由“友邦华泰价值增长股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞价值增长股票”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，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、本基金的特定风险等等。

投资人认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2011 年 7 月 15 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2011 年 6 月 30 日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金招募说明书

目 录

一 绪言	4
二 释义	5
三 基金管理人	9
四 基金托管人	15
五 相关服务机构	19
六 基金的募集	38
七 基金合同的生效	41
八 基金份额的申购、赎回与转换	42
九 基金的非交易过户、转托管、冻结、质押及其他业务	49
十 基金的投资	50
十二基金的财产	60
十三 基金财产的估值	61
十四 基金的收益与分配	66
十五 基金的费用与税收	67
十六 基金的会计与审计	70
十七 基金的信息披露	71
十八 基金的风险揭示	74
十九 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	77
二十 基金合同的内容摘要	79
二十一 基金托管协议的内容摘要	92
二十二 对基金份额持有人的服务	102
二十三 其他应披露事项	104
二十四 招募说明书存放及查阅方式	105
二十五 备查文件	106

一 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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《华泰柏瑞价值增长股票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当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会核准。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。

二 释义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

- 基金或本基金：指华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金；
- 基金合同或本基金合同 指《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金合同》及
或本合同：对本基金合同的任何有效修订和补充；
- 招募说明书：指《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金招募说明书》
及其定期更新；
- 发售公告：指《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金份额发售
公告》；
- 托管协议：指《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金托管协议》及
其任何有效修订和补充；
- 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的自 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 日由中国证监会公布并于 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 日由中国证监会公布并于 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、同年 7 月 1 日实施
的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
- 元：指人民币元；
- 基金管理人：指华泰柏瑞基金管理有限公司；
- 基金托管人：指中国银行股份有限公司；
- 基金份额持有人：指根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投
资人；
- 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投
资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易
确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；

- 注册登记机构：**指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司或接受华泰柏瑞基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
- 投资人：**指个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人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人；
- 个人投资人：**指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资人：**指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 合格境外机构投资人：**指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资人；
- 基金份额持有人大会：**指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
- 基金募集期：**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：**指基金募集结束，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：**指本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，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购：**指在本基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：**指在本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持有的同一基金账户内的某一基金的基金份额从一个交易账户转入另一交易账户的行为；
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接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
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人开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资人开立的记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的开放式基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，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、其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
基金资产总值：	指基金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：	指以计算日基金资产总值减去以计算日基金负债后的价值；
基金份额净值：	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额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、地方法规、地方规章、部门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：

指本合同当事人不能预见、不能避免并不能克服且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何客观情况，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易。

三 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层

设立日期：2004 年 11 月 18 日

法定代表人：齐亮

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

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 17 层

联系人：沈炜

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：PineBridge Investments LLC 49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州高新区高新技术产业股份有限公司 2%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

齐亮先生：董事长，硕士，1994-1998 年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，1998-2001 年任中央财经领导小组办公室副局长，2001 年至 2004 年任华泰证券股份有限公司副总裁。

李应如女士：董事，MBA，曾就职于辽宁省投资公司、华光国际运输公司、君宝投资（上海）有限公司等，2004-2005 年任美林证券投资经理，2005-2007 年任加州公共雇员退休基金(CalPERS) 投资经理，2007 年至 2010 年任中国投资公司董事总经理，2010 年起兼任中国-东盟投资基金 CIO，2011 年起至今任柏瑞投资公司董事总经理。

吴祖芳先生：董事，硕士，1992 年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

陈国杰先生：董事，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999 年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理资深副总裁兼区域总监（亚洲）、美国国际集团（亚洲）投资有限公司执行董事等职。

朱小平先生：独立董事，硕士，1983 年至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生：独立董事，1977 年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生：独立董事，博士，1988-1997 年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师，1997-1999 年任长城证券有限公司投资银行部副总经理，1999-2000 年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理，2000-2001 年任北京华创投资管理有限公司执行总裁，2001 年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

2、监事会成员

常小抒先生：监事长，学士，2004-2007 年任美国国际集团全球投资公司（现称柏瑞投资有限责任公司）资深财务分析师，2007 年至今任柏瑞投资亚洲有限公司亚洲区首席财务官。

王桂芳女士：监事，硕士，1996-2003 年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理，2003-2006 年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理，2006 年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理、上证红利 ETF 基金经理，2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月起兼任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。

3、总经理及其他高级管理人员

陈国杰先生：总经理，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999 年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理资深副总裁兼区域总监（亚洲）、美国国际集团（亚洲）投资有限公司执行董事等职，并自华泰柏瑞基金管理有限公司成立至今任公司董事。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000 年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004 年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999 年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004 年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001 年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004 年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008 年 5 月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

汪晖先生，硕士。17 年证券（基金）从业经历。历任华泰证券股份有限公司高级经理、华宝信托投资有限公司信托基金经理、华泰证券股份有限公司投资经理。2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2004 年 7 月-2006 年 3 月任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资

资基金基金经理助理、2006年4月-2008年3月任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金经理、2007年6月-2008年6月任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理，2008年7月至今任华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金经理，2009年11月起兼任华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理，2009年12月至今任投资部总监，2010年6月22日起兼任华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金基金经理。2011年2月起任华泰柏瑞投资总监。

5、投资决策委员会成员

主席：总经理陈国杰先生；

成员：副总经理王溯舸先生；研究总监张净女士；研究部副总监蔡静女士；投资部总监汪晖先生；海外投资部总监李文杰先生；基金经理沈涛先生。

列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

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，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；

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；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、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；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

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、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；

13、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律、法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- （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）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）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；
- （9）贬损同行，以抬高自己；
- （10）以不正当手段谋求业务发展；
- （11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- （12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （13）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、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

(5) 防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

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

2、内部控制的主要内容

(1) 控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

(2) 风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

（5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、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）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四 基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010年度，中国银行被Global Finance（《环球金融》）评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被Euromoney（《欧洲货币》）评为2010年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私

人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2011 年 6 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心

动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）等119只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行

政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

1、直销机构：

华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：齐亮

电话：（021）38784638

传真：（021）50103016

联系人：沈炜

客服电话：400-888-0001，（021）38784638

公司网址：www.huatai-pb.com

2、代销机构

1) 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

传真：（010）66594853

客服电话：95566

公司网址：www.boc.cn

2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

传真：（010）66107914

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：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

传真：（010）85109219

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

4) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

联系人：陈春林

传真：(010) 68858117

客服电话：95580

公司网址：www.psbc.com

5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：曹榕

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408842

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

6) 招商银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195109

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

7) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

电话：(0755) 82088888

传真：（0755）25841098

客服电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

8) 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

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

联系人：王佳燕

电话：（010）65557090

传真：（010）65550827

客服电话：95558

公司网址：bank.ecitic.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

联系人：董云巍

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

10) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

11) 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

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：马旭

电话：（010）85238425

传真：（010）85238680

客服电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

12) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：万鸣

电话：（025）84457777

传真：（025）84579763

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

13) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：广东省深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492962

客服电话：95513

公司网址：www.lhzq.com

14) 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

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：李洋

电话：（010）66568587

传真：（010）66568536

客服电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

15) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：万建华

联系人：芮敏棋

电话：（021）38676666

传真：（021）38670666

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

16) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

电话：（021）54041654

传真：（021）54038844

客服电话：（021）962505

公司网址：www.sw2000.com.cn

17) 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

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

18) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源里 16 号琨莎中心十六层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：（010）84588888

传真：（010）84865560

客服电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

19) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：400-8888-108

传真：（010）65182261

客服电话：400-888-8108

公司网址：www.csc108.com

20) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

电话：（020）87555888

传真：（020）87555305

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

21) 国信证券股份有限公司

注册地址：广东省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：广东省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

联系人：齐晓燕

电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133302

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

22) 招商证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：广东省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

联系人：林生迎

电话：（0755）82960223

传真：（0755）82960141

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

23) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

客服电话：400-888-8788，10108998

公司网址：www.ebscn.com

24) 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

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：王灿江

电话：（025）52310598

传真：（025）52310586

客服电话：400-828-5888

公司网址：www.njzq.com.cn

25) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：（021）38565785

传真：（021）38565955

客服电话：400-888-8123

公司网址：www.xyzq.com.cn

26) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：（027）65799999

传真：（027）85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司客服网址：www.95579.com

27) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 20518 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

28) 财通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放路 111 号

办公地址：浙江省杭州市解放路 111 号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：（0571）87925129

传真：（0571）87828042

客服电话：0571—96336、上海地区：962336

公司网址：www.ctsec.com

29) 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

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：（0351）8686659

传真：（0351）8686619

客服电话：400-666-1618

公司网址：www.i618.com.cn

30) 平安证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：广东省深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：（0755）22626391

传真：（0755）82400862

客服电话：400-881-6168

公司网址：stock.pingan.com

31) 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

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：（0755）82825551

传真：（0755）82558355

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

32) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

电话：（021）88157761

传真：（021）88157761

客服电话：（0519）88166222、（021）52574550、（0379）64902266、免费服

务热线：400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

33) 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 21-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：（021）63325888

传真：（021）63327888

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

34) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 楼经纪业务部

法定代表人：石保上

联系人：程月艳、耿铭

电话：（0371）65585670

传真：（0371）65585665

客服电话：（0371）967218

公司网址：www.ccnew.com

35) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号华旭大厦

办公地址：上海市西藏中路 336 号华旭大厦

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：（021）53519888

传真：（021）53519888

客服电话：400-891-8918，（021）962518

公司网址：www.962518.com

36) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：（010）84183389

传真：（010）84183311

客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

37) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层(266061)

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022605

客服电话：（0532）96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

38) 中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：刘军

联系人：俞会亮

电话：（0571）85776115

传真：（0571）85783771

客服电话：（0571）96598

公司网址：www.bigsun.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

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：（010）88085858

传真：（010）88085195

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

40) 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：王京京

电话：（0431）85096530

传真：（0431）85096795

客服电话：4006000686，（0431）85096733

公司网址：www.nesc.cn

41) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：唐新宇

联系人：李丹

电话：（021）68604866

传真：（021）50372474

客服电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

42) 万联证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市中山二路 18 号广东电信广场 36—37 层

办公地址：广东省广州市中山二路 18 号广东电信广场 36—37 层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

电话：（020）37865070

传真：（020）37865008

客服电话：400-888-8133

公司网址：www.wlzq.com.cn

43) 东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦

办公地址：江苏省苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：（0512）65581136

传真：（0512）65588021

客服电话：（0512）33396288

公司网址：www.dwjq.com.cn

44) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：（0510）82831662

传真：（0510）82830162

客服电话：（0510）82588168

公司网址：www.glsc.com.cn

45) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

联系人：罗芳

电话：（021）68761616

传真：（021）68767981

客服电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

46) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

联系人：余雅娜

电话：（0791）6768763

传真：（0791）6789414

客服电话：400-886-6567

公司网址：www.avicsec.com

47) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

电话：（021）68634518

传真：（021）68865680

客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

48) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

电话：（0731）85832343

传真：（0731）85832214

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

49) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

办公地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：（0591）87383623

传真：（0591）87383610

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

50) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：（0731）84403319

传真：（0731）84403439

客服电话：（0731）84403319

公司网址：www.cfzq.com

51) 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

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

电话：（0551）2207939

传真：（0551）2645709

客服电话：（0551）96888

公司网址：www.gyzq.com.cn

52) 第一创业证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

联系人：梁大为

电话：（0755）82485087

传真：（0755）82485081

客服电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

53) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：（022）28451861

传真：（022）28451892

客服电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

54) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：陈康菲

电话：（021）50122485

传真：（021）50122078

客服电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

55) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：（010）63081000

传真：（010）63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

56) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 24 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 24 楼

法定代表人：郭林

联系人：陈敏

电话：（021）32229888-3121

客服电话：（021）63340678

公司网站：www.ajzq.com

57) 华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：（0931）4890208

传真：（0931）4890118

客服电话：（0931）4890100、4890619、4890618

公司网址：www.hlzqgs.com

58) 中国建银投资证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层

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

法定代表人：杨明辉

联系人：刘毅

电话：（0755）82023442

传真：（0755）82026539

客服电话：400-600-8008

公司网址：www.cjis.cn

59) 浙商证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：谢项辉

电话：（0571）87901053

传真：（0571）87901913

客服电话：（0571）967777

公司网址：www.stocke.com.cn

60) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：（010）66555316

传真：（010）66555246

客服电话：400-888-8993

公司网址：www.dxzq.net.cn

61) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛北街 26 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号华融大厦 A 座五层

法定代表人：丁之锁

联系人：梁宇

电话：（010）58568007

传真：（010）58568062

客服电话：（010）58568118；或前往各营业网点咨询

公司网址：www.hrsec.com.cn

62) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

法定代表人：王珠林

联系人：陈诚

电话：（023）63786464

传真：（023）63810422

客服电话：400-809-6096

公司网址：www.swsc.com.cn

63) 广州证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

办公地址：广东省广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人：吴志明

联系人：林洁茹

电话：（020）87323735

传真：（020）87325036

客服电话：961303

公司网址：www.gzs.com.cn

64) 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

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：潘鸿

电话：（010）66045446

传真：（010）66045500

客服电话：（010）66045678

公司网址：www.txsec.com 或 www.txjijin.com

65) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：鞠瑾

联系人：张同亮

电话：（021）64224632

客服电话：（0471）4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

66) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

电话：（010）59355941

传真：（010）66553791

客服电话：400-889-5618

公司网址：www.e5618.com

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择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：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

法定代表人：齐亮

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 17 层

电话：（021）38601777

传真：（021）38601799

联系人：陈培

(三) 律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）68818100

传真：（021）68816880

经办律师：秦悦民、王利民

(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

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：薛竞、单峰

六 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经 2008 年 4 月 11 日中国证监会《关于核准华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】543 号）核准募集。

（一）基金类型

契约型开放式，股票型基金

（二）基金存续期

不定期

（三）募集方式和销售场所

自 2008 年 6 月 11 日至 2008 年 7 月 10 日，本基金通过基金管理人的直销中心和中国银行、华泰证券等代销机构的销售网点公开发售。

投资者还可在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款后，通过登录本公司网站（www.huatai-pb.com）办理开户、认购等业务，有关基金网上交易的开通范围和具体业务规则请登录本公司网站查询。

（四）募集期限

本基金自 2008 年 6 月 11 日至 2008 年 7 月 10 日公开发售。根据《运作办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件、或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间，本基金可继续销售，但募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。同时也可根据认购和市场情况提前结束发售。

（五）募集对象

中华人民共和国境内的个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人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人。

（六）募集规模

本基金最低募集规模不低于 2 亿份。

（七）基金的面值

本基金初始面值为 1 元。

（八）投资人对基金份额的认购

1、认购方法

投资人认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在发售公告中确定并披露。本基金的实际发售时间为 2008 年 6 月 11 日至 2008 年 7 月 10 日。

2、认购的方式及确认

(1) 本基金认购采取金额认购的方式。

(2) 销售网点（包括直销中心和代销网点）受理申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记机构的确认为准。投资者可在本基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

(3) 基金投资人在募集期内可以多次认购，认购一经受理不得撤销。

(4) 若投资者的认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

3、认购的限额

(1) 在募集期内，投资者可多次认购，对单一投资者在认购期间累计认购份额不设上限。

(2) 认购最低限额：在基金募集期内，除发售公告另有规定，代销网点和基金管理人的网上交易系统每个基金账户首次最低认购金额为 1000 元人民币，单笔认购最低金额为 1000 元人民币；直销中心每个基金账户首次最低认购金额为 5 万元人民币，已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受首次认购最低金额的限制，单笔认购最低金额为 1000 元人民币。

各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

4、认购费率

本基金采取金额认购方式，认购费率最高不超过认购金额的 1.0%。

认购金额（元）	认购费率
认购金额 < 50 万	1.0%
50 万 ≤ 认购金额 < 100 万	0.8%
100 万 ≤ 认购金额 < 200 万	0.6%
200 万 ≤ 认购金额 < 500 万	0.4%
认购金额 ≥ 500 万	1000 元/笔

投资者重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

5、认购份额的计算

认购本基金的认购费用采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。投资人的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购资金在基金募集期间所产生的利息折成基金份额，归投资人所有，投资人的总认购份额的计算方式如下：

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

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

认购份额 = (净认购金额 + 认购期利息) / 基金份额初始面值

净认购金额以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；认购份额的计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资人投资 10,000 元认购本基金，如果认购期内认购资金获得的利息为 10 元，则其可得到的基金份额计算如下：

净认购金额 = $10,000 / (1 + 1\%) = 9,900.99$ 元

认购费用 = $10,000 - 9,900.99 = 99.01$ 元

认购份额 = $(9,900.99 + 10) / 1.00 = 9,910.99$ 份

即投资人投资 10,000 元认购本基金，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到 9,910.99 份基金份额。

（九）募集资金及利息的处理

1、基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

2、有效认购资金在募集期间产生的利息折成基金份额，归投资人所有。利息折算成基金份额，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。利息的计算和折算的基金份额的具体数额以注册登记机构的计算结果为准。该部分份额享受免除认购费优惠。

3、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。

（十）募集结果

截至 2008 年 7 月 10 日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 406,224,705.76 元人民币，折合基金份额 406,224,705.76 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 78,874.49 元人民币，折合基金份额 78,874.49 份。本次募集所有资金已于 2008 年 7 月 14 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 6,197 户，按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 406,303,580.25 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2008 年 7 月 16 日获确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

七 基金合同的生效

（一）基金备案的条件

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

- 1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

（二）基金的备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效；
- 2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。
- 3、本基金的基金合同已于 2008 年 7 月 16 日正式生效。

（四）基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本合同存续期内，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。

法律法规或中国证监会另有规定的，按其规定办理。

八 基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购、赎回与转换的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、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、赎回与转换。

（二）申购、赎回与转换办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日（基金管理人依据法律法规或基金合同约定公告暂停申购、赎回时除外）。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

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、赎回或转换的价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

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

（三）申购与赎回的原则

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

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、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，认/申购确认日期在先的基金份额先赎回，认/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 3 个工作日予以公告。

（四）申购、赎回与转换的程序

1、申购、赎回与转换申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理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。

投资者提交赎回或转换申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。否则投资者所提交的赎回或转换申请无效。

2、申购、赎回与转换申请的确认

基金管理人应在法律法规规定的时限内对基金投资者申购、赎回与转换申请的有效性进行确认。

3、申购与赎回申请的款项支付

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。

投资者赎回申请成功后，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本基金合同和有关法律法规规定处理。

（五）申购、赎回与转换的数额限制

1、代销网点和基金管理人的网上交易系统每个账户首次申购的最低金额为 1000 元人民币；单笔申购的最低金额为 1000 元人民币；

2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为 5 万元人民币；已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，单笔申购的最低金额为 1000 元人民币。

3、赎回与转换的最低份额为 500 份基金份额。基金份额持有人发起的赎回、基金转换或将基金份额转托管至另一个交易账户等业务，导致单个交易账户的基金份额余额少于 500 份时，余额部分基金份额将被强制赎回。具体处理结果以注册登记中心确认结果为准；

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

（六）申购、赎回与转换的数额和价格

1、申购份额、余额以及赎回金额的处理方式：

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用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

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，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2、申购费、赎回费和转换费

(1) 申购费

申购金额（元）	申购费率
申购金额 < 50 万	1.5%
50 万 ≤ 申购金额 < 100 万	1.2%
100 万 ≤ 申购金额 < 200 万	1.0%
200 万 ≤ 申购金额 < 500 万	0.6%
申购金额 ≥ 500 万	1000 元/笔

在申购费按金额分档的情况下，如果投资人多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

(2) 赎回费

持有期限	赎回费率
持有期 < 一年	0.50%
一年 ≤ 持有期 < 两年	0.25%
持有期 ≥ 两年	0

本基金的赎回费用由赎回人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率，调整后的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 个工作日前在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

与基金托管人协商一致，基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，并报中国证监会备案，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购、赎回费率。

(3) 转换费

基金管理人将另行公告各基金之间转换费率。

3、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资人的申购

金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

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

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

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

例：某投资人投资 5 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0520 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.5\%) = 49261.08 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.0520 = 46826.12 \text{ 份}$$

即：投资人投资 5 万元申购本基金，其对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.0520 元，则其可得到：46826.12 份基金份额。

4、赎回净额的计算

投资人在赎回本基金时缴纳赎回费，投资人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

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

$$\text{赎回净额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

例：某投资人赎回本基金 1 万份基金份额，持有时间为八个月，不到一年，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回净额为：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.0520 = 10520 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10520 \times 0.50\% = 52.60 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 10520 - 52.60 = 10467.40 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回净额为 10467.40 元。

5、转换份额的计算

$$\text{转出金额} = \text{转出基金份额} \times \text{转出基金 T 日基金份额净值}$$

$$\text{转出基金赎回费用} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

$$\text{转入金额} = \text{转出金额} - \text{转出基金赎回费用}$$

$$\text{转换费用} = \text{转入金额} / (1 + \text{转换费率}) \times \text{转换费率}$$

$$\text{净转入金额} = \text{转入金额} - \text{转换费用}$$

$$\text{净转入份额} = \text{净转入金额} \div \text{转入基金 T 日基金份额净值}$$

6、基金份额净值计算

$$\text{T 日基金份额净值} = \text{T 日基金资产净值} / \text{T 日发行在外的基金份额总数。}$$

基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数，基金份额

净值单位为元，计算结果保留小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（七）申购、赎回与转换的注册登记

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、基金注册与过户登记人将在T+1日对投资者T日的基金转换业务申请进行有效性确认。在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构查询基金转换的成交情况。

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

（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（指基金赎回份额与转出份额之和减去基金申购份额与转入份额之和后的余额）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，并在2日内在至少一种指定媒体予以公告。

（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，并应当在至少一种指定媒体公告。

(九) 拒绝或暂停申购、暂停赎回和转换及延缓支付赎回款项的情形及处理

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管理人无法受理投资者的申购申请；
- (2) 证券交易场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，应当依法在至少一家指定媒体公告。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依法在至少一家指定媒体上予以公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回或转换申请或延缓支付赎回款项：

- (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) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回与转换申请的情况；
- (4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- (5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或某几笔赎回或转换；
- (6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回与转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回与转换业务的办理并按照规定在至少一家指定媒体上公告。

3、发生基金合同、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回与转换申请的，报经中国证监会必要的审核后，可以暂停接受投资人的申购、赎回与转换申请。

4、暂停基金的申购、赎回与转换，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

5、暂停申购、赎回或转换期间结束，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一天，基金管理人应于重新开放日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新申购、赎回或转换的公告，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一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人将提前 2 日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购、赎回或转换的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人应提前 2 日，在至少一种指定媒体连续刊登基金重新开放申购、赎回或转换的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(十) 定期定额投资计划

本基金为基金投资者提供定期定额投资计划服务。通过定期定额投资计划，基金投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购本基金基金份额。该定期申购计划不受最低申购份额限制，具体以基金管理人的公告为准。

(十一) 基金转换

根据相关法律法规以及基金合同的规定，基金管理人提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的基金转换服务。基金转换收取一定的转换费用，相关规则及转换费率详情请见本公司发布的相关公告。

九 基金的非交易过户、转托管、冻结、质押及其他业务

(一)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符合法律法规规定的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”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。

在任何非交易过户的情况下，接受基金份额的主体必须是符合法律法规及本基金合同规定的可以持有本基金基金份额的投资者。

(二)符合条件的非交易过户申请按照基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(三)基金份额持有人可以按照基金管理人的规定办理其持有的基金份额在不同销售机构的转托管手续。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的相关规定。

(四)基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金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，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。该业务的具体办理方式以注册登记机构的相关规定为准。

(五)如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

十 基金的投资

（一）投资目标

本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

（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、权证、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种(如期权/备兑权证、股指期货、融券等)，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60% — 95%；现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证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，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年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

人们的群体偏见会经常导致资产的市场价格与内在价值的偏离。通过理性和专业的研究分析，发掘资产市场价格和价值之间的差异，投资于价值低估的股票。但仅仅是较低的估值不足以构成买入的充分理由，资产的市场价格有可能长期偏离其内在价值。因此公司基本面趋势和基本面趋势认同度被视为投资契机，可帮助避免“价值陷阱”和提高投资效率。本基金以价值投资方法为核心，结合成长/趋势投资方法，致力于获取相对稳定的资产增值，从而更好地分享中国经济的发展成果。

（四）投资策略

1、一级资产配置：基于对宏观经济和投资环境的分析和预测，全面评估证券市场的系统性风险和资本市场各大类资产的中长期预期收益率，确定基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例，适度控制系统性风险。

2、股票投资：主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益，重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票，辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。

首先，按照本基金管理人投资管理制度要求，在我们认知能力范围内，根据系统化的筛选指标和流程，选取具有持续经营能力的上市公司，确定初选股票库。然后，本基金通过定量筛选和定性分析，在初选股票库中综合选择符合价值增长标准的投资对象：1、遵循经典价值投资策略，采用价值评估指标（包括市盈率 P/E、市净率 P/B、市息率 P/D 等）挑选初选股票库中价值相对低估的股票；2、遵循合理价格增长策略（GARP），筛选(PEG) 指标较低、具备持续增长潜力但估值合理的优质股票；3、考察公司毛利率(Gross Margin) 和净资产回报率（ROE）水平，关注盈利能力和股东回报率高于市场平均水平的股票，以实现价值投资基础上的增值优选。在定量筛选的基础上，分析师进行深入分析和调查研究，借鉴外方股东的股票分类和评估标准，对股票进行深入的分和评估。根据企业的生命周期特性，对股票进行分类；评估公司的行业特征、经营状况、财务数据、业绩驱动因素等，构建股票财务分析预测模型，形成标准化的分析报告。在系统中获得较高评级的股票构成本基金的精选股票库。最后，本基金通过对精选股票库的公司在盈利、经营、治理等方面的深入分析，立足于优选具有较强内涵式业绩增长能力、持续为股东创造价值之能力突出的公司，从基本面趋势、估值以及企基本面趋势认同度三方面进行综合评估，捕捉基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的个股进行重点投资。

行业配置优化：在自上而下进行宏观经济、产业政策分析等基础上，综合分析各行业景气状况和趋势，对股票组合的行业分布进行适度调整，从行业配置的角度优化投资。行业配置优化只是在精选股票基础上的辅助策略。

3、债券投资：本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，采取自上而下的投资策略；通过对宏观经济和金融市场运行趋势深入研究和分析，把握货币政策和财政政策取向，对未来利率变动趋势和债券市场投资环境做出科学、合理判断；主要关注指标包括国民生产总值、固定资产投资、物价指数、货币供应量、信贷投放和汇率变动等宏观经济指标。

本基金债券投资采用主动性投资策略，主要包括久期管理、期限结构配置、个券信用风险管理等策略，通过持有国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离债）、短期融资券、回购以及资产证券化产品和其他固定收益类证券，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券组合，在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得。具体策略如下：

（1）久期管理是根据对宏观经济发展状况、债券市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效地控制整体债券资产利率风险。

(2) 期限结构配置是在确定组合久期后, 针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构, 包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等, 在长期、中期和短期债券间进行动态调整, 从不同期限债券的相对价格变化中获得收益。

(3) 个券信用风险管理是指本基金将依靠公司的行业与企业研究力量, 根据发债主体的各方面经营状况进行评估, 确定发行人信用状况, 以此作为品种选择的基本依据。

4、权证投资: 本基金将权证看作是辅助性投资工具, 其投资原则为优化基金资产的风险收益特征, 有利于基金资产增值, 有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将在权证理论定价模型的基础上, 综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素, 对权证进行合理定价。本基金权证投资主要运用的投资策略分为两类: 方向型投资以及套利型投资, 具体而言, 包括替代正股的杠杆交易策略、保底套利组合投资策略等。

(五) 投资决策依据

- 1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定;
- 2、投资分析团队对于宏观经济走势、宏观经济政策取向、行业增长速度等经济数据的量化分析的报告和建议;
- 3、投资分析团队对于企业和债券基础分析的报告和建议;
- 4、投资风险管理人員对于投资组合风险评估的报告和建议。

(六) 投资决策机制

- 1、投资决策委员会负责审定基金经理的整体投资策略和原则; 审定基金经理季度资产配置和调整计划; 审定基金季度投资检讨报告; 决定基金禁止的投资事项等。
- 2、基金经理: 在投资决策委员会的授权范围内, 根据基金的投资政策实施投资管理, 确定具体的投资品种、数量、策略, 构建优化和调整投资组合, 进行投资组合的日常分析和管理工作。

3、基金经理助理/投资分析员: 通过内部调研和参考外部研究报告, 编写有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析的各类报告, 提交基金经理, 作为投资决策的依据。

(七) 投资程序

1、研究部、投资管理部和集中交易室通过自身研究及借助外部研究机构形成有关上市公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告, 为本基金的投资管理提供决策依据。

- 2、投资决策委员会依据上述报告对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意

见。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，形成基金投资计划。

4、集中交易室依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

5、法律监察部对投资组合计划的执行过程进行监控。

6、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

（八）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

本基金为股票型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定被市场广泛认同的沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的上证国债指数。

（九）风险收益特征

本基金属主动管理的股票型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。

（十）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（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) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

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

(3) 本基金不得违反本合同关于投资范围和投资比例的约定；

(4) 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%，本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本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%；本基金投资于其它权证的有关比例限制，遵从法规或监管部门的相关规定；

(5) 基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

(6) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(十一) 投资组合比例调整

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约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

(十二) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。

- 2、有利于基金资产的安全与增值。
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

(十三) 基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2011 年 6 月 30 日

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	886,991,793.27	80.91
	其中：股票	886,991,793.27	80.91
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	199,244,748.81	18.17
6	其他资产	10,082,393.43	0.92
7	合计	1,096,318,935.51	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	-	-
C	制造业	626,135,558.98	57.46
C0	食品、饮料	125,686,737.73	11.53
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	104,101,630.29	9.55
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	49,463,555.62	4.04
C7	机械、设备、仪表	213,274,702.82	19.57
C8	医药、生物制品	123,936,360.54	11.37
C99	其他制造业	9,672,571.98	1.38
D	电力、煤气及水的生产和	38,636,385.60	3.55

	供应业		
E	建筑业	42,455,103.14	3.90
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	31,261,697.12	2.87
H	批发和零售贸易	9,273,736.98	0.85
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	81,982,266.45	7.52
K	社会服务业	52,023,729.00	4.77
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,223,316.00	0.48
	合计	886,991,793.27	81.40

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600502	安徽水利	2,668,454	42,455,103.14	3.90
2	600104	上海汽车	2,235,109	41,885,942.66	3.84
3	601117	中国化学	4,257,100	37,717,906.00	3.46
4	600740	山西焦化	2,080,500	33,995,370.00	3.12
5	600809	山西汾酒	462,629	32,407,161.45	2.97
6	600519	贵州茅台	148,232	31,518,570.16	2.89
7	600271	航天信息	1,209,818	31,261,697.12	2.87
8	000568	泸州老窖	685,256	30,918,750.72	2.84
9	000858	五粮液	863,445	30,842,255.40	2.83
10	000527	美的电器	1,556,440	28,622,931.60	2.63

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

1) 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

2)

2011年5月28日，宜宾五粮液股份有限公司（下称：五粮液，股票代码：000858）公告关于中国证监会《行政处罚决定书》。公告称，公司对有关事项进行了认真整改，整改取得明显实效，公司没有受到任何经济损失。公司按照整改方案中“切实解决关联交易”的承诺，已采取积极措施，使关联交易大幅减少。公司2010年的生产、销售同步大幅增长，利润大幅增加；2011年的生产经营发展势头良好。

本基金投资于“五粮液”股票是基于深入的基本面分析及投资价值判断，投资决策流程合法合规，并符合公司投资管理制度的相关规定。同时，本基金管理人的投研团队对五粮液受处罚事件进行了及时评估和跟踪研究，并认为该事项对该公司股票的投资价值未产生实质性影响。

3) 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。

4) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,629,486.64
2	应收证券清算款	8,216,027.16
3	应收股利	9,258.30
4	应收利息	39,587.71
5	应收申购款	188,033.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,082,393.43

5) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

6) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十一 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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2011 年 6 月 30 日。

1、 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效至 2008 年 12 月 31 日	-7.65%	1.64%	-28.72%	2.41%	21.07%	-0.77%
2009 年	75.36%	1.92%	73.60%	1.64%	1.76%	0.28%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	21.98%	1.41%	-9.12%	1.26%	31.10%	0.15%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	-9.47%	1.25%	-1.67%	0.99%	-7.80%	0.26%
基金合同生效至 2011 年 6 月 30 日	78.84%	1.62%	10.58%	1.60%	68.26%	0.02%

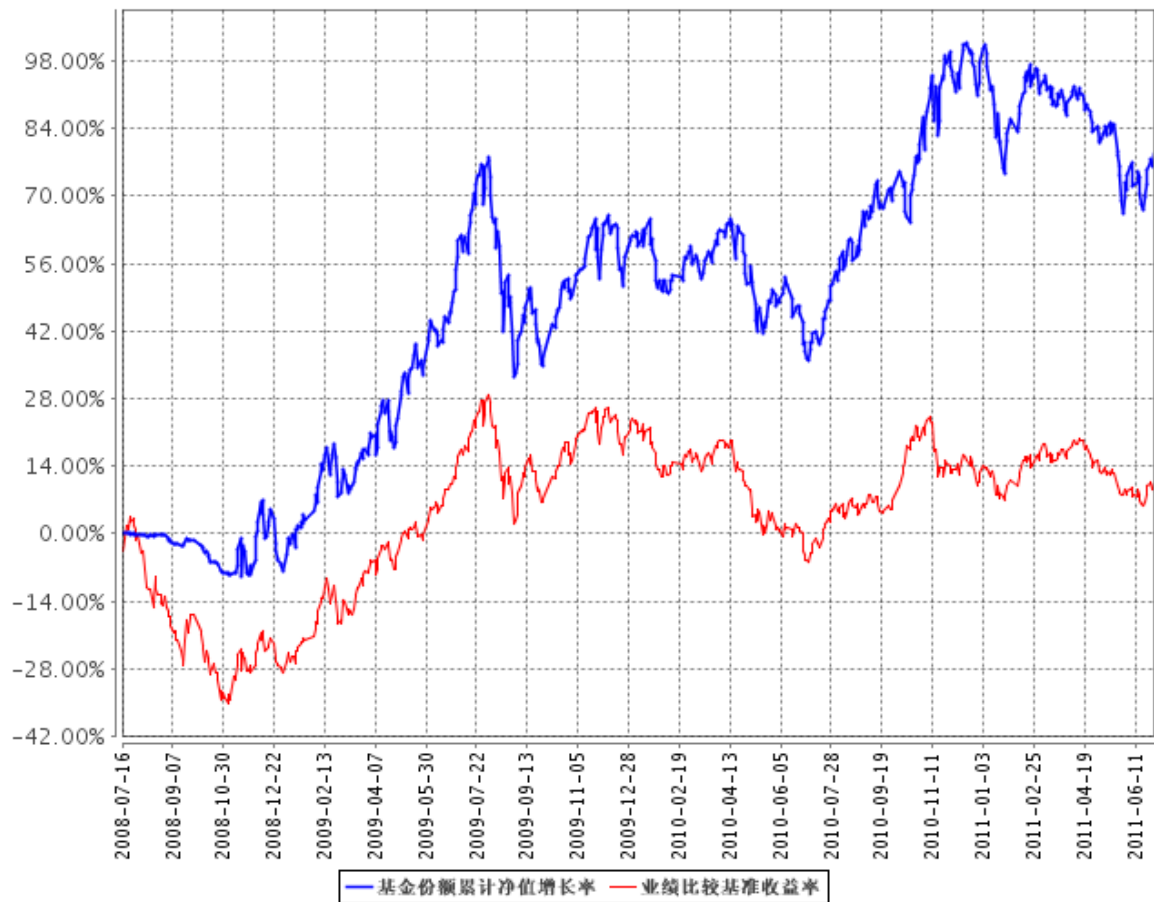
2、 基金的收益分配情况

期间	每 10 份基金份额分红数	备注
2009 年	3.10	2009 年 11 月 2 日实施
2010 年	2.00	2010 年 12 月 28 日实施
2011 年	-	
合计	5.10	

3、 图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



十二基金的财产

（一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金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

本基金的管理人和托管人根据相关法律法规开立基金资金账户、证券账户、及其他与基金运作有关的专用账户，开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。
- 4、基金管理人、基金托管人其自有的财产承担其自身的法律责任，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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三 基金财产的估值

（一）估值目的

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

（二）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

（三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值方法

1、股票估值方法

（1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，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）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；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。

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的情况下，按成本估值。

（3）有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值办法

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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) 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, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按有交易的最近交易日所采用的净价估值; 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) 未上市债券采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量的情况下, 按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种, 采用估值技术确定公允价值。

(5) 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。

(6) 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。

3、权证估值

(1) 配股权证的估值:

因持有股票而享有的配股权, 类同权证处理方式的, 采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值:

从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值, 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。未上市交易的认沽/认购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的情况下, 按成本估值; 因持有股票而享有的配股权, 停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值。

4、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下, 基金管理人采用上述 1-4 项规定的方法对基金财产进行估值, 均应当被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人具有充足理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可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的基础上与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成

估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，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。

就与本基金有关的会计问题，如经基金管理人与托管人在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额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份额净值予以公布。

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。国家另有规定的，从其规定。

（八）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代理销售机构或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平

无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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

3、差错处理原则

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

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 如果因基金管理人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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，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计价错误达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(九) 特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 5 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，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。

2008 年 9 月 16 日，基金管理人发布《关于旗下基金资产估值方法调整的公告》，自 2008 年 9 月 16 日起，对本基金持有的长期停牌股票等没有市价的投资品种的估值将根据“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》”规定的原则确定其公允价值，并参考《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，指数选用证券交易所公开发布的行业分类指数。

十四 基金的收益与分配

（一）收益的构成

1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

3、基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

（二）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

5、如果基金当期出现净亏损，则不进行收益分配；

6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；

7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 10%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

8、法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

（五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

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分红实施日的基金份额净值转为基金份额。

十五 基金的费用与税收

(一) 基金运作有关的费用

1、基金运作费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)；
- (4) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (7) 基金的资金汇划费用；
- (8) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金运作费用的计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的基金管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.50%年费率计提。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 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、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，如降低基金管理费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施 3 个工作日前在中国证监会指定媒体公告。

(2) 基金托管人的基金托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 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、休息日等，支付日期顺延。

3、本条第 1 款第（3）至第（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法律、法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金募集过程中所发生的会计师费和律师费从基金认购费用中列支，招募说明书、发售公告等信息披露费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、托管费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金管理费率、托管费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施 3 个工作日前在中国证监会指定媒体公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、认购费

本基金认购费率按认购金额的大小分为不同档次，最高不超过 1.0%，如下表所示：

认购金额（元）	认购费率
认购金额 < 50 万	1.0%
50 万 ≤ 认购金额 < 100 万	0.8%
100 万 ≤ 认购金额 < 200 万	0.6%
200 万 ≤ 认购金额 < 500 万	0.4%
认购金额 ≥ 500 万	1000 元/笔

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

2、申购费

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金采用前端收费的形式收取申购费用，申购费率按申购金额的大小分为不同档次，最高不超过 1.5%，具体如下表所示：

申购金额（元）	申购费率
申购金额 < 50 万	1.5%
50 万 ≤ 申购金额 < 100 万	1.2%
100 万 ≤ 申购金额 < 200 万	1.0%
200 万 ≤ 申购金额 < 500 万	0.6%
申购金额 ≥ 500 万	1000 元/笔

基金管理人可在法律法规允许的情况下，根据市场情况制定促销计划，在基金促销活动期间，基金管理人与基金托管人协商一致后，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购费率，并报中国证监会备案。

3、赎回费

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产，其

余部分用于支付注册登记费等相关手续费。赎回费率随投资人持有本基金的时间的增加而递减，投资人持有本基金一年以内的，赎回费率为 0.5%，投资人持有本基金一年到两年之间的赎回费率为 0.25%，投资人持有本基金两年以上的赎回费为零。

如下表所示：

持有期限	赎回费率
持有期 < 一年	0.50%
一年 ≤ 持有期 < 两年	0.25%
持有期 ≥ 两年	0

4、转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担，基金转换费率由基金管理人另行公告。

5、投资人通过网上交易方式办理基金申购或转换，适用网上交易费率，详见基金管理人网站的具体规定。

6、基金管理人与基金托管人协商一致后，可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。调整后的上述费率还将在最新的更新的招募说明书中列示。

7、与基金托管人协商一致，基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，并报中国证监会备案，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。

(三) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金资产中列支。

(四) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律、法规的规定履行纳税义务。

十六 基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规定编制基金会计报表，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以书面方式确认。

（二）基金年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意。更换会计师事务所应在 2 日内在至少一家指定媒体上公告并报中国证监会备案。

十七 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报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

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网站上登载基金合同生效公告。

（四）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。

（五）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报刊上。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报刊和网站上。

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。

（六）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、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、基金份额上市交易；
- 27、基金份额持有人大会的决议；
- 28、中国证监会规定的其他事项。

（七）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。

（八）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。

十八 基金的风险揭示

本基金的投资风险包括投资组合风险、管理风险、投资合规性风险和其它风险。

（一）投资组合的风险

投资组合风险主要包括系统性风险、非系统性风险以及流动性风险。

1、系统性风险

证券市场价格因受各种影响市场整体的因素如经济因素、政治因素、投资心理和交易监管制度等的影响而引起波动，从而导致基金收益水平变化，使本基金资产面临的风险。

主要包括：

1) 政策风险：货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险；

2) 经济周期风险：经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之发生变化，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，从而产生风险；

4) 购买力风险：基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

2、非系统性风险

非系统性风险是指基金持有的单个证券的特有风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等，都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资股票和债券的发行人经营不善，导致其股票价格下跌、股息、红利减少，或者存在所投资的企业债券发行人无法按时偿付本息，从而使基金投资收益下降。

3、流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致基金不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资人可能的巨额赎回，另一方面来自于其投资组合中个别投资品种持仓过于集中带来的变现困难。

1) 巨额赎回

本基金属于开放式基金，在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净

值。

2) 持股过于集中

本基金“自下而上”的股票组合构建方法容易造成对某一行业或企业持仓过于集中的情况，这也会带来一定的资产变现困难，加大了流动性风险。

（二）管理风险

基金的管理风险主要包括两个方面：一是在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。另一方面，基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

基金的管理风险包括以下几种具体风险：

（1）交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误；或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门；或者银行间债券市场交易对手未能履约导致基金利益的直接损失。

（2）系统故障风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

（3）交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手方的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

（5）会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

（三）投资合规性风险

投资合规性风险是指因公司及员工违反法律法规、行业准则、职业操守和职业道德而可能引起法律制裁、重大财务损失或者声誉损失的风险，主要合规性风险包括如下具体风险：

（1）法律风险

法律风险是指基金管理人违反法律法规、基金合同从而给基金份额持有人利益带来损失的风险。

（2）道德风险

道德风险是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中

的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

（四）其他风险

基金面临的其它风险包括因战争、自然灾害等不可抗力导致基金管理人、基金代销机构等无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

（五）本基金的特定风险

本基金的特定风险是在投资风格上的风险暴露。由于本基金的主要投资策略是价值投资，即要求所选股票内在价值相对低估，利用 P/E、P/B、PEG 等量化指标对股票进行初选，同时注重上市公司经营业绩对股价的内在驱动力，策略上属于增强型的价值投资策略。在这种情况下，如果本基金持有的价值型股票较多，而忽略了成长型投资，则有可能与基准产生一定的偏离，导致一定的跟踪误差，即相对风险。

价值型基金的风格偏离风险直接来源于市场的非理性行为。行为金融学认为，现实世界中的投资者并非理性人，价值只能在一定程度上决定资产的价格，价格偏离价值的程度往往会超出绝大多数人的预计。因此基金管理人必须时刻关注价格偏离价值所带来的投资风险。从投资管理的角度讲，这种偏离风险可以从证券市场的风格轮换来解释，也就是说，市场上由于经济周期、投资者的构成等因素不断变化，投资风格会经常发生变化，如果投资组合集中于某一种风格的资产，则在短期内可能会出现业绩表现相对较差的情况。对此，基金管理人将通过控制基金股票资产的风格偏离度来控制风格风险暴露。

十九 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、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。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（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。

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) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限;
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;
- (4) 对基金财产进行评估和变现;
- (5) 制作清算报告;
- (6) 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;
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (8) 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组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

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)、(2)、(3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

6、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。

- 7、基金财产清算账册及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) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法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。

2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 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) 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；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

3、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

(3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

(5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定、相关协议对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 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并确定有关费率；

(16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

4、基金管理人的义务

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

- (2) 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；
- (3) 办理基金备案手续；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 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；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制中期和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；
- (12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (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以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
- (17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (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的合法权益，应承担赔偿责任，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) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

5、基金托管人的权利

(1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

(5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

(6) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

6、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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

(5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

(6) 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；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其它相关资料；

(8) 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；

(9) 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以保密，不得向他人泄露；

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告的相关内容出具意见，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；

- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 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；
- (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) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 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；
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。

2、有以下情形之一时，应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) 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；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (7) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (8) 本基金与其他基金合并；

(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) 法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费率、基金托管费率；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式：

(1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(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% 的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

(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。

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式及会议形式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 代理投票授权委托书的内容要求、送达时间和地点；
- (4) 会务常设联系人姓名、电话；
- (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) 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、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和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、基金份额持有人出席会议的方式

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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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，如果基金管理人或托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证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、本基金合同和会议通知的规定；

(2) 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占权益登记日基金总份额的 50% 以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;

(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占权益登记日基金总份额的 50% 以上;

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

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件, 则召集人可另行确定会议召开时间, 并于会议召开日前 30 天在指定媒体公告, 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应保持不变。

采取通讯方式进行表决时, 符合法律法规、基金合同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。

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日代表基金份额 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:

a、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进行解释和说明。

b、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) 单独或合并持有权利登记日代表基金份额 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，或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，未获得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不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人授权的代表宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 个工作日由召集人在大会聘请的公证机关的公证员监督下统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

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。

8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份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) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

9、计票

(1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中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(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推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并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果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者基金份额持有人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。

4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人在聘请的公证机关的公证员监督下进行计票。

10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由

基金份额持有人大会召集人在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(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。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(三) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

(2) 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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止；

(2) 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

(3) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

(4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

3、基金财产的清算

(1) 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。

(2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，

在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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。

(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) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 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；
- 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 8) 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组优先从基金财产中支付。

(5) 基金剩余财产的分配

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)、2)、3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(6) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算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。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

(四) 争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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

二十一 基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层

法定代表人：齐亮

成立时间：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。基金托管人对基金投资的监督和核查自本《基金合同》生效之日起开始。主要包括以下方面：

1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金的投资范围和投资对象应符合法律法规以及《基金合同》的规定。基金管理人应将拟投资的符合价值增长选股标准的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以在不违反法律法规和《基金合同》规定的前提下，根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2) 对基金投融资比例进行监督。监督内容包括但不限于：《基金合同》约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例符合法律法规规定及《基金合同》约定的时间要求、法律法规允许的基金投资比例调整期限等；基金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；

3) 对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4) 基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5) 基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

①银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；

②银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；

③如遇特殊情况无法按照以上方式执行交易，基金经理需报本基金管理人的投资总监或投资总监授权的人员批准。

6) 基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对存款银行的名单予以更新和调整，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7) 对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

(3) 基金托管人在上述第(1)、(2)项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应及时向中国证监会报告。

(4) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》、本协议约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

(5) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,包括但不限于:在规定时间内答复基金托管人,就基金托管人的疑义进行解释或举证,并就违法违规问题进行改正。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

2、基金管理人对基金托管人的业务核查

(1) 在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时,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对基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。

(3) 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) 基金财产的保管

1、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，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

(5) 除依据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、《基金合同》生效前募集资金的验资和入账

(1) 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，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》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

(2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。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) 本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其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配

合和协助。

5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

(2) 本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。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) 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的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

6、债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、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。

8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

(四) 基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

(2) 基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果发送给基金管理人，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。

(3) 当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，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) 基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

(5) 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

(6) 由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

(7) 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(8) 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

2、基金会计核算

(1) 基金账册的建立

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

(2) 会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

(3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。《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，半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以

基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

（五）基金份额持有人名册的登记与保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

2、基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应在发现后及时向中国证监会报告。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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外。

（六）适用法律和争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

（七）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或本基金更换基金托管人；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算组

1) 自《基金合同》终止事由发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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）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) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 制作清算报告；

6) 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;

7) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

8) 对基金财产进行分配。

(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) 基金剩余财产的分配

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)、2)、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。

(6) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十二 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金持有人的需要和市场的变化，有权增加或修改这些服务项目：

（一）资料寄送

每次交易结束后，投资者可通过销售机构的网点查询和打印交易确认单，或通过电话、网上服务手段查询交易确认情况。基金管理人向投资者寄送交易确认单。

在从销售机构获取准确的邮寄地址和邮政编码的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

1、认购确认书

在基金募集期间开户的，于基金合同生效后的 15 个工作日内向投资人寄送认购确认书。

2、基金交易对账单

基金交易对账单包括季度对账单与年度对账单：在每季度结束后的 15 个工作日内向该季度有交易的基金持有人以书面或电子文件形式寄送；在每年度结束后的 15 个工作日内对所有基金持有人以书面或电子文件形式寄送。

3、其他相关的信息资料

指随基金交易对账单不定期寄送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、基金经理报告、客户咨询问答等。

（二）红利再投资

当收益分配时，基金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自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

（三）定期投资计划

本基金可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金单位。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施情况和业务规则详情请见本公司发布的相关公告。

（四）基金转换

根据相关法律法规以及基金合同的规定，基金管理人提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的基金转换服务。基金转换收取一定的转换费用，相关规则及转换费率请见本公司发布的相关公告。

（五）在线服务

基金管理人可利用自己的网站（www.huatai-pb.com）为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。对于直销客户，基金管理人还提供网上交易服务。

（六）客户服务中心（Call Center）电话服务

呼叫中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音查询服务，客户可通过电话收听最新公告信息、基金份额净值，并可自助查询基金账户余额信息等。同时，呼叫中心提供工作日 9:00—17:30 的人工服务。

呼叫中心电话：400—888—0001（免长途费），或 021-38784638，按“0”可转人工坐席。传真：021-50103016。

（七）客户投诉处理

投资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。投资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。

二十三 其他应披露事项

1、本基金及基金管理人的有关公告（自 2011 年 1 月 16 日至 2011 年 7 月 15 日），下列公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报和基金管理人公司网站：

华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金参加浙商证券网上交易、电话委托等基金申购费率优惠活动的公告	2011-6-30
华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2011-6-29
华泰柏瑞基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	2011-6-8
华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券股份有限公司及天相投资顾问有限公司为定期定额申购业务办理机构的公告	2011-5-28
华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	2011-4-25
华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销平台开通汇付天下“天天盈”模式的公告	2011-4-18
华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行基金申购最低 4 折优惠活动的公告	2011-4-1
华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要	2011-3-30
华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金 2010 年年度报告	2011-3-30
华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金更新的招募说明书 2011 年第 1 号	2011-3-1
华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）2011 年第 1 号	2011-3-1
华泰柏瑞基金管理有限公司参加海通证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	2011-2-23
华泰柏瑞基金管理有限公司高级管理人员离任公告	2011-2-12
华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	2011-1-22

二十四 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十五 备查文件

- (一) 中国证监会核准华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金募集的文件；
- (二) 《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金托管协议》；
- (四) 法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (七) 中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一一年八月三十一日