

---

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金  
更新招募说明书  
(2012 年第 1 号)

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

---

## 重要提示

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会证监许可[2010]1355号文核准募集，本基金的基金合同于2010年11月23日生效。

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

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，某一基金的特定风险等。富兰克林国海中小盘股票型基金为股票型基金，属证券投资基金中的较高风险收益品种。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2012年5月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日（财务数据未经审计）。

---

## 目 录

|        |                      |     |
|--------|----------------------|-----|
| 第一部分   | 绪言 .....             | 4   |
| 第二部分   | 释义 .....             | 5   |
| 第三部分   | 基金管理人 .....          | 10  |
| 第四部分   | 基金托管人 .....          | 20  |
| 第五部分   | 相关服务机构 .....         | 25  |
| 第六部分   | 基金的募集 .....          | 40  |
| 第七部分   | 基金合同的生效 .....        | 41  |
| 第八部分   | 基金份额的申购与赎回 .....     | 42  |
| 第九部分   | 基金份额的登记 .....        | 52  |
| 第十部分   | 基金的投资 .....          | 54  |
| 第十一部分  | 基金的业绩 .....          | 66  |
| 第十二部分  | 基金的财产 .....          | 67  |
| 第十三部分  | 基金资产估值 .....         | 68  |
| 第十四部分  | 基金的收益与分配 .....       | 72  |
| 第十五部分  | 基金费用与税收 .....        | 74  |
| 第十六部分  | 基金的会计与审计 .....       | 76  |
| 第十七部分  | 基金的信息披露 .....        | 77  |
| 第十八部分  | 风险揭示 .....           | 81  |
| 第十九部分  | 基金合同的终止与基金财产清算 ..... | 85  |
| 第二十部分  | 基金合同摘要 .....         | 87  |
| 第二十一部分 | 托管协议摘要 .....         | 109 |
| 第二十二部分 | 对基金份额持有人的服务 .....    | 118 |
| 第二十三部分 | 其它应披露事项 .....        | 121 |
| 第二十四部分 | 招募说明书的存放及查阅方式 .....  | 123 |
| 第二十五部分 | 备查文件 .....           | 124 |

---

## 第一部分 绪言

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

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

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

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

---

## 第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：指富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金；
- 基金合同：指《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
- 招募说明书：指《富兰克林国海中小盘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《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金发售公告》
- 托管协议：指《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
- 业务管理规则：指《国海富兰克林基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》；
- 中国：就本合同而言，指中华人民共和国，但不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区；
- 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 2011 年 6 月 9 日中国证监会颁布并于 2011 年 10 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

---

|            |  |
|------------|--|
|            | 做出的修订；   |
| 元：         | 指人民币元；   |
| 基金合同当事人：   | 指受本基金合同约定，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；   |
| 基金管理人：     | 指国海富兰克林基金管理有限公司；   |
| 基金托管人：     | 指中国银行股份有限公司；   |
| 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<br>包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；                         |
| 注册登记机构：    | 指根据《国海富兰克林基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》办理本基金注册登记的机构。本基金的注册登记机构为国海富兰克林基金管理有限公司或接受国海富兰克林基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记的机构； |
| 投资者：       | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者；  |
| 个人投资者：     | 指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于开放式证券投资基金的自然人；  |
| 机构投资者：     | 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开放式证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；                                    |
| 合格境外机构投资者： | 指根据相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场并取得国家外汇管理局外汇额度批准的中国境外的机构投资者；   |
| 基金份额持有人    | 指依招募说明书和基金合同合法取得本基金基金份额  |

---

|          |  |
|----------|--|
|          | 额的投资者；   |
| 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： | 指基金募集期满，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日； |
| 存续期：     | 指本基金合同生效之日起至其终止之间的不定期期限；   |
| 工作日：     | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；  |
| 认购：      | 指在基金募集期内，投资者按照基金合同和招募说明书和注册登记机构的相关业务规则的规定申请购买本基金基金份额的行为；                                   |
| 申购：      | 指在基金合同生效后的存续期间，投资者按照和招募说明书和注册登记机构的相关业务规则申请购买本基金基金份额的行为；                                    |
| 赎回：      | 指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同和招募说明书和注册登记机构的相关业务规则规定的条件要求基金管理人购回其持有的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基金账户内的某一基金的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的行为；   |

---

|          |   |
|----------|---|
| 定期定额投资计划 | 指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式 |
| 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（以下简称“指定报刊”）和互联网网站或其他媒体；                                    |
| 基金账户：    | 指注册登记机构为投资者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：    | 指销售机构为投资者开立的记录投资者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基金份额的变动及结余情况的账户；                |
| 开放日：     | 指销售机构为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；  |
| T 日：     | 指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；  |
| T+n 日：   | 指 T 日后（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： | 指本基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他投资形成的价值总和；   |
| 基金资产净值： | 指基金资产总值减去基金负债后的价值；   |
| 基金份额净值  | 指基金资产净值除以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：   | 指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，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、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。 |

---

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市琅东滨湖路 46 号

办公地址：上海浦东世纪大道8号上海国金中心二期9层

法定代表人：吴显玲

成立日期：2004 年 11 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]145 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.2 亿元人民币

存续期限：50 年

联系人：沈增

联系电话：021-3855 5630

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

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员：

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

副董事长 William Y. Yun 先生，工商管理学硕士，历任 Fiduciary Trust Company International 总裁、Franklin Templeton Institutional, LLC 总裁，现任富兰克林邓普顿投资集团执行副总裁。

董事张雅锋女士，研究生学历。历任广西壮族自治区商业厅副处长、处长，广西凭祥市委副书记、广西商业大厦副总经理、广西南方商业集团公司董事长兼总经理、党总支书记，广西壮族自治区证劵办发行部主任、中国证监会

---

南宁特派办副主任、广西证券有限责任公司增资扩股筹备组组长、国海证券有限责任公司董事长、党委书记，国海富兰克林基金管理有限公司董事长、董事。现任广西投资集团有限公司副总经理、国海良时期货有限公司董事、国海证券股份有限公司董事长、党委书记，国海创新资本投资管理有限公司董事。

董事梁国坚先生，大学本科学历。历任广西梧州市人民医院医师、广西梧州整形美容美容院院长、广西梧州远东美容保健用品有限公司董事长兼总经理，广西索芙特科技股份有限公司董事长、广西梧州索芙特美容保健品有限公司董事长兼总经理。现任索芙特股份有限公司董事长。

董事温昌伟先生，中共党员，大学本科学历，高级经济师。历任广西梧州大酒店总经理，梧州地区电业公司总经理，广西贺州投资集团有限公司董事长，广西桂东电力股份有限公司董事长兼总裁。现任中共广西贺州投资集团有限公司委员会委员、书记。

董事 Gregory E. McGowan 先生，博士学历。现任邓普顿国际股份有限公司执行副总裁，国海富兰克林基金管理有限公司股东代表等职务。

董事张伟先生，硕士研究生学历。历任澳纽银行集团（悉尼）企业银行主任、香港上海汇丰银行国际信托有限公司副总裁、银行家信托有限公司（英国）联席董事、德意志信托（香港）有限公司董事、德意志银行（香港）副总裁。现任富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司大中华区总监及董事。

独立董事张忠国先生，中共党员，硕士研究生学历，高级会计师。历任广西柳州地区财政局副局长，广西鹿寨县人民政府副县长，柳州地区行署副秘书长、财办主任，广西财政厅预算处处长，广西财政厅总会计师、副厅长（享受正厅级待遇）。现任广西注册会计师协会会长。

独立董事黄湘平先生，中共党员，硕士研究生学历，兼职教授。历任湖南省人大常委会处长、主任，湖南人大常委法工委副主任，湖南省体改委副主任，湖南省证券委副主任，湖南省证监会主任（党组书记），中国证监会武汉办主任、党委书记，中国证监会湖北局局长、党委书记，中国证券业协会副会长、会长、党委书记。现任中国证券业协会咨询委员会副主任。

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

---

独立董事洪荣光先生，MBA商学硕士。历任台湾亚洲证券股份有限公司董事长及第一大股东（后与元大京华证券股份有限公司合并）、H&Q（Hambrecht & Quist Group）汉茂风险投资公司董事、越南国家投资基金公司董事、邓普顿新兴市场信托股份有限公司董事、邓普顿开发中国投资信托基金（卢森堡）董事、台股指数基金公司（英国）董事、菲律宾信安银行董事、富兰克林邓普顿国际基金董事、益民基金管理有限公司独立董事。现任兴亚置业集团（中国）董事长、亚洲环球证券公司（香港）董事长、菲律宾信安银行独立董事。

## 2、监事会成员

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

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

监事张志强先生，硕士研究生学历，特许金融分析师（CFA）。曾在美国 Enreach Technology Inc.、海通证券股份有限公司、友邦华泰基金管理有限公司工作。2007 年 4 月加入国海富兰克林基金管理有限公司，现任首席数量分析师、业务发展部总经理兼金融工程部总经理。

## 3、经营管理层人员

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

## 4、督察长

---

督察长李彪先生，硕士研究生，副研究员。历任内蒙古大学经济系讲师、中国证监会海南证监局期货机构监管处副处长、证券机构监管处处长、稽查处处长、国海富兰克林基金管理有限公司督察长助理。现任国海富兰克林基金管理有限公司督察长。

#### 5、基金经理

赵晓东先生：8 年证券从业经验，曾任国海富兰克林基金管理有限公司研究员，之前还担任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析员，上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理等。香港大学 MBA，辽宁工程技术大学经济学学士。现任本基金基金经理，并同时担任富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。

#### 历任基金经理

无，该基金自成立以来一直由赵晓东先生任基金经理，没有发生基金经理变更。

#### 6、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：李雄厚先生（公司总经理，兼任投资决策委员会主席）；张晓东先生（首席基金经理）；朱国庆先生（基金经理兼权益类投资团队负责人）；徐荔蓉先生（基金经理兼研究分析部总经理）；刁晖宇先生（固定收益投资主管兼 QDII 投资总监）；张志强先生（首席数量分析师、业务发展部总经理兼金融工程部总经理）；戴刚先生（风险控制部总经理）。

李彪先生（督察长）有权列席投资决策委员会的任何会议。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

- 
- 2、办理基金备案手续；
  - 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
  - 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
  - 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
  - 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
  - 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
  - 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
  - 9、召集基金份额持有人大会；
  - 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
  - 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
  - 12、有关法律法規和中国证监会规定的其他职责。

#### **四、基金管理人的承诺**

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

2、基金管理人不得从事下列行为：

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

3、基金经理承诺

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

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

---

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

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的风险管理和内部控制制度

### 1、风险管理体系

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

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

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

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

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一定的风险指标，测量其数值的大小。

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

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

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

### 2、内部控制制度

---

### （1）内部控制的原则

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

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

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

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

### （2）内部控制的主要内容

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

#### ①业务控制

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

市场开发业务控制主要内容包括：针对市场开发的各项业务建立明确的职责分工，实行岗位分离制度，保证各项业务的有效性和可靠性，同时加强内部牵制，防止错误及舞弊行为发生；制定基金销售的标准化流程，选用先进的电子销售系统，以不断提高基金销售的服务质量和避免差错事故的发生；制定统一的客户资料和销售资料管理制度，妥善保管各类资料；实施对客户的审查制度，对客户情况及资金情况进行严格的审查，事先明确双方的权利与义务，防范新的电子交易方式下的各种风险；本公司制作基金的宣传推介材料应符合《销售管理办法》、《基金宣传推介材料监管事项的补充规定》和《证券投资基金评价业务管理暂行办法》等相关法律法规的要求，公司和基金代销机构的基金宣传推介材料，事先均需经公司的督察长检查，出具合规意见书，公司负责基金营销业务的高级管理人员也应当对基金宣传推介材料的合规性进行复核并出具复核意见，报中国证监会备案；根据《证券投资基金销售适用性指导意见》的要求，公司及基金代销机构在销售基金和相关产品的过程中，将注重根据基金投资人的风险承受能力销售不同风险等级的产品，把合适的产品卖给合适的基金投资人。



---

为此公司已建立基金销售适用性管理制度，对基金产品进行风险评价并定期更新，对基金投资人进行风险承受能力调查，同时做好销售人员的业务培训工作，加强对基金销售行为的管理，加大对基金投资人的风险提示，降低因销售过程中产品错配而导致的基金投资人投诉风险。

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

投资决策业务控制主要内容包括：投资决策严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求；明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策；建立了投资决策审批制度。

基金交易业务控制主要内容包括：基金交易实行集中交易制度，基金经理不直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易；制定了基金投资交易业务的标准化流程并注意流程在各部门之间的衔接和监控，并有书面凭证；建立了完善的交易记录制度，每日投资组合列表等及时核对并存档保管。

### ②资金管理控制

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

### ③会计系统控制

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

基金管理人建立了凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任；基金管理人建立了账

---

务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序；基金管理人建立了复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的发生。

#### ④信息技术系统控制

信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写了完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证了信息技术系统的可稽性；信息技术系统投入运行前，已经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

#### ⑤信息披露控制

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

#### ⑥监察稽核控制

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

#### ⑦人力资源管理控制

人力资源管理控制包括：本基金管理人建立了合理的员工报酬体系，合理确定员工报酬水平。过低的报酬会影响人力资源的质量和运行效益，而过高的报酬会损害基金管理人的利益，所以确定工资制度时坚持了效益优先，兼顾公

---

平的原则；基金管理人建立了管理人员的选聘和培养制度。制定科学的管理人员选聘政策和方法，使优秀人才脱颖而出；制定管理人员培养制度，不断提高其管理水平；制定了员工的业绩评价和激励方案，充分调动了其积极性。

### ⑧内幕交易和关联交易控制

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

实现集中交易制度、防火墙制度、信息控制制度，从制度上防止内幕交易的发生。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

---

## 第四部分 基金托管人

### （一）基本情况

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

托管部门负责人：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 2012 年 3 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、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、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)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等 147 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。



---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市琅东滨湖路 46 号

办公地址：上海浦东世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层

法定代表人：吴显玲

联系人：白雨杉

联系电话：021-3855 5678

传真：021-6887 0708

#### 2、代销机构：

##### (1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

##### (2) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

##### (3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

---

电话：010-66107900  
传真：010-66107914  
客户服务电话：95588  
联系人：查樱  
公司网站：www.icbc.com.cn

(4) 中国建设银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区金融大街 25 号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  
法定代表人：王洪章  
电话：010-66275654  
传真：010-66275654  
联系人：王琳  
客户服务电话：95533  
网址：www.ccb.com

(5) 交通银行股份有限公司  
住所：上海市浦东新区银城中路 188 号  
法定代表人：胡怀邦  
电话：021-58781234  
传真：021-58408483  
联系人：曹榕  
客户服务电话：95559  
网址：www.bankcomm.com

(6) 招商银行股份有限公司  
注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦  
法定代表人：傅育宁  
电话：0755-83198888  
传真：0755-83195109

---

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

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

(7) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

传真：010-65550827

联系人：丰靖

客户服务电话：95558

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

(8) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

电话：010-85238667

传真：010-85238680

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

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

(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

法定代表人：董文标

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

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

---

(10) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：李伟

电话：010-63636155

传真：010- 63636249

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

(11) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：唐苑

客户服务电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(12) 宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

网址：www.nbcb.com.cn

(13) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

---

法定代表人：廖玉林  
电话：0769-22119061  
传真：0769-22117730  
联系人：叶德森  
客户服务电话：0769-96228  
网址：www.dongguanbank.cn

(14) 渤海银行股份有限公司  
注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号  
办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号  
法定代表人：刘宝凤  
联系人：王宏  
传真：022-58316569  
客户服务电话：400-888-8811  
网址：www.cbhb.com.cn

(15) 国海证券股份有限公司  
注册地址：广西桂林市辅星路 13 号  
法定代表人：张雅锋  
电话：0755-83709350  
传真：0755-83700205  
联系人：牛孟宇  
客户服务电话：400-888-8100（全国）、95563（全国）、96100（广西）  
公司网站：www.ghzq.com.cn

(16) 中信建投证券股份有限公司  
注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼  
办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号  
法定代表人：王常青  
客户服务电话：400-8888-108

---

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

(17) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人: 万建华

客户服务电话: 400-8888-666

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

(18) 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: 李笑鸣

客户服务电话: 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

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

(19) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 顾伟国

客户服务电话: 400-888-8888

电话: 010-66568430

联系人: 田薇

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

(20) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 268 号

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

---

法定代表人：兰荣  
客户服务电话：95562  
业务联系电话：021-38565785  
业务联系人：谢高得  
公司网址：www.xyzq.com.cn

(21) 申银万国证券股份有限公司  
注册地址：上海市常熟路 171 号  
法定代表人：丁国荣  
电话：021-54033888  
客户服务电话：021-95523  
联系人：邓寒冰  
网址：www.sywg.com

(22) 招商证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层  
法定代表人：宫少林  
电话：0755-82943666  
传真：0755-82943636  
联系人：林生迎  
客户服务电话：95565、400-8888-111  
公司网站：www.newone.com.cn

(23) 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  
法定代表人：王东明  
电话：010-60838888  
传真：010-60833739  
联系人：陈忠  
客户服务电话：95558

---

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

(24) 齐鲁证券有限公司

注册地址: 山东省济南市经七路 86 号

法定代表人: 李玮

联系人: 吴阳

电话: 0531-68889155

传真: 0531-68889752

客户服务电话: 95538

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

(25) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

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: 020-87555888

客户服务电话: 95575

开放式基金业务传真: 020-87555305

联系人: 黄岚

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

(26) 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: 安岩岩

电话: 0431-85096517

客户服务电话: 400-600-0686

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)



---

(27) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

(28) 财富证券有限责任公司

地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

电话：0731-4403319

传真：0731-4403439

联系人：郭磊

客户服务电话：0731-84403350

网址：www.cfzq.com

(29) 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

传真：010-66045500

客户服务电话：010-66045678

联系人：林爽

联系电话：010-66045608

公司网站：<http://www.txsec.com> <http://jijin.txsec.com>

(30) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

---

法人代表：张华东  
联系电话：025-83364032  
联系人：徐翔  
传真：025-83320066  
客户服务电话：400-828-5888  
公司网站：www.njzq.com.cn

(31) 中信证券（浙江）有限责任公司  
住所：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：沈强  
联系人：周妍  
联系电话：0571-86078823  
传真：0571-85783771  
客户服务电话：0571-96598  
网址：www.96598.com.cn、www.bigsun.com.cn

(32) 华泰证券股份有限公司  
地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦  
法定代表人：吴万善  
电话：025-83290979  
传真：025-51863323  
联系人：程高峰、万鸣  
客户服务电话：95597  
公司网站：www.htsc.com.cn

(33) 中航证券有限公司  
注册地址：南昌市抚河北路 291 号  
通讯地址：南昌市抚河北路 291 号  
法定代表人：杜航

---

传真：0791-6789414  
联系电话：0791-6768763  
联系人：余雅娜  
客服电话：400-8866-567  
公司网站：www.avicsec.com

(34) 国元证券股份有限公司  
注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
通讯地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
法定代表人：凤良志  
电话：0551-2246273  
传真：0551-2272100  
联系人：陈琳琳  
客户服务电话：400-8888-777 或 95578、安徽省内客服电话：96888  
公司网站：www.gyzq.com.cn

(35) 上海证券有限责任公司  
注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号  
通讯地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号  
法定代表人：郁忠民  
联系人：张瑾  
联系电话：021-53519888  
客户服务电话：021-962518，4008-918-918（全国）  
公司网站：www.962518.com

(36) 光大证券股份有限公司  
注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号  
通讯地址：上海市静安区新闻路 1508 号  
法定代表人：徐浩明  
电话：021-22169999

---

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：95525、10108998、400-888-8788

公司网站：www.ebscn.com

(37) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

通讯地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-85863696

传真：0451-82287211

联系人：高悦铭

客户服务电话：400-666-2288

公司网站：www.jhzq.com.cn

(38) 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：0519-88157761

传真：0519-88157761

客户服务电话：400-888-8588

公司网络地址：www.longone.com.cn

(39) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

---

传真：0755- 82133952

联系人：齐晓燕

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（40） 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

法定代表人：冯戎

电话：010-88085338

传真：010-88085240

联系人：李巍

客户服务电话：4008-000-562（全国）

公司网站：www.hysec.com

（41） 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

电话：021-68778081

传真：021-68778117

联系人：宋歌

客户咨询电话：400-820-9898

公司网站：www.cnhbstock.com

（42） 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

客户服务电话：96326（福建省外加拨 0591）

---

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

(43) 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 胡运钊

联系人: 李良

电话: 027-65799999

传真: 027-85481900

客户服务热线: 95579 或 4008-888-999

客户服务网站: [www.95579.com](http://www.95579.com)

(44) 中信万通证券有限责任公司

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

法定代表人: 杨宝林

联系人: 吴忠超

电话: 0532-85022326

传真: 0532-85022605

客户服务热线: 0532-96577

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

(45) 财富里昂证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼

法定代表人: 罗浩

电话: 021-38784818

传真: 021-68775878

联系人: 倪丹

客户服务电话: 021-68777877

公司网站: [www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

## 二、注册登记机构

---

名称：国海富兰克林基金管理有限公司  
注册地址：广西南宁市琅东滨湖路 46 号  
办公地址：上海浦东世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层  
法定代表人：吴显玲  
电话：（021）38555601  
传真：（021）68880981  
联系人：董卫军

### 三、出具法律意见书的律师事务所

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  
联系电话：（021）31358666  
传真：（021）31358600  
联系人：黎明  
经办律师：吕红、黎明

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司  
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼  
办公地址：上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  
法定代表人：杨绍信  
电话：021-6123 8888  
传真：021-6123 8800  
经办注册会计师：薛竞 单峰

---

## 第六部分 基金的募集

本基金募集期为 2010 年 10 月 18 日至 2010 年 11 月 19 日，本次募集的净销售额为 3,050,679,870.87 元人民币，认购款项在募集期间产生的银行利息共计 848,688.61 元人民币。

本次募集有效认购总户数为 39,874 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，本基金在募集期募集的有效认购份额为 3,050,679,870.87 份，利息结转的基金份额为 848,688.61 份，两项合计共 3,051,528,559.48 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。经中国证券监督管理委员会核准，本基金的基金合同于 2010 年 12 月 23 日生效。



---

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

经中国证券监督管理委员会核准，本基金合同已于 2010 年 11 月 23 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

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

---

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人的直销网点和基金管理人委托的代销机构。目前富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金的代销机构为中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、国海证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、广发证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、南京证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中航证券有限公司、国元证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、江海证券有限公司、东海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### 1、申购、赎回开始日

本基金日常申购和赎回自 2011 年 2 月 22 日起开始办理。

#### 2、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。具体业务办理时间即开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常

---

交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，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，均作为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的交易申请处理，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

### 三、申购与赎回的原则

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

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

5、基金管理人在不损害基金份额持有人合法权益的情况下可根据基金运作的实际情况依法更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定报刊及基金管理人网站上予以公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

---

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

## 2、申购和赎回申请的确认

注册登记机构在 T+1 日对投资者在 T 日开放时间结束前提交的申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应自 T+2 日起(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

基金销售机构对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

## 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。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基金投资者已缴付的申购款项退还给投资者。

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

## 五、申购与赎回的数额限制

1、代销网点和直销网上交易以及直销电话交易投资者每次申购本基金的最低金额为 500 元（含申购费）。直销柜台投资者首次申购本基金的最低金额为 100,000 元（含申购费），追加申购的最低金额为 500 元，已在直销柜台有该基金认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。基金份额持有人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 500 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 500 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整前依照有关规定在指定报刊和基金管理人网站上公告。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金的申购费率如下：

| 申购金额（含申购费）      | 费率       |
|-----------------|----------|
| 50 万以下          | 1.50%    |
| 50 万(含)-100 万   | 1.20%    |
| 100 万（含）-500 万  | 0.80%    |
| 500 万（含）-1000 万 | 0.30%    |
| 1000 万（含）以上     | 1000 元/笔 |

2、本基金的赎回费率如下：

| 持有时间            | 赎回费率  |
|-----------------|-------|
| 1 年以下           | 0.50% |
| 1 年（含 1 年）至 2 年 | 0.20% |
| 2 年（含 2 年）以上    | 0     |

3、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用 =申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

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

|                      | 申购 1     | 申购 2       | 申购 3         |
|----------------------|----------|------------|--------------|
| 申购金额（元，A）            | 10,000   | 1,000,000  | 5,000,000    |
| 适用申购费率（B）            | 1.50%    | 0.80%      | 0.30%        |
| 申购费（C=A-D）           | 147.78   | 7,936.51   | 14,955.13    |
| 净申购金额<br>(D=A/(1+B)) | 9,852.22 | 992,063.49 | 4,985,044.87 |
| 申购份额（=D/1.2000）      | 8,210.18 | 826,719.58 | 4,154,204.05 |

---

#### 4、基金赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

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

赎回金额=赎回份数×T 日基金份额净值

=10,000×1.2500=12,500 元

赎回费用=赎回金额×赎回费率

=12,500×0.5%=62.5 元

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

=12,500 -62.5=12,437.5 元

5、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

6、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费后，以申请当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此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。

7、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此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。

8、基金份额净值的计算公式为：基金份额净值=基金资产净值总额/基金份额总数。基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，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。

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

---

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

11、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、降低赎回费率和收费方式，费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在至少一种中国证监会指定报刊和基金管理人网站上刊登公告。

12、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

13、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人在与相应的代销机构协商一致后，可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率和赎回费率。

## 七、申购和赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，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，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（包含该日）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，注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 2 日在指定媒体予以公告。

## 八、巨额赎回的认定及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

---

## 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应在 2 日内通过中国证监会指定报刊、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案，并应当通过邮寄、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。

(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上（含本数）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 2 日内中国证监会指定报刊和基金管理人网站上进行公告。

## 九、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；



---

(4) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或基金管理人认为会损害现有基金份额持有人利益的申购；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述(1)到(4)情形且基金管理人决定拒绝或暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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根据有关规定在指定报刊和基金管理人网站上刊登重新接受申购公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

(2) 证券交易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) 基金连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并依法公告。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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，若出现上述第3项所述情形，按基金合同的相关条款处理。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

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

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，依照有关规定在指定报刊和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

---

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，则在暂停期结束、基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，提前 2 日在指定报刊和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，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。在暂停期结束、基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，提前 2 日在中国证监会指定报刊和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## 十、定期定额投资计划

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

## 十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

## 十二、非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。非交易过户只能由注册登记机构办理。其中：

---

“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形;

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

无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。

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

### **十三、转托管**

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将其持有的同一基金账户下的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务管理规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

### **十四、基金的冻结与解冻**

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务,由注册登记机构办理。

注册登记机构只受理国家有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。法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。当基金份额处于冻结状态时,注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。

### **十五、基金份额质押及其他基金业务**

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

---

## 第九部分 基金份额的登记

### 一、基金份额注册登记业务

本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

### 二、基金份额注册登记业务办理机构

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

### 三、基金份额注册登记机构的权利

基金份额注册登记机构享有以下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在符合法律法规的情况下，制定、修改、调整开放式基金业务管理规则；
- 5、在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定在指定媒体上公告；
- 6、法律法规规定的其他权利。

### 四、基金份额注册登记机构的职责

注册登记机构履行如下职责：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；

---

3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回与转换等业务记录 15 年以上；

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

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

6、法律法规规定的其他义务。

---

## 第十部分 基金的投资

### （一）投资目标

本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，力求在有效控制风险的前提下，获得基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资范围

本基金投资具有良好流动性的金融工具，投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。在正常市场情况下，本基金将保持较高股票投资比例，不做大幅度的资产配置调整。其中，股票投资的比例范围为基金资产的 80%—95%；债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 5%—20%。现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

基金管理人将重点投资于处于快速成长过程中的中型及小型企业股票。基金管理人每半年将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到总流通市值 2/3 的股票归入中小盘股票。在此期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股等），如果其流通市值可满足以上标准，也称为中小盘股票。本基金不低于 80%的股票资产投资于中小盘股票。

此外，如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

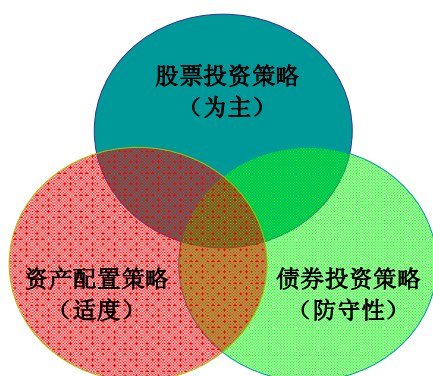
### （三）投资理念

在中国经济维持快速增长、进入结构转型的环境下，具有新业务、新技术、新产品、新商业模式等竞争优势的中小市值企业面临着巨大的发展机遇。本基金在深入的公司研究的基础上，挖掘具备可持续增长潜力且估值合理的中小盘股票，结合宏观研究和行业研究进行积极主动的行业优化配置，将能获得超越投资业绩基准的超额收益。

#### （四）投资策略

本基金将在适度的大类资产配置的基础上，运用“市值筛选、精选个股、行业优化”的股票投资策略。在动态市值筛选的基础上，“自下而上”运用定量和定性相结合的方法精选个股，同时识别和把握不同风格的行业和板块在不同市场阶段的变动趋势中的投资机会，优化行业配置的比例，以谋求超越投资基准的超额收益，实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。



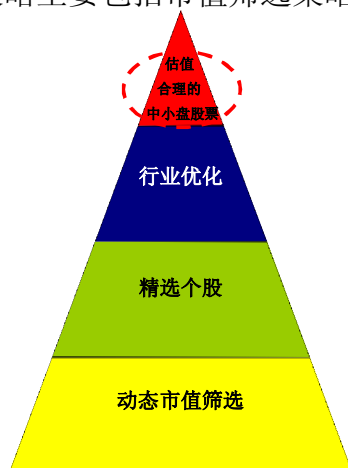
##### 1、资产配置策略

本基金的股票投资的比例范围为基金资产的80%—95%。本基金通过分析宏观经济状况、资产估值水平和市场特征等因素，仅在上述资产配置范围内适度调整股票、债券、货币市场工具和其他法律法规允许的金融工具的投资比例。

##### 2、股票投资策略

本基金在资产配置范围相对固定的情况下，主要采用精选个股和行业优化的投资策略，挖掘并投资于具有良好治理结构、成长性好、估值合理及具有巨大发展潜力的中小市值上市公司。

本基金的股票投资策略主要包括市值筛选策略、精选个股策略和行业优化策略。



---

### （1）动态市值筛选

基金管理人每半年将对中国A股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到A股总流通市值2/3的股票归入中小盘股票。

如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或公允价值计算流通市值。

### （2）精选个股

通过自下而上的精选个股策略，运用定性和定量相结合的方法，从行业发展前景、成长速度、成长质量、成长的驱动因素这四个维度对企业的可持续成长能力进行评估：

#### ①行业发展前景

主要从行业的生命周期、行业景气度、产业政策、产业链景气传导、行业竞争格局等方面，分析上市公司所处行业的发展前景。

#### ②成长速度

结合公司所处行业特征及在行业中的相对竞争地位，分析公司的成长速度，主要考察公司的业务增长、利润增长等，挖掘具有较高成长速度的上市公司。

#### ③成长质量

主要分析公司的利润构成、利润率、资产收益率及其变化，同时考察公司的财务状况、现金流特征，以及公司的研发能力、管理能力、核心技术等竞争优势，评估公司的成长是否来自其内在优势，以及这些支撑公司成长的因素是否具备持续性。

#### ④成长驱动因素

主要从公司的核心竞争力、商业盈利模式、公司治理结构和管理团队素质等方面考察公司保持较快成长速度的驱动因素。

##### ➤ 核心竞争力

核心竞争力使公司得以区别于其竞争对手，保持持续成长能力的来源和基础。考察一个公司是否具有核心竞争力，主要分析公司是否具有核心技术和创新能力（如专利、商标等知识产权），提供的产品（或服务）是否具有较高的



---

技术壁垒，是否具有良好的销售网络、市场品牌或垄断资源等，是否具有领先的经营模式等。

➤ 商业盈利模式

深入分析上市公司的商业盈利模式，判断其是否符合社会经济和行业发展的趋势、是否具备长期的拓展空间、是否具有内在可复制性、是否具有竞争对手难以模仿的独特优势等。只有公司的商业盈利模式符合社会经济和行业发展的大趋势、具有广阔的发展空间、在发展过程中能持续有效，而且保持对竞争对手的领先优势，才能保证公司在未来的持续成长。

➤ 公司治理结构和管理层评价

清晰、合理的公司治理是公司不断良性发展的基础。从股权结构的合理性、信息披露的质量、激励机制的有效性、关联交易的公允性、公司的管理层和股东的利益是否协调和平衡等方面，对公司治理水平进行综合评估。

公司管理层的素质和能力是决定公司能否良性发展、不断创造领先优势的关键因素。对公司管理团队进行评价，主要考察其过往业绩、诚信记录、经营战略规划和商业计划执行能力等。

(3) 行业优化

在把握宏观经济周期性运行规律的基础上，分析市场形势变化以及各个行业的发展趋势，合理调整投资组合在行业间的配置。

(4) 估值水平分析

通过相对估值和绝对估值方法分析股票的合理估值，筛选出市场价格低估或合理的上市公司股票。

### 3、债券投资策略

本基金的债券投资为股票投资不易实施预定投资策略时的防守性措施。债券投资策略主要包括利率预期策略、久期管理策略、类属资产配置策略、个券选择策略等。

### 4、权证的投资策略

本基金不直接从二级市场买入权证，可持有股票派发或可分离交易债券所分离的权证。

### 5、本基金投资程序如下：

---

本基金通过对不同层次的决策主体明确授权范围，建立完善的投资决策运作体系：

(1) 投资决策委员会会议：投资决策委员会为基金管理人的最高投资决策机构，由投资决策委员会主席主持，对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资计划、投资策略重大调整、大类资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

(2) 基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究分析部的研究支持下，根据市场情况，进行投资组合的构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守有关法律法规、基金合同的投资限制及其他要求。

(3) 中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并承担一线风险监控职责。

(4) 风险控制部按照有关法律法规、基金合同和公司制度流程，对基金的投资行为和投资组合进行持续监控，并定期进行风险分析和报告，确保基金投资承担的风险在适当的范围内。

(5) 风险管理和业绩分析会议：由投资决策委员会主席主持，投资总监、研究主管和风险经理参加。风险经理向会议提交最新的投资风险和业绩评估报告，会议讨论基金投资合规控制和风险管理事项并形成决议，同时依据绩效分析的结果提出组合调整建议。

(6) 基金经理根据风险管理和业绩分析会议的决议或建议，对投资组合进行调整，以确保遵守各项合规控制和风险管理要求。

#### **(五) 业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为：

中证 700 指数收益率\*90%+银行同业存款利率\*10%

中证 700 指数衡量股票投资部分的业绩。中证 700 指数是中证指数有限公司以沪深 300 指数为基础编制的系列规模指数之一，其成分股由中盘指数（中证 500）和小盘指数（中证 200）的成份股一起构成，具有较高的权威性及市场代表性。本基金股票投资部分主要投资于具有良好品质和较大发展潜力的企业，尤其是处于快速成长过程中的中型及小型企业的股票，中证 700 指数作为

---

综合反映沪深证券市场中小市值公司整体状况的基准指数，可以较合理地衡量本基金股票投资业绩。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况在履行适当的程序后对业绩比较基准进行相应调整。

#### **（六）风险收益特征**

本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

#### **（七）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、行政法规有关规定，由中国证监会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上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- (3) 基金财产参与股票发行申购时，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；
- (4) 本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (5) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

---

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

(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;

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

(9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(10) 本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估,要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级,本基金根据对债券发行人的内部信用风险分析,决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

(11) 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,致使本款前述第 1 项和第 2 项约定的任何投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消的,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。

#### **(八) 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、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。

#### **(九) 基金的融资、融券**

本基金可以按照国家的有关规定进行融资和融券。在进行交易清算时,以不卖空为基础进行融券。

#### **(十) 基金管理人代表基金份额持有人利益行使股东权利及因基金财产投资于证券所产生的其他权利的处理原则及方法**

1、基金管理人按照国家有关规定,以基金管理人的名义,代表基金份额持有人利益独立行使股东权利、债权人权利及因基金财产投资于证券所产生的其他权利,保护基金份额持有人的利益;

2、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (十一)基金投资组合报告

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

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2012 年 4 月 19 日复核了本投资组合报告的内容。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本投资组合报告所载数据截止 2012 年 3 月 31 日，本报告财务资料未经审计。

#### 1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,306,161,093.81 | 89.08        |
|    | 其中：股票             | 1,306,161,093.81 | 89.08        |
| 2  | 固定收益投资            | 49,355,800.00    | 3.37         |
|    | 其中：债券             | 49,355,800.00    | 3.37         |
|    | 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 | 85,262,697.49    | 5.81   |
| 6 | 其他各项资产       | 25,573,068.08    | 1.74   |
| 7 | 合计           | 1,466,352,659.38 | 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       | 73,860,095.06  | 5.14         |
| B  | 采掘业            | 105,154,807.91 | 7.31         |
| C  | 制造业            | 442,553,056.52 | 30.77        |
| C0 | 食品、饮料          | 183,748,152.04 | 12.78        |
| 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    | 5,001,225.60   | 0.35         |
| C5 | 电子             | -              | -            |
| C6 | 金属、非金属         | -              | -            |
| C7 | 机械、设备、仪表       | 146,223,424.38 | 10.17        |
| C8 | 医药、生物制品        | 107,580,254.50 | 7.48         |
| C9 | 其他制造业          | -              | -            |
| D  | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业            | 128,623,220.44 | 8.94         |
| F  | 交通运输、仓储业       | 14,682,337.12  | 1.02         |
| G  | 信息技术业          | 14,299,752.00  | 0.99         |
| H  | 批发和零售贸易        | 209,360,746.14 | 14.56        |

|   |         |                  |       |
|---|---------|------------------|-------|
| I | 金融、保险业  | 175,108,042.10   | 12.18 |
| J | 房地产业    | 100,400,708.84   | 6.98  |
| K | 社会服务业   | 42,118,327.68    | 2.93  |
| L | 传播与文化产业 | -                | -     |
| M | 综合类     | -                | -     |
|   | 合计      | 1,306,161,093.81 | 90.82 |

**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  | 600778 | 友好集团  | 10,704,142 | 105,649,881.54 | 7.35         |
| 2  | 002375 | 亚厦股份  | 3,227,681  | 93,570,472.19  | 6.51         |
| 3  | 002069 | 獐子岛   | 3,155,066  | 73,860,095.06  | 5.14         |
| 4  | 600123 | 兰花科创  | 1,615,704  | 71,785,728.72  | 4.99         |
| 5  | 000501 | 鄂武商 A | 4,070,368  | 65,125,888.00  | 4.53         |
| 6  | 000895 | 双汇发展  | 881,123    | 60,709,374.70  | 4.22         |
| 7  | 000858 | 五粮液   | 1,333,502  | 43,792,205.68  | 3.05         |
| 8  | 601166 | 兴业银行  | 2,999,934  | 39,959,120.88  | 2.78         |
| 9  | 000783 | 长江证券  | 4,599,816  | 39,742,410.24  | 2.76         |
| 10 | 300070 | 碧水源   | 1,016,511  | 38,525,766.90  | 2.68         |

**4. 报告期末按券种分类的债券投资组合**

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | -             | -            |
| 2  | 央行票据 | 48,365,000.00 | 3.36         |
| 3  | 金融债券 | -             | -            |

|   |           |               |      |
|---|-----------|---------------|------|
|   | 其中：政策性金融债 | -             | -    |
| 4 | 企业债券      | 990,800.00    | 0.07 |
| 5 | 企业短期融资券   | -             | -    |
| 6 | 中期票据      | -             | -    |
| 7 | 可转债       | -             | -    |
| 8 | 其他        | -             | -    |
| 9 | 合计        | 49,355,800.00 | 3.43 |

**5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资  
明细**

| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 数量<br>(张) | 公允价值(元)       | 占基金资<br>产净值比<br>例(%) |
|----|---------|----------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 1101088 | 11央行票据88 | 500,000   | 48,365,000.00 | 3.36                 |
| 2  | 122927  | 09海航债    | 10,000    | 990,800.00    | 0.07                 |
| 3  | -       | -        | -         | -             | -                    |
| 4  | -       | -        | -         | -             | -                    |
| 5  | -       | -        | -         | -             | -                    |

**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) 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体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证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情



形：

2011年4月29日，中国证监会就宜宾五粮液股份有限公司（以下简称“五粮液”）在信息披露方面存在的违法行为公布了相关行政处罚决定书，对五粮液股份有限公司做出了警告处罚，并处以60万元罚款；同时对相关责任人也处以了不同金额的罚款。

本基金对五粮液投资决策说明：本公司的投研团队经过充分调研，认为该处罚不会对五粮液投资价值构成实质性负面影响，对该股的投资决策遵循公司投资制度的规定。

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

### 3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 187,068.74    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 669,321.50    |
| 5  | 应收申购款   | 24,716,677.84 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 25,573,068.08 |

### 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间的可转债。

### 5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

## 第十一部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

截止到2012年3月31日基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较：

| 阶段                        | 净值增长率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    |
|---------------------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2010年11月23日 — 2010年12月31日 | 2.80%   | 1.14%     | -2.55%     | 1.41%         | 5.35%  | -0.27% |
| 2011年1月1日-2011年12月31日     | -18.19% | 1.20%     | -30.06%    | 1.32%         | 11.87% | -0.12% |
| 2012年1月1日-2012年3月31日      | 3.33%   | 1.63%     | 3.76%      | 1.69%         | -0.43% | -0.06% |
| 2010年11月23日-2012年3月31日    | -13.10% | 1.28%     | -29.28%    | 1.40%         | 16.18% | -0.12% |

---

## 第十二部分 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

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人以本基金的名义开立本基金的银行帐户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立基金证券交易资金的清算备付金账户，用于证券资金清算。以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和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、基金财产的保管和处分

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。

5、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

6、除依据法律法规、基金合同及其他有关规定处分外，本基金财产不得被处分。

---

## 第十三部分 基金资产估值

### （一）估值目的

本基金估值的目的是为了准确、真实地反映本基金所持有金融资产和所承担金融负债的公允价值，并准确计算出本基金的收益，为本基金的申购、赎回等交易的价格提供公允的价值基础。

### （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

本基金所持有的金融资产和所承担的金融负债。

### （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、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的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。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

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

#### （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。

#### （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）基金份额净值的计算和确认

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交易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，由基金管理人对外予以公布。

---

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（八）估值错误的处理

1、当基金的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、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；当估值错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应向中国证监会报告；当估值错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时，并及时进行公告。

3、当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任。

4、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。

（九）特殊情形的处理

1、本基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 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、由于本基金所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，国家会计政策变更、市场规则变更等，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。

3、如果法律、法规、规章及中国证监会另有规定的，从其规定。

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

---

## 第十四部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。
- 3、本基金收益每年最多分配 4 次，每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；
- 4、若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配的时间和程序



---

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

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

3、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不超过 15 个工作日。

## **六、收益分配中发生的费用**

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、在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的情况下，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，注册登记机构有权自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

---

## 第十五部分 基金费用与税收

### 一、基金的费用种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、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。

### 二、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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 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 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本部分第一条第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### **三、不列入基金费用的项目**

本部分第一条规定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费用、会计师和律师费用、信息披露费用等不列入基金费用。

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。

### **四、费用调整**

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### **五、基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

---

## 第十六部分 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、基金的审计

- 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，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。

---

## 第十七部分 基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、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）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。



---

## 第十八部分 风险揭示

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

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

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

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

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

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

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

### 一、投资于本基金的风险

本基金是一只主动型投资的股票型基金，属于基金类型中具有中高等级风险的基金品种，本基金的风险与预期收益都高于混合型基金。

#### 1、市场风险

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

---

### （1）政策风险

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

### （2）经济周期风险

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

### （3）利率风险

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

### （4）上市公司经营风险

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

### （5）购买力风险

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

## 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

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

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

## 5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

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

---

## 6、管理风险

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

## 7、操作或技术风险

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

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 8、合规性风险

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

## 9、本基金特有风险

本基金为高仓位股票型基金，其净值波动幅度与股票市场整体波动相关性较高，适宜于对风险承受能力较高的投资者。

本基金所投资的中小市值上市公司相对于大盘蓝筹上市公司存在相对的经营风险，股价波动较为剧烈，从而影响基金的净值表现。

本基金所投资的预计未来盈利状况良好的中小盘股票有可能在短期内不会得到市场的认可，或者其定价能力、抵御通胀能力等实际值没有达到预期，从而暂时影响基金净值表现。

## 10、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

---

## 二、声明

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

---

## 第十九部分 基金合同的终止与基金财产清算

### 一、基金合同的终止

有下列情形之一的，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，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、基金合同终止应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

(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

基金剩余财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于由本基金交纳、中国证券登记结算有限公司公司收取的最低结算备付金等，在中国证券登记结算有限公司公司对其进行调整交收日才能收回。

#### 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。

---

## 第二十分 基金合同摘要

### （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

##### （1）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) 在本合同的有效期限内，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) 自行担任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、审计师、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。

## (2) 基金管理人的义务

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

2) 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) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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他义务。

## 2、基金托管人

### (1) 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、基金合同规定的其他权利。

### (2) 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) 根据法律法规及本合同的约定,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、季度、半年度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) 保存基金份额持有人名册;

13) 复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格及基金收益分配方案;

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) 按照法律法规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。

### 3、基金份额持有人

---

(1) 投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以其在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

(2) 基金份额持有人的权利

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

(3) 基金份额持有人的义务

- 1) 遵守法律法规、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权益的活动；
- 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，获得的不当得利；
- 7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- 8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

---

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组成。基金的每一基金份额都拥有平等的投票权。

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；
- (7) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- (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，可由基金管理人和基金托管人协商修改基金合同或其他相关法律文件：

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

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

(3) 代表基金份额 10%以上（“以上”含本数，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面异议。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；
- (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（包括但不限于委托人身份、代理人身份、代理权限、代理有效期限等）以及送达时间和地点；

(4) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续

(5) 会务常设联系人姓名、电话；

(6) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(7) 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。

(8) 召集人需要通知的其他事项。

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，基金管理人和/或基金托管人不派代表出席的，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，在表决截止日前公布 2 次相关提示性公告；

(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并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

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。

除采用上述通讯开会方式外，在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照本基金合同第九条的约定进行。

## 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(二)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、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) 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

---

4) 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。

5) 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。

6) 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二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员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。

## 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。

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。

---

## （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：

由大会召集人授权的两名监票人在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或托管人经通知后无故不派代表监督计票的，不影响计票效力。

## 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）基金收益与分配

### 1、基金利润的构成

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

### 2、基金可供分配利润

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

### 3、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

---

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(3) 本基金收益每年最多分配 4 次，每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 4、收益分配方案

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

#### 5、收益分配的时间和程序

(1) 本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

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

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

#### 6、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) 在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的情况下，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，注册登记机构有权自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

#### (四) 基金费用与税收

---

## 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) 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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%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 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### (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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(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规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

本条第 1 款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费用、会计师和律师费用、信息披露费用等不列入基金费用。

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。

### 4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### 5、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## (五) 基金财产的投资方向和投资限制

### 1、投资目标

本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，力求在有效控制风险的前提下，获得基金资产的长期稳定增值。

### 2、投资范围

本基金投资具有良好流动性的金融工具，投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。在正常市场情况下，本基金将保持较高股票投资比例，不做大幅度的资产配置调整。其中，股票投资的比例范围为基金资产的 80%—95%；债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的

---

其他金融工具占基金资产的比例范围为 5-20%。现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

基金管理人将重点投资于处于快速成长过程中的中型及小型企业股票。基金管理人每半年将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到总流通市值 2/3 的股票归入中小盘股票。在此期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股等），如果其流通市值可满足以上标准，也称为中小盘股票。本基金不低于 80%的股票资产投资于中小盘股票。

此外，如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 3、投资禁止行为与限制

#### （1）组合限制

- 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) 基金财产参与股票发行申购时，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；
- 4) 本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 5) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- 6) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- 7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- 8) 本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的内部信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。
- 9) 本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

---

10) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

11) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

法律法规或监管部门取消上述限制的,本基金不受上述限制约束。

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不符合基金合同约定的投资组合限制的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

基金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) 从事证券承销业务。

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公司发行的证券或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) 中国证监会禁止的其他行为。

## (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 1、基金资产净值的计算方法

#### (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。

(3) 本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

(4) 本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

(5) 任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的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，按国家最新规定进行估值。

根据有关法律法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍

---

无法达成一致的意見，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 2、基金资产净值、基金份额净值的公告

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。

## (七) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、基金合同的变更

(1) 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

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

基金剩余财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款 1)、2)、3) 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

对于由本基金交纳、中国证券登记结算有限公司公司收取的最低结算备付金等, 在中国证券登记结算有限公司公司对其进行调整交收日才能收回。

#### (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。

#### (八) 争议的处理

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。

#### (九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所, 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, 基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

---

## 第二十一部分 托管协议摘要

### 一、托管协议当事人

(一) 基金管理人(或简称“管理人”)

名称: 国海富兰克林基金管理有限公司

办公地址: 上海浦东世纪大道8号国金中心二期九层

法定代表人: 吴显玲

成立时间: 2004年11月15日

批准设立机关: 中国证券监督管理委员会

批准设立文号: 中国证监会证监基金字[2004]145号

组织形式: 有限责任公司

注册资本: 2.2亿元人民币

(二) 基金托管人(或简称“托管人”)

名称: 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

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: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元

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、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。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。基金管理人应将拟投资的股票库、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；

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，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。

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

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）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，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）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。

（五）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并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

### **三、基金管理人对于基金托管人的业务核查**

1、在本协议的有效期限内，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，并就基金管理人的疑义进行解释或举证。

#### **四、基金财产的保管**

##### **（一）基金财产保管的原则**

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的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》、《基金合同》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。

##### **（二）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。

(三) 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法律法规的有关规定。

(四) 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。

(五) 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。

（六）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。

（七）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。除此以外，基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

（八）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。

## 五、基金资产净值计算和复核

（一）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。基金份额净值的计算保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，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、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传送给基金管理人，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三位内发生差错时，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和基金托管人已承担的赔偿金额，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。

## 六、基金份额持有人名册的保管

### （一）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。

### （二）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。

### （三）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，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。

## 七、争议解决方式

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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。

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。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）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。

### （二）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、本基金更换基金托管人；
- 3、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。

---

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

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

### 一、基金份额注册登记服务

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

### 二、资料寄送

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

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

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

### 三、红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，注册登记机构将其所获红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时选择更改基金分红方式。

---

#### 四、定期定额投资

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

#### 五、资讯服务

##### 1、手机短信提醒服务

投资人在申请开立本公司基金账户时可预留手机号码，由此可获得本公司手机短信提醒服务。内容包括基金新产品、基金新服务、基金资讯信息及交易确认情况等。

##### 2、信息定制服务

投资者可以通过基金管理公司网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理公司通过 E-MAIL、手机短信等定期或不定期的为客户发送所定制的信息。可定制的信息包括：交易确认、定期账户余额及损益、最近季度的基金投资组合、公司最新公告、新产品信息等。业务开通的时间由基金管理人另行公告。

#### 六、客户服务中心

##### 1、客户服务电话

呼叫中心自动语音系统采用恒生呼叫中心系统，为投资人提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务。呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。投资人可以通过该方式了解公司情况、基金产品与服务、基金交易情况、基金账户余额等信息，并提出建议或投诉。

客服电话：4007004518（免长途费）、95105680（免长途费）和 021-3878 9555，按“0”可转人工坐席。

客服传真：021-6887 0708/6888 3069

##### 2、网上客户服务中心

网上“基金账户查询”功能为基金份额持有人提供查询、资讯服务以及相互交流的平台。通过本基金公司的网站，基金份额持有人可以方便快捷地查询个人信息，及时详细地了解各类公告信息。登录网站后，基金份额持有人还可

---

以查询基金账户资料、基金持有情况、基金交易明细、基金分红等信息，变更查询密码，提出投诉和建议，定制信息服务，与客服人员时时交流咨询或给客服人员留言、浏览基金经理报告等。

公司网址：WWW.FTSFUND.COM

电子信箱：SERVICE@FTSFUND.COM

## 七、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

## 八、服务渠道

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

2、网站及在线客服：WWW.FTSFUND.COM

3、传真：021-6887 0708

4、电邮：SERVICE@FTSFUND.COM

5、其他，如邮寄等。



---

## 第二十三部分 其它应披露事项

1、2011年12月6日，富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2011年2号）；

2、2011年12月19日，关于增加长江证券股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告；

3、2011年12月19日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过长江证券股份有限公司开通旗下开放式基金基金转换业务、定期定额投资业务及相关申购费率优惠活动的公告；

4、2011年12月28日，关于增加中信万通证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告；

5、2011年12月28日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过中信万通证券有限责任公司开通开放式基金基金转换及定期定额投资业务的公告；

6、2011年12月30日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告；

7、2011年12月30日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上交易基金申购费率优惠活动的公告；

8、2011年12月30日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加华夏银行股份有限公司基金定期定额投资、网上申购业务以及相关费率优惠活动的公告；

9、2012年1月7日，关于增加财富里昂证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告；

10、2012年1月7日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过财富里昂证券有限责任公司开通旗下开放式基金基金转换及定期定额投资业务的公告；

11、2012年1月13日，关于增加天相投资顾问有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告；

12、2012年1月18日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过天相投资顾问有限公司开通旗下开放式基金基金转换及定期定额投资业务的公告；

---

13、2012 年 1 月 19 日，富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告；

14、2012 年 2 月 9 日，关于与通联支付合作开通中国农业银行借记卡、中国建设银行借记卡支付并实施申购费率优惠的公告；

15、2012 年 2 月 11 日，国海富兰克林基金管理有限公司关于面向个人投资者开通直销柜台传真交易业务的公告；

16、2012 年 3 月 29 日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告；

17、2012 年 3 月 29 日，富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金 2011 年年度报告正文及摘要；

18、2012 年 4 月 7 日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司开放式基金申购费率优惠活动的公告；

19、2012 年 4 月 13 日，关于与通联支付合作开通中国银行借记卡、温州银行借记卡支付并实施申购费率优惠的公告；

20、2012 年 4 月 13 日，关于与通联支付合作开通中国邮政储蓄银行借记卡、上海银行借记卡支付并实施申购费率优惠的公告；

21、2012 年 4 月 21 日，富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告；

22、2012 年 4 月 28 日，关于国海富兰克林基金网上直销银行卡支付并实施申购费率优惠的说明公告；

23、2012 年 5 月 11 日，关于增加中信证券（浙江）有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

---

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

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

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

---

## 第二十五部分 备查文件

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

（一）中国证监会核准富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金募集的文件

（二）《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》

（三）《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金托管协议》

（四）关于申请募集富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金之法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

国海富兰克林基金管理有限公司

2012年7月4日