

# 中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）

## 更新招募说明书

（2011年第2号）

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二〇一一年九月

## 重要提示

（一）本基金经 2006 年 11 月 29 日中国证券监督管理委员会下发的《关于同意中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监基金字[2006]243 号文）核准募集。本基金基金合同于 2007 年 1 月 29 日正式生效。

（二）基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

（三）投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

（四）基金的过往业绩并不预示其未来表现。

（五）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，也不保证基金份额持有人的最低收益。

（六）本更新招募说明书所载内容截止日 2011 年 7 月 28 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、	绪 言.....	4
二、	释 义.....	5
三、	基金管理人.....	11
四、	基金托管人.....	21
五、	相关服务机构.....	25
六、	基金的募集.....	37
七、	基金合同的生效.....	38
八、	基金的上市交易.....	39
九、	基金份额的场外申购、转换与赎回.....	41
十、	基金份额的场内申购与赎回.....	49
十一、	基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记.....	54
十二、	基金的投资.....	56
十三、	基金的业绩.....	66
十四、	基金的财产.....	68
十五、	基金资产的估值.....	69
十六、	基金的收益分配.....	76
十七、	基金的费用与税收.....	78
十八、	基金的会计与审计.....	82
十九、	基金的信息披露.....	83
二十、	风险揭示.....	89
二十一、	基金的终止与清算.....	93
二十二、	基金合同的内容摘要.....	95
二十三、	基金托管协议的内容摘要.....	110
二十四、	对基金份额持有人的服务.....	124
二十五、	其他应披露事项.....	126
二十六、	招募说明书的存放及查阅方式.....	127
二十七、	备查文件.....	128

## 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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售管理办法》”）等有关法律法规及《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释 义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 基金或本基金：**指中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）
- 基金管理人或本基金管理人：**指中欧基金管理有限公司
- 基金托管人或本基金托管人：**指兴业银行股份有限公司
- 基金合同或本基金合同：**指《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 托管协议：**指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 招募说明书：**指《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每6个月更新1次，并于每6个月结束之日后的45日内公告
- 基金份额发售公告：**指《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）份额发售公告》
- 法律法规：**指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 《基金法》：**指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
- 《销售办法》：**指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁

- 布机关对其不时作出的修订
- 《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》及颁布机关对其不时作出的修订
- 《运作办法》:** 指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订
- 中国证监会:** 指中国证券监督管理委员会
- 中国银监会:** 指中国银行业监督管理委员会
- 基金合同当事人:** 指受基金合同约束, 根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体, 包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 个人投资者:** 指符合法律法规规定或经中国证监会批准可投资于证券投资基金的自然人
- 机构投资者:** 指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 合格境外机构投资者:** 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》规定的条件, 经中国证监会批准投资于中国证券市场, 并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
- 投资人:** 指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称
- 基金份额持有人:** 指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 基金销售业务:** 指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、

- 转托管及定期定额投资等业务
- 销售机构：**指直销机构、代销机构以及具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的会员单位，其中场外销售机构指直销机构和代销机构
- 直销机构：**指中欧基金管理有限公司
- 代销机构：**指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
- 基金销售网点：**指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
- 注册登记业务：**指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
- 注册登记机构：**指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
- 基金账户：**指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 基金交易账户：**指场外销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖中欧新趋势股票型基金（LOF）基金份额的变动及结余情况的账户
- 基金合同生效日：**指基金募集达到法律规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续并经证监会书面确认的日期
- 募集期：**指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
- 存续期：**指基金合同生效至终止之间的不定期期限

<b>工作日：</b>	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
<b>T日：</b>	指销售机构确认的投资人有效申请工作日
<b>T+n日：</b>	指自T日起第n个工作日(不包含T日)
<b>开放日：</b>	指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
<b>交易时间：</b>	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段，具体时间见基金份额发售公告
<b>认购：</b>	指在基金募集期间，投资人通过场内或场外申请购买基金份额的行为
<b>申购：</b>	指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定通过场内或场外申请购买基金份额的行为
<b>赎回：</b>	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件通过场内或场外要求基金管理人购回基金份额的行为
<b>场外：</b>	指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所
<b>场内：</b>	指通过深圳证券交易所内的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所
<b>场外认购：</b>	指基金募集期内投资人通过场外销售机构申请购买基金份额的行为
<b>场内认购：</b>	指基金募集期内投资人通过具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位和交易所开放式基金交易系统申请购买基金份额的行为
<b>场内申购：</b>	指基金合同生效后，投资人通过具备办理证券交易所场内申购业务资格的深圳证券交易所会员单位和交易所开放式基金交易系统，申请购买基



	金份额的行为
<b>场外申购</b>	指基金合同生效后，投资人通过场外销售机构申请购买基金份额的行为
<b>场内赎回：</b>	指投资人通过具备办理证券交易所场内赎回业务资格的深圳证券交易所会员单位和交易所开放式基金交易系统，申请卖出本基金份额的行为
<b>场外赎回</b>	指基金合同生效后，投资人通过场外销售机构申请卖出基金份额的行为
<b>注册登记系统：</b>	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
<b>证券登记结算系统：</b>	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
<b>上市交易：</b>	指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
<b>系统内转托管：</b>	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
<b>跨系统转登记：</b>	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
<b>基金转换：</b>	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的公告在基金份额与基金管理人管理的其他开放式基金份额间的转换行为
<b>巨额赎回：</b>	本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的10%时

<b>元：</b>	指人民币元
<b>基金收益：</b>	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
<b>基金资产总值：</b>	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
<b>基金资产净值：</b>	指基金资产总值减去基金负债后的价值
<b>基金份额净值：</b>	指基金份额的资产净值
<b>基金资产估值：</b>	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
<b>指定媒体：</b>	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
<b>不可抗力：</b>	指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、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等情形

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
- 3、办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
- 4、法定代表人：唐步
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2006年7月19日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：桑林
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：1.2亿元人民币
- 15、股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称UBI）出资5,880万元人民币，占公司注册资本的49%；

国都证券有限责任公司出资5,640万元人民币，占公司注册资本的47%；

平顶山煤业（集团）有限责任公司出资480万元人民币，占公司注册资本的4%；

上述三个股东共出资12,000万元人民币。

#### （二）主要人员情况

- 1、基金管理人董事会成员

**唐步先生**，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。20年以上证券从业经验。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理。

**Gianluca Trombi 先生**，中欧基金管理有限公司副董事长，意大利意联银行国际业务部主管，意大利籍。曾任摩根士丹利（米兰）投资银行部总监、意大利金融机构小组主管；摩根士丹利（伦敦/米兰）投资银行部执行总监；瑞士联合银行（苏黎世）金融机构小组副总裁；毕马威会计师事务所（咨询业务·米兰）公司/战略金融服务资深经理；毕马威会计师事务所（审计业务·米兰）资深审计师。

**Guido Masella 先生**，中欧基金管理有限公司董事，意大利意联银行亚太区商务拓展主管，意大利籍。曾任意大利中央银行（罗马）国际研究处、国际金融机构部经济师；意大利驻华大使馆（北京）财务专员；意大利中央银行（布鲁塞尔）本地代表办事处经济师；意大利中央银行（维罗纳）银行和金融系统监管署分析师。

**陈金占先生**，中欧基金管理有限公司董事，国都证券有限责任公司副总经理，中国籍。历任中共北京市纪律检查委员会/北京市打击经济犯罪办公室成员、北京国际信托投资有限公司金融总部和证券总部副经理/律师。

**Barry Livett 先生**，中欧基金管理有限公司独立董事，百库国际金融有限公司首席执行官，英国籍，硕士学历。历任伦敦证券交易所高级分析员、国际证券咨询有限公司（International Securities Consultancy Ltd.）咨询师、新加坡联合银行高级经理、Morgan Grenfell 亚洲区经理助理、中银国际助理董事、欧中金融服务合作项目协调员/证券部董事。

**刘桓先生**，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，中央财经大学副院长/教授。

**肖微先生**，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，美国哥伦比亚大学法学硕士，君合律师事务所主任/合伙人。曾任中国法律事务中心律师。

## 2、基金管理人监事会成员

**廖海先生**，中欧基金管理有限公司监事，中国籍，武汉大学法学博士、复旦

大学金融研究院博士后，历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州Schulte Roth & Zabel LLP律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。现任上海源泰律师事务所合伙人。

**刘中先生**，中欧基金管理有限公司监事，国都证券有限责任公司副总裁，中国籍，工学博士。历任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券发行部市场营销处处长；南方证券投资银行部副总；国信证券投资银行总部执行副总。

**刘玫女士**，中欧基金管理有限公司职工监事，中欧基金管理有限公司财务部总监，加拿大籍，研究生学历。历任北京掌联科技有限公司行政总监、成都市政府外商投资促进中心项目经理、加拿大DESROSIERS-LOMBARDI-DOLBEC注册会计师事务所审计师、美国GENERAL EASTERN TRADING 公司财务经理。

### 3、公司高级管理人员

**唐步先生**，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

**刘建平先生**，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。北京大学法学硕士，15年以上证券及基金从业经验。历任北京大学助教、副科长；中国证券监督管理委员会基金监管部副处长；上投摩根基金管理有限公司督察长。

**朱彦先生**，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学经济学学士，15年以上证券从业经验。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工；海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管；海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理；北京国际信托投资公司上海昆明路证券营业部总经理；国都证券有限责任公司上海通北路证券营业部总经理；上海长阳路证券营业部总经理。

**徐红光先生**，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。北京大学管理学硕士，11年以上证券从业经验。历任上海汽车集团财务公司证券部研究员，华安基金管理公司市场业务部总监助理，上投摩根基金管理公司上海销售部总监、总经理助理兼销售部总监。

**黄桦先生**，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理，中国籍。复旦大学经济学硕士，21年以上证券及基金从业经验。曾先后就职于上海爱建信托公司、上海万国证券公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券有限责任公司等金融机构。历任光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监、信诚基金管理有限公司运营部总监及信息技术部总监。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）现任基金经理

**王海先生**，中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理，中国籍。特许金融分析师（CFA），工商管理硕士，9年证券从业经历。历任上海中技投资顾问公司项目经理、通用技术投资公司高级研究员、投资部副总经理，中海基金管理有限公司专户资产管理部专户投资经理，中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理助理。现任中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（2010年9月2日起至今）。

**刘水云女士**，中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理，中国籍。特许金融分析师（CFA），挪威管理学院工商管理硕士，11年证券从业经历。历任波士顿基金管理有限公司高级研究员、组合经理，长信基金管理有限公司高级研究员，国海富兰克林基金管理有限公司助理基金经理，上投摩根基金管理有限公司助理基金经理，中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理助理。现任中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（2010年12月30日起至今）。

##### （2）历任基金经理

**殷觅智（Ian Midgley）先生**，于2007年1月29日至2009年7月16日期间担任中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理。

**王磊先生**，于2008年8月29日至2010年9月2日期间担任中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理。

#### 5、公司投资决策委员会成员

公司投资决策委员会的成员为：公司投资总监兼研究部总监周蔚文先生、总经理刘建平先生、权益投资部总监苟开红女士、固定收益部总监聂曙光先生、基金经理林钟斌先生、基金经理沈洋先生。其中投资总监兼研究部总监周蔚文先生任投资决策委员会主席。

#### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

##### （三）基金管理人的职责

##### 1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不

限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自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并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金认购费、申购费、基金赎回手续费和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- （4）销售基金份额；
- （5）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；
- （6）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- （7）依据本基金合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
- （8）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，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （11）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （12）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；
- （13）选择、更换销售代理机构，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；
- （14）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；
- （15）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （16）依法召集基金份额持有人大会；

（17）法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- （1）依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- （2）办理基金备案手续；
- （3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- （4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- （5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- （6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- （7）依法接受基金托管人的监督；
- （8）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- （9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- （10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- （11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- （12）编制中期和年度基金报告；
- （13）严格按照《基金法》、《信息披露办法》、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相关资料；

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

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

#### （四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人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、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。
- 4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责。
- 5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### **（五）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、基金合同和中国证监会的有关规定，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。

#### **（六）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。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- (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。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
- (4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
- (5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，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、内部控制的体系结构**

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管

理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

（3）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告或通报。

（4）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

（5）风险控制委员会：负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。

（6）监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

（7）业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

### 3、内部控制的措施

（1）部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

（2）严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

（3）实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的

岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

（4）建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

（5）建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

（6）建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

#### 4、基金管理人关于内部合规控制声明书

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

成立时间：1988年7月20日

组织形式：股份有限公司

注册资本：107.86亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2005]74号

联系人：张志永

联系电话：021-62677777\*212004

传真：（021）62159217

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本107.86亿元。

开业20多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2011年一季末，兴业银行资产总额为1.92万亿元，股东权益为971.01亿元，不良贷款比率为0.4%，一季度累计实现净利润52.21亿元。根据英国《银行家》杂志2010年7月发布的全球银行1000强排名，兴业银行按总资产排名位列第93位，按一级资本排名97位。根据美国《福布斯》发布的2010全球上市公司2000强排名，兴业银行综合排名第245位，在113家上榜的中国内地企业中排名第14位。

#### 2、主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处、委托资产管理处、产品研发处等处室，共有员工 50 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### 3、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截止2011年3月31日，兴业银行已托管开放式基金13只——兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、中欧沪深300指数增强型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金，托管基金财产规模277.93亿元。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 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

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

（1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

（6）有效性原则：内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

（7）审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

（8）责任追究原则：各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

#### 4、内部控制制度及措施

（1）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（2）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（3）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（4）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（5）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（6）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

### （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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、基金份额的申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

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，并及时向中国证监会报告。

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



## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、场外发售机构

##### （1）直销机构：

##### 1) 中欧基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

联系人：桑林

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

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

##### 2) 中欧基金管理有限公司网上交易系统

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

##### （2）代销机构：

##### 1) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：021-52629999

联系人：吴敏卿

客服电话：95561

网址：<http://www.cib.com.cn>

##### 2) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

电话：010-67596139

传真：010-66275654

客服电话：95533

联系人：王琳

网址：<http://www.ccb.com>

3) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座6层

办公地址：北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座6层

法定代表人：刘安东

电话：010-68858095

传真：010-68858116

联系人：陈春林

客服电话：95580

网址：<http://www.psbc.com/>

4) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：兰奇

客服电话：95555

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

5) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：王斌

电话：010-65541585

传真：010-65541230

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

6) 中国民生银行股份有限公司

住所：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

联系电话：010-58351666

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

网站：www.cmbc.com.cn

7) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

8) 国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9、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、10层

法定代表人：常喆

电话：010-84183390

传真：010-64482090

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

网址：<http://www.guodu.com>

9) 光大证券股份有限公司

住所：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

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客服电话：4008888788，10108998

网址：<http://www.ebscn.com>

10) 广发证券股份有限公司

住所：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：林治海

电话：95575 或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：黄岚

网址：<http://www.gf.com.cn>

11) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼

法人代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn>

12) 华泰联合证券有限责任公司

住所：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：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

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌、庞晓芸

客服电话：95513

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

13) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路128号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：王霖

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客服电话：95538

网址：<http://www.qlzq.com.cn>

14) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：李清怡

客服电话：021-962505

网址：<http://www.sw2000.com.cn>

15) 兴业证券股份有限公司

住所：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 弄正大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565783

联系人：谢高得

客服电话：4008888123

网址：<http://www.xyzq.com.cn>

16) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

电话：010-66568888

传真：010-66568536

联系人：田薇

客服电话：4008-888-888

网址：<http://www.chinastock.com.cn>

17) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客服电话：95565、4008888111

网址：<http://www.newone.com.cn>

18) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：4008888108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：<http://www.csc108.com>

19) 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：汤世生

电话：010-62267799-6416

传真：010-62294601

联系人：张智红

客服电话：4008-000-562、010-62294600

网址：<http://www.ehongyuan.com.cn>

20) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路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

网址：<http://www.htsec.com>

21) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

法定代表人：陈敬达

全国免费业务咨询电话：95511

开放式基金业务传真：0755-82433794

联系人：郑舒丽

联系电话：4008866338

网址：<http://www.PINGAN.com>

22) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座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

客服热线：010-66045678

传真：010-66045500

联系人：林爽

联系人电话：010-66045608

网址：<http://www.txsec.com>、<http://www.txjijin.com>

23) 国元证券股份有限公司

住所：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

法人代表：凤良志

联系人：李飞

联系电话：0551-2207936

联系传真：0551-2207965

客服电话：95578，4008888777

网址：<http://www.gyzq.com.cn>

24) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路618号良友大厦

办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

客服热线：4008888666

传真：021-62566568

联系人：芮敏祺

联系电话：021-38676161

网址：<http://www.gtja.com>



25) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服热线：0591-96326

传真：0591-87383610

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

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

26) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

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

客服热线：4008-001-001

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82558305

网址：<http://www.essences.com.cn>

27) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

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

客服热线：400-800-8899

传真：010-63080978

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

网址：<http://www.cindasc.com>

28) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

客服热线：95597

传真：025-84579763

联系人：万鸣

联系电话：025-83290979

网址：www.htsc.com.cn

29) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

客服热线：400-8888-128

传真：021-68767880

联系人：徐可

联系电话：021-68761616

网址：www.tebon.com.cn

30) 英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦西区 11 楼 1105B

法定代表人：赵文安

客服热线：4008-698-698

传真：0755-83007167

联系人：王睿

联系电话：0755-83007069

网址：www.ydsc.com.cn

31) 中信证券股份有限公司

住所：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：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

客服热线：400-666-5589

传真：010-84865560

联系人：陈忠

联系电话：010-84683893

网址：www.citics.com

32) 爱建证券有限责任公司

住所：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

客服热线：021-63340678

传真：021-62878783

联系人：陈敏

联系电话：021-32229888-3121

网址：www.ajzq.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

## 2、场内发售机构：

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

### （二）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号法人代表：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

### （三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：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

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、黎明

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：吕红

#### （四）会计师事务所和经办注册会计师

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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

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：张鸿

经办会计师：薛竞 张鸿

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2006 年 11 月 29 日证监基金字[2006]243 号文核准募集。募集期间为 2007 年 1 月 4 日至 2007 年 1 月 23 日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，募集期共募集 6,874,704,054.16 份基金份额（含利息转份额），有效认购户数为 188,717 户。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同于 2007 年 1 月 29 日正式生效。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模限制

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

## 八、基金的上市交易

基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记在证券登记结算系统中，再上市交易。

### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所。

### （二）上市交易的时间

本基金已于 2007 年 4 月 23 日开始上市交易。

### （三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循深圳证券交易所相关规则及规定。

### （四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定办理。

### （五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### （六）上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照相关法律法规、中国证监会及深交所的相关规定执行。

### （七）暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后，发生下列情况之一时，应暂停上市交易：

- 1、基金份额持有人数低于 1000 人；
- 2、基金募集金额低于 2 亿元；
- 3、违反国家有关法律、法规，被中国证监会决定暂停上市；

- 4、严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的；
- 5、深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情况。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人在接到深圳证券交易所通知后，应立即在至少一种指定报刊和网站上刊登暂停上市公告。

#### （八）恢复上市的公告

暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市，并在至少一种证监会指定媒体发布公告。

#### （九）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种证监会指定媒体发布公告。

（十）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。



## 九、基金份额的场外申购、转换与赎回

本章内容仅适用于本基金的场外申购和赎回业务。

### （一）场外申购与赎回业务办理的场所

投资人可在以下场所办理基金申购与赎回等业务：

- 1、本基金管理人的直销网点
- 2、不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体销售机构由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所，并予以公告。

### （二）场外申购与赎回的办理时间

- 1、本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理，具体业务办理时间另行公告。基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的 3 个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。
- 2、申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。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。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。
- 3、若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应对投资人利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。
- 4、本基金自 2007 年 4 月 23 日开始办理场外申购、赎回业务。

### （三）场外申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则。即申购、赎回价格按申请当日证券交易所收市后计算的基金份额净值执行。
- 2、“金额申购、份额赎回”原则。即申购以金额申请，赎回以份额申请。
- 3、赎回遵循“先进先出”原则。即按照投资人申（认）购的先后次序进行顺序赎回。
- 4、“全额缴款”原则。投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；
- 5、当日的申购与赎回申请可以在当日的交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施3个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （四）场外申购与赎回的程序

- 1、申购和赎回的申请方式：书面申请或销售机构公布的其他方式。
- 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资人可向销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回申请的确认情况。

- 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人，该退回款项产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后，基金管理人在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。

在发生巨额赎回的情形时，赎回的处理办法请参见本基金招募说明书的有关条款处理。

## （五）场外申购和赎回基金份额的注册登记

投资人申购申请受理后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理增加权益的登记手续，投资人自 T+2 日起可赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## （六）场外申购与赎回的限定

### 1、申购金额的限制

场外申购时，代销网点每个账户单笔申购的最低金额为 1000 元人民币。

直销网点每个账户首次申购的最低金额为 1 万元人民币，追加申购单笔最低金额为 1 万元人民币；已在直销网点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。

### 2、赎回份额的限制

场外赎回时，赎回的最低份额为 5 份基金份额；基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 5 份时，剩余基金份额将与该次赎回份额一起全部赎回。

3、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，对上述限制性规定进行调整。基金管理人必须在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告并报中国证监会备案。

## （七）场外申购费用和赎回费用

### 1、申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担，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。

本基金申购费率如下：

单笔金额（M）	收费标准
M < 50 万元	1.50%
50 万元 ≤ M < 100 万元	1.00%

100万 ≤ M < 1000万元	0.50%
M ≥ 1000万元	单笔 1000元

## 2、赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的 25% 归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

本基金赎回费率如下：

持有基金份额期限（N）	收费标准
N < 1年	0.50%
1年 ≤ N < 2年	0.25%
N ≥ 2年	0

3、基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式，最新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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## （八）场外申购份额与赎回金额的处理方式及计算

### 1、申购份额与赎回金额的处理方式：

（1）申购份额、余额的处理方式：场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以有效申请当日基金份额净值为基准计算，四舍五入保留到小数点后两位，由于四舍五入导致的误差归入基金财产；

（2）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有效申请当日基金份额净值并扣除相应的费用，四舍五入保留到小数点后两位，由于四舍五入导致的误差归入基金财产。

### 2、本基金申购份额的计算：

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。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)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

例：某投资人投资 4 万元申购本基金，申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，如果其选择前端收费方式，则其可得到的申购份额为：

申购金额=40000 元

净申购金额=40000/(1+1.5%)=39408.87 元

申购费用=40000-39408.87=591.13 元

申购份额=(40000-591.13)/1.0400=37893.14 份

即：某投资人投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，则可得到 37893.14 份基金份额。

### 3、本基金赎回支付金额的计算：

本基金以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=T 日申请份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某投资人赎回 1 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10000×1.0160=10160

赎回费用 = 10160×0.5% = 50.8 元

赎回金额 = 10160-50.8 = 10109.2 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 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10109.2 元。

### 4、基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值=计算日基金资产净值总额/计算日发行在外的基金份额总数。

本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。

T 日的基金份额净值在当日收市后计算并在次日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （九）暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，本基金管理人可暂停接受基金投资人的申购申请：

- 1、不可抗力的原因导致本基金无法正常工作；
- 2、证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金净值；
- 3、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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- 5、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述 1、2、3、5 项暂停申购情形时，基金管理人应当立即向中国证监会备案，并在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人，基金管理人及基金托管人等不承担该退回款项产生的利息等损失。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并按规定公告及报中国证监会备案。

#### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，本基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请：

- 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- 2、证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- 3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续两个或两个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案，并在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停赎回公告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，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，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付，但最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

## 1、巨额赎回的认定

本基金在单个开放日内，基金净赎回申请份额（该基金赎回申请总份额加上基金转换中转出申请份额总份额后扣除申购申请总份额及基金转换中转入申请份额总份额后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 时，即认为发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回。当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回。当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的份额总量不低于基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请予以延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额，未受理部分可延迟至下一开放日办理。除非投资人在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，投资人当日未能赎回的部分自动转至下一个开放日做赎回处理，投资人无需再次就该部分份额重新提交赎回申请。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）巨额赎回的公告。当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式在三个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定报刊及其他相关媒体予以公告。

## （十二）重新开放申购或赎回的公告

1、如果发生暂停申购或赎回的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

2、如果发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登基金重新

开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过 2 周，在暂停期间，基金管理人应至少每 2 周重复刊登暂停公告 1 次。基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

### （十三）基金的转换

基金转换是指基金份额持有人可按规定申请将所持有的基金份额转换为基金管理人所管理的其他开放式基金份额。基金转换可以收取一定的转换费。具体规定请关注本基金管理人届时公告。

场内暂时未开通基金转换业务，若届时开通的，本基金管理人将及时公告。

### （十四）定期定额投资计划

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

### （十五）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益依照国家有权机关的意见来决定是否采取一并冻结。



## 十、基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。

### （一）投资人范围

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）以及合格的境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （二）使用账户

投资人通过深交所场内申购、赎回基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告）。

### （三）场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

深交所场内申购赎回业务办理单位的名单（有可能进行调整或变更）可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

### （四）申购与赎回的办理时间

1、本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理，具体业务办理时间另行公告。基金管理人应在本基金首次开放申购、赎回业务的3个工作日前，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告本基金开放申购、赎回的信息。

2、申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。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。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

3、若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应影响投资人利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日3个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、本基金自2007年4月23日开始办理场内申购、赎回业务。

#### （五）场内申购和赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购和赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、“金额申购，份额赎回”原则，即基金份额的申购以金额申报，申报单位为一元人民币；赎回以份额申报，申报单位为一份基金份额；
- 3、“全额缴款”原则。投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；
- 4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施3个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### （六）场内申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则所提交的申购申请无效。

投资人在提交赎回申请时，应确保账户内有足够基金份额余额，否则赎回申请无效。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T日提交的有效申请，投资人可在T+2日到场内申购、赎回业务办理单位或

以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项本金将退回投资人账户，由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。

在发生巨额赎回的情况下，对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销。关于“巨额赎回的认定”和“巨额赎回的公告”参照第九章相关内容规定。

#### （七）场内申购和赎回的数额限制

- 1、单笔场内申购的最低金额为 1,000 元。
- 2、基金管理人、深交所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。如调整上述限制的，基金管理人必须在调整 3 个工作日前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。
- 3、申购份额、余额的处理方式：本基金的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。基金份额份数保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资人。
- 4、赎回金额的处理方式：本基金的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### （八）申购费用和赎回费用

- 1、本基金的申购费用由基金申购人承担，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。

本基金申购费率如下：

单笔金额（M）	收费标准
M < 50 万元	1.50%

50万元 ≤ M < 100万元	1.00%
100万 ≤ M < 1000万元	0.50%
M ≥ 1000万元	单笔 1000元

2、投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的 25% 归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

场内赎回费率统一为 0.5%。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （九）场内申购份额和赎回金额的计算方式

#### 1、基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购手续费 = 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

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例 1: 某投资人通过场内投资 10,000 元申购本基金，对应的申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 = 10,000 / (1 + 1.5%) = 9,852.22 元

申购手续费 = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 元

申购份额 = 9,852.22 / 1.025 = 9,611.92 份

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 9,611 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

实际净申购金额 = 9,611 × 1.025 = 9,851.28 元

退款金额 = 10,000 - 9,851.28 - 147.78 = 0.94 元

即：投资人投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,611 份，退款 0.94 元。

#### 2、基金赎回金额的计算

赎回总金额 = T 日赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额 = 10,000 × 1.148 = 11,480 元

赎回费用 = 11,480 × 0.5% = 57.40 元

净赎回金额 = 11,480 - 57.40 = 11,422.60 元

即：投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

3、T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在次日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告。

#### 4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值 = 计算日基金资产净值 / 计算日发行在外的基金份额总数

#### （十）场内申购与赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

（十一）办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

（十二）有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第九章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所有关规定，并据此执行。

## 十一、 基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### （一）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。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。

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

### （二）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可在深交所上市交易，也可直接申请场内赎回。登记在证券登记结算系统中的基金份额如需办理场外赎回，应当办理跨系统转登记后方能实施。

3、登记在注册登记系统中的基金份额可直接申请场外赎回。登记在注册登记系统中的基金份额如需办理场内赎回，应当办理跨系统转登记后方能实施。

### （三）系统内转托管

1、系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的

销售机构（网点）时，应依照销售机构（网点）规定办理基金份额系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，应办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### **（四）跨系统转登记**

1、跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

## 十二、 基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过投资于可能从中国经济以及资本市场新趋势获益的公司，在兼顾风险的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。

### （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、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的 A 股等；债券投资范围包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金大类资产的投资比例范围是：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0-35%，现金及剩余期限在 1 年以内的政府债券不少于基金资产净值的 5%。

### （三）投资理念

我们奉行积极的投资，坚持精心选股与严格的风险控制相结合。我们将重点投资于最有可能从中国经济发展新趋势和资本市场成长中受益，具有良好的公司质地和快速增长潜力，且股价相对合理、具备估值优势的上市公司。

### （四）投资策略

本基金的投资风格以积极的股票选择策略为特点，注重挖掘基于未来趋势的企业价值。资产配置和行业配置层面，本基金在正常市场条件下不做主动性资产配置调整，并倾向于持有较多符合经济发展和市场变革新趋势的行业。股票选择层面，本基金通过客观化的定量分析、主观化的定性分析、证券估值等步骤选择



合适的、物有所值的上市公司股票构建最优投资组合。

## 1、资产配置

本基金的资产配置比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0-35%，现金及剩余期限在 1 年以内的政府债券不少于基金资产净值的 5%。

资产配置方案由公司投资决策委员会每月定期或不定期根据研究部对宏观经济走向、信贷和货币的流动性状况、宏观政策动态和制度改革等因素的分析和研究报告，进行制订和调整并由基金经理执行。

## 2、行业配置

本基金资产的行业配置在参照本基金的市场基准富时中国 A600 指数的行业配比基础上，对看好其未来发展趋势的部分行业适当增加投资，对本基金看淡的行业适当减少投资。该“锁定基准，适当灵活”的被动中具有主动性的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势，从而积极把握经济发展过程中的新趋势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的跟踪误差，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。

## 3、股票选择

本基金管理人采取积极的股票选择策略，旨在通过“自下而上”的方式遴选出估值合理的优质公司股票，其主要步骤为：

### （1）客观化的定量分析

客观化的定量分析主要借助分析上市公司财务报表以判断公司的财务状况，包括通过损益表分析上市公司收入和利润情况，通过资产负债表分析财务结构比率，通过现金流量表分析上市公司是否稳步发展，以及通过对特定财务指标的考察和同行业公司之间的比较过滤掉财务状况欠佳的公司，并试图寻找行业龙头企业。因此，在客观化的定量分析阶段，我们的分析提供了下方保护的好处。

### （2）主观化的定性分析

主观化的定性分析将主要从竞争力、管理质量、增长潜力和公司治理四个方面来对上市公司进行综合定性分析，这四个方面并不是完全分开的，而是相互关联的。该阶段主要通过分析公司目前的行业地位和未来的发展机会，来研究公司的业务能力将如何改变以及由于此种改变可能给股东带来的潜在回报。因此，该项分析提供了附加价值，或者说上方增长的好处。

### （3）证券估值和业绩评价

基于主观和客观分析，本基金将采用相对估值法和绝对估值法（行业相关、时间相关）来评价一个股票的内在价值，并给出其在未来 12 个月内的目标价格。

本基金借鉴国际成熟市场投资经验，主要采用 GARP（Growth at Reasonable Price）模型来选取股票，即我们寻找有坚实基础能持续稳定增长，同时又被市场所低估的公司。GARP 策略与价值投资和成长投资的区别在于，价值投资偏重于投资价值低估的公司，而成长投资注重于投资成长性高的公司，而 GARP 则能够弥补纯粹价值投资和成长投资的不足，能尽量兼顾价值和成长。一般来说，采用 GARP 策略能够获取比纯粹价值投资更大的回报，同时能享受到比纯粹成长投资更小的风险。通过估值和风险因素的统筹，确保基金只投资于合适的、物有所值的个股，并通过以上步骤构建最优投资组合。

## 4、债券选择

与本基金的积极股票投资策略相比，本基金的债券投资策略相对保守，基金的债券资产构成以国债（含央行票据）和金融债为主，适当投资于企业债和可转换债券，并主要采取久期控制和个券选择的投资策略来运作债券组合。除现券买卖外，本基金也通过债券回购、逆回购操作，帮助实现基金现金流与基金的申购、赎回活动相匹配。

## 5、权证投资

在任何情况下，本基金不主动买入权证，但可能因所持股票的上市公司个别

行为(如股权分置改革对价或因其他原因向股东配送等)而被动持有权证。本基金将自该权证上市交易首日起,根据市场情况卖出被动持有的各权证。本基金持有权证的比例将始终严格遵守法律法规的相关规定。

## （五）投资决策

本基金的投资决策依据包括国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定;宏观经济发展趋势、微观企业经济运行趋势;证券市场走势,等等。

本基金的投资决策程序可以概括为:

- 1、投资研究部根据研究员提交的上市公司、行业研究报告和投资业绩与风险评价报告研究深入分析宏观经济动态、政府政策、金融市场状况以及行业因素等方面后,定期向投资决策委员会上报资产配置提案;
- 2、投资决策委员会根据议事规则对上述资产配置提案进行讨论和评价后形成资产配置决议;
- 3、投资总监与各基金经理沟通后制订各基金的资产配置方案,并协调和监管各基金的投资决策执行情况;
- 4、基金经理根据投资决策委员会的要求和股票池中个股研究报告制定基金投资组合计划;
- 5、投资决策执行;
- 6、研究部出具基金投资业绩和风险评价周报和月报。

## （六）业绩比较基准

80%×富时中国 A600 指数+20%×富时中国国债指数

## （七）风险收益特征

本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于中高风险、追求长期稳定资本增值的股票型证券投资基金。在严格控制风险的前提下,本基金的投资将以前瞻的眼光把握经济发展与市场变革的中长期趋势,努力挖掘个股与板块、行业的投资机遇。

## （八）投资限制

- 1、组合限制

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

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （3）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （5）进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- （6）正常市场状况下，股票资产占基金资产的比例为 60%~95%；债券资产占基金资产的比例为 0%~35%；现金及剩余期限在 1 年以内的政府债券不少于基金资产净值的 5%；
- （7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （8）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 5%；
- （9）法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述（1）—（6）项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述投资限制或禁止行为的，本基金可不受上述限制。

**（九）基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：**

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司或发债公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。

#### **（十）基金投资组合报告**

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2011 年第 2 季度报告，所载数据截至 2011 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,242,517,677.57	87.64
	其中：股票	1,242,517,677.57	87.64
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	81,000,005.70	5.71
	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	86,321,745.63	6.09
6	其他各项资产	7,961,104.22	0.56
7	合计	1,417,800,533.12	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	54,573,883.75	3.89
C	制造业	573,693,119.90	40.94
C0	食品、饮料	150,870,692.72	10.77
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	22,720,377.00	1.62
C5	电子	19,486,914.60	1.39
C6	金属、非金属	130,173,522.58	9.29
C7	机械、设备、仪表	203,552,342.57	14.52
C8	医药、生物制品	35,257,562.39	2.52
C99	其他制造业	11,631,708.04	0.83
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,280,981.76	2.45
F	交通运输、仓储业	80,631,366.74	5.75
G	信息技术业	4,199,000.00	0.30
H	批发和零售贸易	35,016,991.08	2.50
I	金融、保险业	320,422,153.64	22.86
J	房地产业	96,574,232.70	6.89
K	社会服务业	30,827,148.00	2.20
L	传播与文化产业	4,798,800.00	0.34
M	综合类	7,500,000.00	0.54
	合计	1,242,517,677.57	88.66

### 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	600036	招商银行	6,200,000	80,724,000.00	5.76
2	600519	贵州茅台	272,910	58,028,853.30	4.14

3	601288	农业银行	15,622,933	43,744,212.40	3.12
4	000651	格力电器	1,699,887	39,947,344.50	2.85
5	600031	三一重工	1,999,921	36,078,574.84	2.57
6	002006	精功科技	625,849	35,929,991.09	2.56
7	000568	泸州老窖	750,913	33,881,194.56	2.42
8	000001	深发展 A	1,982,464	33,840,660.48	2.41
9	600000	浦发银行	3,200,000	31,488,000.00	2.25
10	601939	建设银行	6,288,306	31,064,231.64	2.22

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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) 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库之外的股票。

(3) 其他各项资产构成



序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,467,300.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,443,211.35
4	应收利息	47,813.75
5	应收申购款	2,778.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,961,104.22

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### 十三、 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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日2007年1月29日，基金业绩截止日2011年6月30日。

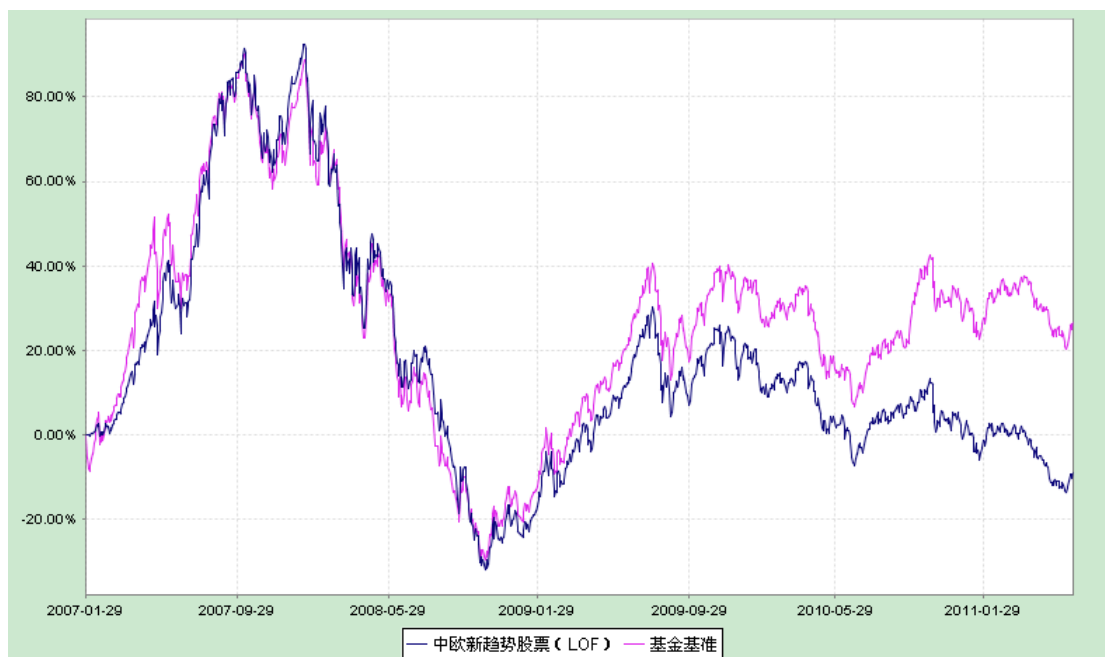
#### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	①净值增长率	②净值增长率 标准差	③业绩 比较基 准收益 率	④业绩 比较基 准收益 率标准 差	①-③	②-④
2007.01.29—2007.12.31	83.22%	1.69%	77.57%	1.82%	5.65%	-0.13%
2008.01.01—2008.12.31	-58.61%	2.47%	-55.32%	2.42%	-3.29%	0.05%
2009.01.01—2009.12.31	60.40%	1.69%	72.91%	1.63%	-12.51%	0.06%
2010.01.01—2010.12.31	-16.27%	1.28%	-4.90%	1.24%	-11.37%	0.04%
2011.01.01-2011.06.30	-10.53%	1.07%	-3.04%	1.00%	-7.49%	0.07%
2007.01.29-2011.06.30	-8.88%	1.79%	26.51%	1.77%	-35.39%	0.02%

数据来源：中欧基金 富时中国

#### 2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



数据来源：中欧基金 富时中国

注：本基金成立于 2007 年 1 月 29 日，按照本基金基金合同规定，本基金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，目前本基金的投资组合比例已符合法律规定和基金合同约定。

## 十四、 基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人以基金托管人的名义开立基金托管专户与证券交易清算资金结算备付金账户，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）基金财产的保管与处分

- 1、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。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。
- 4、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。
- 5、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、 基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日。

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

（2）未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易场所上市的同一种股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易场所挂牌的同一种股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的股票按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值进行估值；

（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、债券估值办法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，但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，调整最近交易市价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值；

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

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

（4）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；

（5）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（4）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）—（4）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。

（6）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值办法：

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

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

(3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

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

(5) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(4)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)－(4)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；

(6) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 4、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

基金管理人和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，应及时改正，并报告中国证监会。对基金或基金份额持有人造成损害的，按各自应承担的

责任对基金或基金份额持有人进行赔偿。

### （三）估值对象

基金所持有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产。

### （四）估值程序

- 1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，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。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、基金日常估值由基金管理人进行。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。

### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

本合同的当事人应将按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“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投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

#### 2、差错处理原则



（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；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责任大小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（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构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）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，则基金托管人有权向出现差错的当事人进行追索，并

有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（8）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、净值差错处理的原则和方法如下：

（1）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；

（2）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；

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

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

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### （六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- 4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （七）基金净值的确认

基金管理人应每日对基金资产估值。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以加密传真等方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后以双方确认的方式传送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### （八）特殊情况的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第4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。
- 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，本基金管理人和本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，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本基金管理人和基金托托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

注：基金管理人于2008年9月16日发布公告称，根据中国证监会《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15号）及《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21号）的相关规定，自公告之日起，对本基金当前持有的停牌股票的估值方法进行调整，由原来的按照“最近交易日收盘价”估值调整为按照“指数收益法”估值，即根据公开发布的相关行业指数收益情况确定该停牌股票的公允价值。

## 十六、 基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，全年分配比例不低于年度可供分配收益的50%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
- 4、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 6、每一基金份额享有同等分配权；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配的时间和程序

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

## 十七、 基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金上市费；
- （4）银行汇划费用；
- （5）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- （6）基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- （7）基金份额持有人大会费用；
- （8）基金的证券交易费用；
- （9）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法规和本基金合同、招募说明书等法律文件的规定，按费用的实际支出金额支付，列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

#### 2、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：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.50\%$$

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 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、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：

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

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 2 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) 本条第 1 款中 (3) 到 (9) 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额，从基金财产中列支。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、认购费：

本基金的认购费不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

(1) 本基金的场外认购费率：本基金场外采取金额认购的方式，以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用。认购费由认购申请人承担，投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

单笔金额 (M)	收费标准
M < 50 万元	1.00%
50 万元 ≤ M < 100 万元	0.60%
100 万 ≤ M < 1000 万元	0.30%
M ≥ 1000 万元	单笔 1000 元

### (2) 本基金的场内认购费率

深圳证券交易所会员单位应按照本基金招募说明书约定的场外认购费率设定投资者的场内认购费率。

### 2、申购费：

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要

用于本基金的市场推广、销售、注册登记等发生的各项费用。

本基金采取金额申购的方式，场外、场内的申购费率相同，具体费率如下：

单笔金额（M）	收费标准
M < 50 万元	1.50%
50 万元 ≤ M < 100 万元	1.00%
100 万 ≤ M < 1000 万元	0.50%
M ≥ 1000 万元	单笔 1000 元

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

3、转换费率：本基金仅可办理场外转换业务，场内暂时未开通基金间转换业务。基金的转换费率等在开通转换业务前 3 个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

4、赎回费：本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减，具体费率如下：

持有基金份额期限（N）	收费标准
N < 1 年	0.50%
1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
N ≥ 2 年	0

本基金的场内赎回费率为固定值 0.5%。

赎回费用由赎回申请人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

5、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，在基金合同约定范围内调整上述费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。调整后的上述费率还将在最新的招募说明书中列示。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资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，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上述基金申购费率、基金转换费率和基金赎回费率。

### （三）其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

### （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。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

（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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十八、 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，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人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，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

## 十九、 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，按规定将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资人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。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （一）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人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。

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；基金管理人在公告的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。

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

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

## 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## 3、基金合同生效公告

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

## 4、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## 5、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

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

（2）在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份

额净值和基金份额累计净值；

（3）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。

## 6、基金份额申购、赎回价格公告

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

## 7、基金定期公告，包括基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

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

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

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

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。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和本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。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

## 8、临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地

中国证监会派出机构备案：

- （1）基金份额持有人大会的召开；
- （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）变更基金份额发售机构；

- （20）基金更换注册登记机构；
- （21）本基金开始办理申购、赎回；
- （22）本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- （23）本基金发生巨额赎回并延期支付；
- （24）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- （25）本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- （26）中国证监会规定的其他事项。

## 9、澄清公告

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

## 10、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。

## 11、中国证监会规定的其他信息

### （二）信息披露事务管理

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对上述公开披露的相关基金信息中应由基金托管人复核的事项进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

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

### （三）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、上市交易公告书、

年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，以及本基金上市交易的证券交易所，供公众查阅，投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

本基金的信息披露事项将在至少一种指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。



## 二十、 风险揭示

### （一）市场风险与对策

由于经济和政治环境、产业和行业状况、上市公司基本面等方面的变化，可能导致基金投资组合中的证券市值发生不可预见的变动，进而影响基金份额净值。

为控制此类风险，本基金管理人将努力加强对宏观经济与国家政策的分析，研究并预测经济周期、利率走势和行业发展趋势，以此作为资产配置和证券选择的依据；同时，通过可投资股票备选库制度，加强对上市公司和所在行业的研究，采用定量分析、定性分析和实地调研等多种方法判断上市公司的经营风险，选择具有长期投资价值的上市公司；本基金管理人的风险控制系统实施对从个股/个券到全部组合等风险源的全面风险管理，从而得以实时监控组合风险敞口，及时识别风险源并调整投资组合；本基金将通过构建多样化组合并限制单只证券过高持仓以避免个股/个券过度风险；岗位风险管理职能方面：本基金管理人的业绩和风险评价小组自行开发风险管理系统并将定期出具业绩和风险评价报告，重点股票的波动性、贝塔系数、风险价值、跟踪误差和债券的剩余期限、久期、凸性等指标；基金经理和投资总监将负责实时监控组合风险头寸并决定是否调整投资组合；风险控制委员会负责每月审阅业绩和风险评价报告。

### （二）流动性风险与对策

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，进而影响基金份额净值。

为控制此类风险，本基金管理人的投资组合管理和交易系统设置了预警和自动控制功能，以便对基金交易中可能存在的流动性风险发出警报；基金运营部将与代销机构、托管行保持高效沟通以及及时预测资金流动；基金经理将每日依据基

金运营部提供的信息监控基金的净现金头寸和资金流入/流出情况；业绩和风险评估小组定期计算流动性及可能存在的风险，并出具报告提交基金经理、投资总监和风险控制委员会。

### （三）管理风险与对策

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验及判断等主观因素会影响其对相关信息、经济形势及证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素可能会影响本基金的收益水平。

为控制此类风险，本基金管理人将充分发挥中外合资基金管理公司在国际化和本土化方面的双重优势，吸取国内外同行业在投资管理方面的经验教训，引进外资股东的先进管理经验和管理技术，建立优秀的管理团队和专业团队；同时，本基金管理人实施积极的人才战略，通过外部引进、内部培训、科学考核、有效激励等多种方式不断提高团队的经营管理水平和投资研究能力，并根据实际情况引进新的管理技术和方法，努力为基金份额持有人带来更好的投资回报；投资总监、投资决策委员会对基金经理助理、基金经理和投资总监等各级岗位的基金投资分别实施不同的投资交易限制以及重要交易的逐级授权制度，从而确保实现对于管理风险的有效监督和管理。

### （四）信用风险与对策

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，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

为控制此类风险，本基金管理人将只选择资信状况良好的机构作为本基金的交易对手，只投资于具备较高信用评级的债券并尽可能通过多样化持债回避企业债信用风险。

### （五）本基金特有的风险与对策

本基金作为股票型基金，其特有风险将主要来源于行业配置和股票选择的具体实施过程：

#### 1、行业配置风险

本基金资产的行业配置在参照业绩比较基准的行业配比基础上，对看好其未来发展趋势的行业适当增加投资，对看淡其未来发展趋势的部分行业适当减少投

资。由于中国产业结构升级的中长期趋势不会一蹴而就可以完成，从而可能导致基金管理人对于产业结构升级趋势的判断出现偏差，造成本基金与业绩比较基准收益水平的一定偏离。

为控制此类风险，本基金管理人将充分发挥专业优势和团队优势，积极审慎地把握经济发展过程中的新趋势。

## 2、股票选择风险

本基金的股票选择旨在构建最优投资组合，其特点在于注重对上市公司的质地和价值的衡量，而不仅仅是其在指数中所占权重使得本基金的个股投资比例与业绩比较基准中个股权重的不尽一致，从而造成本基金与业绩比较基准收益水平的一定偏离。

为控制此类风险，本基金管理人将严格遵循以基本面研究为基石的自下而上选股策略，综合运用定量分析和定性分析手段，严格遵守基于“目标价位”的买卖纪律，使得本基金投资于估值合理的个股，从而具有提供“下方保护”和“上方增长”的优势。通过业绩和风险分析，本基金管理人将重点关注下行风险和风险价值，以评价个股或行业在投资组合风险中所占份额，从而避免无谓的风险集中，实现股票选择过程中的有效均衡风险分散。

## （六）其它风险

### 1、操作风险与对策

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、交易错误等风险。

为控制此类风险，本基金管理人将在充分考虑内外部环境的基础上，建立科学、严密、高效的内部控制体系；投资组合管理和交易系统中设置了交易前的自动限制和控制功能，以防止主观和客观的错误交易和违规交易。中央交易室每日提交交易报告以便投资总监和风险控制委员会及时发现操作中存在的问题并予以修正。同时，本基金管理人注重提高员工专业水平，并加强员工职业道德教育，以促进合规文化的形成。

### 2、技术风险与对策

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人的利益受到影响。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。

这类风险的控制和防范主要依赖于系统的可靠性以及完备的备份策略。

### 3、上市交易风险

本基金在基金合同生效且符合上市交易条件后，在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

4、其它风险与对策战争、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、行业竞争及代理商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。

为控制这类风险，本基金管理人建立了突发紧急事件处理制度以及完备的灾难恢复计划，以防范和控制不可抗力因素造成的风险。

## 二十一、基金的终止与清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、基金合并、撤销；
- 5、法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

### （二）基金财产的清算

- 1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
- 2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。
- 3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
- 4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
- 5、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 基金清算组作出清算报告；
- (5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金清算报告报中国证监会备案；
- (8) 公布基金清算报告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

#### 6、清算费用

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

#### 7、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 8、基金财产清算的公告

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书，由基金财产清算小组报中国证监会备案后2日内公告。

#### 9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十二、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、基金管理人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自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并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金认购费、申购费、基金赎回手续费和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- （4）销售基金份额；
- （5）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；
- （6）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- （7）依据本基金合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
- （8）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，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （11）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （12）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；

（13）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；

（14）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；

（15）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（16）依法召集基金份额持有人大会；

（17）法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制中期和年度基金报告；



- （13）严格按照《基金法》、《信息披露办法》、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相关资料；
- （23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- （24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- （26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- （27）法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不

限于：

- （1）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- （2）监督基金管理人对本基金的投资运作；
- （3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；
- （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法律法规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、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- （6）依法提议或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。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- （1）安全保管基金财产；
- （2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- （3）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、报表和其他相关资料；
- （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）建立并保存基金管理人提供的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）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（21）法律法规、《基金合同》及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

## （二）基金份额持有人大会

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

2、召开基金份额持有人大会的事由：

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

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (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和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。

3、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、其他应由基金承担的费用；

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

（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（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。

4、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。

（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。

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，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

（4）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。

（5）基金份额持有人大会的召集人负责确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## 5、通知

（1）召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 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。

## 6、开会方式

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，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；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的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

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

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，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%，下同）

（2）在符合以下条件时，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，在两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不少于权益登记日基金总份额的 50%；

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符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与份额登记机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本基金合同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) 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。

5) 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，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，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

## （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，再确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

大会由大会召集人的授权代表主持。如召集人为基金份额持有人，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额、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 天公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机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。

## 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

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（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

#### 2) 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，除上述(1)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；

(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) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 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

## 9、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。

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代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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。

如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序；如基金托管人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配

合，则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序；如基金管理人或基金托管人经通知但拒不派代表监督，则大会召集人可自行授权3名监督员进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证，表决效力不受影响。

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，否则表明符合法律法规、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。

## 10、大会决议生效与公告

（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五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

（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备案后3日内，由基金份额持有人大会召集人在中国证监会指定的信息披露媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

（4）相关法律法规或中国证监会取消上述相关限制或变更上述相关规定的，按照变更后的规定执行。

### （三）基金合同解除和终止的事由、程序

#### 1、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- （3）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

- (4) 基金合并、撤销；
- (5) 法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

## 2、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。

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

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

(5) 基金财产清算程序：

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 基金清算组作出清算报告；
- 5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 7) 将基金清算报告报中国证监会备案；
- 8) 公布基金清算报告；
- 9) 对基金剩余财产进行分配。

#### （6）清算费用

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

#### （7）基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### （8）基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书，由基金财产清算小组报中国证监会备案后 2 日内公告。

#### （9）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上海分会，根据该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，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

### （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并对外散发或供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十三、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

名称：中欧基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

邮政编码：200120

法定代表人：唐步

成立日期：2006年7月19日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]102号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.2亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、包括依中国法律从事证券投资基金的设立和管理、基金管理和与此相关的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

#### 2、基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

注册日期：1988年7月20日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号

组织形式：股份有限公司

注册资本：59.92亿元人民币

营业期限：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；

办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付；承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；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；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

基金托管人对基金管理人的业务监督、核查：

### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为的监督

#### （1）基金托管人对基金投资范围、投资对象进行监督的内容、标准和程序

##### 1) 监督的内容

根据法律法规的规定和基金合同的约定，本基金为股票型基金，基金托管人应对基金管理人就基金的投资范围、投资对象的合法性、合规性进行监督和核查。

##### 2) 监督的标准

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、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的 A 股等；债券投资范围包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金大类资产的投资比例范围是：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0-35%，现金及剩余期限在 1 年以内的政府债券不少于基金资产净值的 5%。

##### 3) 监督的程序

基金托管人根据 2) 所述的监督标准对基金管理人的投资对象和投资范围进行监督，如发现基金管理人的投资范围及投资对象不符合监督标准的，基金托管人应向基金管理人出具提示函，基金管理人应给予合理解释。对于明显违规的投资，基金托管人可以拒绝执行相关结算事宜，

由基金管理人取消相关投资交易，但基金托管人应以书面方式说明拒绝结算的理由。对于无法取消的投资交易，由基金管理人以书面形式说明理由，基金托管人执行后可以向中国证监会报告。

基金托管人应根据2)所述的监督标准建立相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

## (2) 基金托管人对基金投融资比例进行监督的内容、标准和程序

### 1) 监督的内容

基金托管人对基金投融资比例进行监督的内容包括但不限于：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规规定及基金合同约定的时间要求、法规允许的基金投资比例调整期限等。

### 2) 监督的标准

本基金投资组合资产配置比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，债券资产占基金资产的0-35%，现金及剩余期限在1年以内的政府债券不少于基金资产净值的5%。

本基金投资组合并遵循如下投资限制：

- 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本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
- ③本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- ④本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
- ⑤进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
- ⑥本基金股票、债券的投资比例应符合下述要求：股票资产占基金资产的60%~95%；债券资产占基金资产的0~35%；现金及剩余期限在1年以内的政府债券不少于基金资产净值的5%；



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

⑧本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的5%；

⑨法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。

因证券市场变化、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第①—⑥项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。

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) 监督的程序

基金托管人对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、基金投资比例等按照2)所述监督标准进行监督。如发现基金的投融资比例不符合有关规定，基金托管人应向基金管理人出具提示函，基金管理人应给予合理解释，并应在规定期限内进行调整，基金托管人对管理人的调整情况进行核查。对于未按规定进行调整的，基金托管人有权向中国证监会报告。

基金管理人明知超过前述标准且继续进行相关投融资交易的，托管人有权拒绝执行相关结算事宜，由基金管理人取消相关投资交易，但基金托管人应以书面方式说明拒绝结算的理由。对于无法取消的投融资交易，由基金管理人以书面形式说明理由，基金托管人执行后可以向中国证监会报告。

### (3) 基金托管人对基金投资禁止行为进行监督的内容、标准和程序

#### 1) 监督的内容

基金财产是否被用于《基金法》禁止的投资或活动。

#### 2) 监督的标准

本基金禁止以下投资行为：

- ①承销证券；
- ②将基金财产向他人贷款或提供担保；
- ③从事承担无限责任的投资；
- ④买卖其他基金份额，但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法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，则本基金不受上述限制。

### 3) 监督的程序

基金托管人对基金财产是否被用于《基金法》禁止的投资或活动按前述监督标准进行监督。基金托管人发现基金财产被用于《基金法》禁止的投资或活动的，应拒绝办理清算、交割事宜，由基金管理人取消相关投资交易，但基金托管人应以书面方式说明拒绝办理清算、交割的理由。对于无法取消的投资交易，由基金管理人以书面形式说明理由，基金托管人办理清算、交割后可以向中国证监会报告。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新。

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

### (4) 基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场进行监督的内容、标准

## 和程序

### 1) 监督的内容

为控制基金参与银行间债券市场的信用风险，由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。

### 2) 监督的标准

#### ①交易对手的资信控制

基金管理人应采取措施或建立相应制度确定交易对手的资信状况，并定期或不定期地向基金托管人提供可信的交易对手名单。基金托管人有确凿证据表明管理人提供的可信交易对手名单中有不可信对手的，可以向基金管理人建议从可信对手名单中剔除。如基金管理人根据市场情况需要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至少1个工作日与基金托管人协商解决，并向基金托管人提供更新后的交易对手名单。

#### ②交易方式的控制

基金管理人对于银行间买入交易应尽量采取见券付款方式，对于银行间卖出交易应尽量采取见款付券方式。

#### ③监督的程序

基金托管人根据基金管理人提供的可信交易对手名单和银行间成交通知单按规定进行相关结算。如发现基金管理人的交易对手超出可信交易对手名单的，基金托管人可以拒绝执行，并告知基金管理人。

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

## 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、基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反有关法律法规、基金合同、托管协议及其他有关规定时的处理方式和程序

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在违反法律法规、基金合同、本托管协议的行为，应当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、确认并以书面形式向基金托管人发出回函。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，并予协助配合。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，严重损害基金份额持有人利益的，应立即报告中国证监会，同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依照托管协议对基金业务进行监督和核查，包括但不限于在规定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法律法规要求需向中国证监会报送基金监控报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议的规定行使核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效核查，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。

上述约定内容，如因相关法律法规、规章另有明确规定使得此部分内容不符或冲突的，基金管理人与基金托管人应当对此进行修改并遵照执行。

基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查：

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限

于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予以协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### （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。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他财产及其他基金的财产实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- （5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有

到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

## 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在中国证券登记结算有限责任公司开立的基金募集专户。募集期间募集的资金在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人开立的基金托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。基金管理人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，并予以公告。

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

## 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人应负责本基金银行存款账户的开设和管理，基金管理人应配合基金托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

基金托管人以基金托管人的名义在基金托管人处开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该基金托管专户是指基金托管人在集中清算模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。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，均需通过基金托管专户进行。

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

基金托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办

法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### 4、基金证券账户与资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

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

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

基金托管人以基金托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立资金交收账户（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。

#### 5、债券托管账户的开立和管理

（1）基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券和资金的结算，基金管理人应当予以配合并提供相关资料。

（2）基金管理人和基金托管人应共同代表基金签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 6、其他账户的开设和管理

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

#### 7、基金财产投资的有关实物证券等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。

实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

## 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时，应保证代表基金的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；如代表基金的一方只有一份正本，基金管理人和基金托管人将协商决定由一方保留正本，并为另一方提供加盖本方公章的复印件。基金管理人在合同签署后5个工作日内应派专人将一份合同正本送达基金托管人处，或由正本保留方将上述所提复印件送交对方处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

### （四）基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值的计算

##### （1）基金资产净值的计算、复核的时间和程序

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

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》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工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人将基金净值予以公布。

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

#### 2、基金财务报表与定期报告的编制和复核



### （1）财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人和基金托管人按规定分别独立编制。

### （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。核对无误后，在核对过的基金财务报表上加盖基金托管人和基金管理人业务公章，各留存一份。

### （3）财务报表与报告的编制与复核时间安排

1) 月度报表的编制与复核，应于每月结束后 5 个工作日内完成。基金管理人应在每月结束之日起 3 个工作日内完成月度报表编制，加盖业务公章后，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在收到之日起 2 个工作日内完成复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。

2) 基金季度报告在每个季度结束之日起 15 个工作日内公告。基金管理人应在每季度结束之日起 10 个工作日内完成季度报表编制，加盖公章后，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在 5 个工作日内完成复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。

3) 《基金合同》生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起 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《基金合同》生效后，每六个月结束之日起 20 日内完成招募说明书（更新）的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 10 日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。

4) 半年度报告在基金会计年度前六个月结束后 60 日内公告。基金管理人应在上半年结束之日起 30 日内完成半年度报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 20 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

5) 年度报告在基金会计年度结束后 90 日内公告。基金管理人在每年结束之日起 50 日内完成年度报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理

人。

6) 基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。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、文件达成一致，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。

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

8) 基金定期报告应当在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### **（五）基金份额持有人名册的登记与保管**

本基金份额的登记由本基金注册登记机构负责。本基金注册登记机构由基金管理人委托的中国证券登记结算有限责任公司担任。

基金份额持有人名册内容包括基金份额持有人的名称、持有的基金份额以及基金管理人、基金托管人为履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的所需内容。

基金份额持有人名册由基金注册登记机构负责编制，并由基金注册登记机构和基金管理人、基金托管人共同保管。基金份额持有人名册保管期限不得低于15年。

基金管理人应当及时向基金托管人提供基金合同生效日的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册以及经双方共同约定不定期提供的基金持有人名册。基金管理人应当自上述日期之日起五个交易日内，以书面（包括但不限于电子传输数据文件、电子光盘文件、纸质文件）形式将上述日期的基金份额持有人名册送达基金托管人保存。为基金托管人履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的，基金管理人应当提供任何必要的协助。

基金注册登记机构、基金管理人、基金托管人应当根据有关法律法规的规定妥善保管基金份额持有人名册，对基金份额持有人名册的相关信息负有保密义

务，因自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册而对投资人或基金带来损失的，应当各自承担相应的赔偿责任。

#### （六）争议解决方式

各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应由各方通过协商予以解决。协商自一方向其他各方发出书面协商通知之日开始。如果协商开始后30日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权就该争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力。

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

本协议受中国法律管辖。

#### （七）托管协议的修改与终止。

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产、被依法取消基金托管资格或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、被依法取消基金管理资格或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十四、对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺为基金份额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份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，基金份额持有人可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；在每季度结束后的 10 个工作日内，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，向有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送季度对账单；在每年度结束后 15 个工作日内，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，对所有的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送年度对账单。

### （二）红利再投资

本基金收益分配时，场外基金份额持有人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，红利再投资免收申购费用；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

场内认购、申购的基金份额的分红方式为现金红利，基金份额持有人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

### （三）基金间转换

本基金存续期间，基金管理人接受本基金份额持有人的申请，将其持有的基金份额转换为本基金管理人管理的另一基金的基金份额的行为。具体情况以届时发布的公告为准。

### （四）定期投资计划

基金管理人可通过销售人为基金份额持有人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金份额持有人可以定时定额申购基金份额。具体情况以届时发布的公告为准。

### （五）在线服务

基金份额持有人可以通过本基金公司的网站 [www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com) 订制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

### （六）查询与咨询服务

中欧基金公司客服中心为基金份额持有人提供 7×24 小时的电话语音服务，基金份额持有人可通过客服电话 021-68609700 或 400-700-9700（免长途话费）的语音系统或登录公司网站 [www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com) 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工坐席在工作时间（周一—周五 9：00—17：00）还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

### （七）投诉受理

基金份额持有人可以拨打客服中心电话 021-68609700 或 400-700-9700（免长途话费）投诉直销机构和代销机构的人员及其服务。

## 二十五、其他应披露事项

以下为本基金管理人自2011年1月29日至2011年7月28日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号	事项名称	披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于新增英大证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	2011.2.23
2	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在英大证券有限责任公司开通基金转换业务的公告	2011.2.23
3	中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2011年第1号）	2011.3.14
4	中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2011年第1号）	2011.3.14
5	中欧基金管理有限公司关于新增中信证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	2011.3.15
6	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	2011.3.15
7	中欧基金管理有限公司关于注册登记（分TA）系统升级的通知	2011.3.18
8	中欧基金管理有限公司关于变更中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）业绩比较基准名称的公告	2011.3.26
9	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2010年年度报告	2011.3.30
10	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2010年年度报告摘要	2011.3.30
11	中欧基金管理有限公司关于新增爱建证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	2011.4.15
12	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	2011.4.15
13	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券有限责任公司开通基金转换业务的公告	2011.4.15
14	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2011年第1季度报告	2011.4.20
15	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	2011.4.29
16	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的基金网上申购费率优惠活动延期的公告	2011.6.30
17	中欧基金管理有限公司旗下基金2011年6月30日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2011.7.1
18	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行开展的基金网上申购费率优惠活动延期的公告	2011.7.1
19	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2011年第2季度报告	2011.7.21

## 二十六、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金销售机构等办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，但应以正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十七、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、中国证监会批准中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）募集的文件
- 2、《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）注册与登记过户委托代理协议》
- 4、《中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、中国证监会规定的其他文件

### （二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中欧基金管理有限公司

2011年9月10日