

---

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金  
招募说明书（更新）

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

---

## 重要提示

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集申请已于 2010 年 2 月 8 日获中国证监会证监许可『2010』176 号文核准，本基金的基金合同于 2010 年 4 月 23 日正式生效。

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

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2012 年 10 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 9 月 30 日。财务数据未经审计。

---

## 目 录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、基金管理人 .....	6
四、基金托管人 .....	16
五、相关服务机构 .....	19
六、基金的募集 .....	39
七、基金合同的生效 .....	42
八、基金份额的申购与赎回 .....	44
九、基金的投资 .....	54
十、基金的业绩 .....	63
十一、基金的财产 .....	65
十二、基金资产的估值 .....	66
十三、基金的收益与分配 .....	71
十四、基金的费用与税收 .....	73
十五、基金的会计和审计 .....	76
十六、基金的信息披露 .....	77
十七、风险揭示 .....	81
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	84
十九、基金合同的内容摘要 .....	87
二十、基金托管协议的内容摘要 .....	102
二十一、对基金份额持有人的服务 .....	112
二十二、其他应披露事项 .....	113
二十三、招募说明书存放及查阅方式 .....	115
二十四、备查文件 .....	115

---

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）等有关法律法规以及《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金的投资目标、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。

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。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，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。基金投资人欲了解本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

《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金招募说明书》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：	指泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《泰达宏利中证财富大盘指数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《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
发售公告：	指《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议	指《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起实施的《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 日由中国证监会公布并于 2011 年 10 月 1 日起实施的《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 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
元：	指人民币元；
基金合同当事人：	指受本基金合同的约束，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：	指泰达宏利基金管理有限公司；
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：	指办理本基金注册登记的机构。本基金的注册登记机构为泰达宏利基金管理有限公司或接受泰达宏利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：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人：	指依据基金合同和招募说明书合法取得本基金基金份额的投资者；
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：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；

工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；
转托管：	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；
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它条件，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：	指基金管理人及代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；
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：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；

T 日：	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；
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、银行存款利息以及其他合法收入；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金财产和负债的价值，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、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。



---

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：2002 年 6 月 6 日

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577605

联系人：苗广斌

注册资本：一亿八千万元人民币

股权结构：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金在内的十八只证券投资基金。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

刘惠文先生，董事长。毕业于吉林大学经济系，经济学学士学位，高级经济师。1996 年至 2001 年任天津泰达集团有限公司总经理。2001 年至 2006 年担

---

任天津泰达投资控股有限公司董事长兼总经理。2006年至2010年任天津泰达投资控股有限公司董事长。2010年起任天津市泰达国际控股（集团）有限公司董事长。兼任渤海财产保险股份有限公司董事长、北方信托国际投资股份有限公司董事长，渤海银行股份有限公司董事、渤海证券有限公司董事等职。

刘振宇先生，董事。毕业于天津师范大学和南开大学，拥有法学学士学位和经济学博士学位，律师、经济师。2000年至2002年任天津泰达集团有限公司投资部副部长。2002年至2008年任天津泰达投资控股有限公司资产管理部经理。2008年任天津市泰达国际控股（集团）有限公司总经理助理。2010年起任天津市泰达国际控股（集团）有限公司副总经理。兼任恒安标准人寿保险有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事等职。

孙泉先生，董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988年任职天津开发区信托投资公司，负责信贷和外汇管理工作；1989年任职天津开发区管理委员会政策研究室，负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和制定工作；1997年任职天津经济技术开发区总公司企划部，负责企业发展战略研究和计划经营管理工作；2001年任职天津泰达投资控股公司资产管理部，负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理，渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

施德林(Marc Howard Sterling)先生，美国国籍，董事。心理学学士学位、法学博士学位及银行法硕士学位。施先生为宏利金融亚洲区行政副总裁，掌管宏利金融在中国和台湾的业务。施先生于亚洲从事金融服务业超过二十一年，其中在宏利工作十七年，五年则为专责有关金融服务的执业律师。施先生为宏利保险策划开拓中国、越南及澳门市场，并为宏利资产管理策划开拓中国及台湾市场。施先生分别自1993年及2000年管理宏利在中国及台湾业务，并于1999至2005年成功开拓及经营宏利在越南之业务。现任宏利金融亚洲区行政副总裁、中宏人寿保险有限公司董事长及宏利证券投资信托股份有限公司主席。

雷柏刚（Robert Allen Cook）先生，加拿大国籍，董事。毕业于加拿大多伦多大学及卡尔加里大学，持有金融学工商管理硕士学位。雷先生为宏利金融亚

---

洲区高级行政副总裁兼总经理，并为宏利金融执行委员会成员。雷先生统领宏利金融于中国内地、香港、印尼、日本、马来西亚、菲律宾、新加坡、台湾、泰国、越南等地的业务发展。雷先生于 2007 年出任现职前曾担任美国保险业务部行政副总裁，掌管恒康人寿保险、恒康长期护理、恒康金融网络等业务单位。雷先生服务宏利逾三十载，历任美国、加拿大、国际及企业业务部多项管理要职，曾驻多伦多、沃特卢、波士顿、英格兰等地，现常驻香港。雷先生于战略规划、保险及年金产品管理、销售、市场推广等领域均饶富经验。现任宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理、宏利国际控股有限公司总裁兼首席行政总监及宏利资产管理(香港)有限公司主席。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基美隆大学，持有数学及管理科学理学学士学位，现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事，掌握亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001 年至 2004 年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。先生于 2001 年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十三年的资本市场经验。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990 年获夏威夷大学经济学博士学位。1984 年至 1998 年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜伊斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，自 2007 年至今，担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，中国政法大学法学硕士学位、民商法法学博士学位。1990 年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所

---

长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

孔晓艳女士，独立董事，毕业于中山大学法律系，法学学士和法学硕士学位，一级律师。1993年至1997年任天津市对外经济律师事务所专职律师。1997年至1999年任香港 Livasari&Co. 律师行中国法律顾问。1999年至2004年任嘉德律师事务所专职律师、高级合伙人。2004年至今任嘉德恒时律师事务所专职律师、高级合伙人。兼全国第九届妇女代表、天津市第十一届、第十二届政协委员、天津市财政局和税务局特邀监察员、天津市津滨发展股份有限公司独立董事、天津律协金融业务委员会主任、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、天津仲裁委员会仲裁员、天津第五届、第六届律协常务理事。

范小云女士，独立董事，毕业于南开大学金融学系，经济学博士学位。毕业于南开大学金融学系，经济学博士学位。1997年至2005年历任南开大学金融学系讲师、副教授。2005年起任南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任。2001年至2005年担任《南开经济研究》副主编。目前为教育部哲学社会科学重大攻关项目首席专家，南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任；兼任中国金融学会理事、中国国际金融学会理事。

## 2、监事会成员

邢吉海先生，监事。毕业于天津干部管理学院财会专业，会计师。1995年至1997年任天津泰达国际酒店集团副总经理兼财务总监。1997年至2000年任职于天津经济开发区财政局。2000年至2001年任天津开发区总公司财务中心主任。2001年起任天津泰达投资控股有限公司监事、财务中心主任。兼任天津市泰达国际控股（集团）有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事、天津泰达股份有限公司董事、天津津滨发展股份有限公司董事、天津滨海能源发展股份有限公司监事会主席等职。

李卓杰先生，监事。毕业于香港浸会大学，获得会计荣誉学位，美国 CPA。1993年在香港加入宏利金融，从1994年起负责中国业务拓展。1999-2001年间，李卓杰被任命为宏利金融越南公司副总经理，负责公司的保险管理与信息科技。2004-2006年，担任中宏人寿保险有限公司北京分公司总经理一职。2005年，同时被任命为中宏保险副总经理。李卓杰负责宏利金融在中国大陆及台湾地区的

---

业务拓展。除了在这些地区制定执行公司战略决策外，他还负责跟进国家政策，促进与政府及合作伙伴间的关系。目前，李卓杰担任宏利环球管理顾问股份有限公司监察人（自 2010 年 7 月起）及正在筹建的安本智库保险经纪人股份有限公司董事长（自 2011 年 3 月起）一职。

王泉先生，监事。管理学学士、经济学硕士。2002 年 3 月加入泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）工作至今，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理。

### 3、总经理及其他高级管理人员

缪钧伟先生，总经理。毕业于复旦大学和香港城市大学，获得理学学士、经济学硕士和金融学博士学位；1998 年 10 月至 2003 年 2 月任证监会基金部副处长；2003 年 3 月至 2006 年 8 月任海富通基金管理有限公司副总经理。2007 年 2 月起任泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）总经理。

刘青山先生，副总经理。毕业于中国人民大学，获史学学士和管理学硕士学位。1997 年就职于华夏证券基金部，参与筹建华夏基金管理公司，从事投资研究工作。2001 年起参与筹建湘财合丰基金管理有限公司（泰达宏利基金管理有限公司前身）并工作至今，期间历任研究部负责人、基金经理、投资副总监，投资总监兼总经理助理。2006 年 11 月起任泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）副总经理兼投资总监。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位。1993 年至 2006 年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006 年 9 月起任泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）财务总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和咨询工作。2002 年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005 年 10 月起任泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限

---

公司) 风险管理部总监。2006 年 11 月起任泰达荷银基金管理有限公司(现泰达宏利基金管理有限公司) 督察长。

#### 4、基金经理

刘欣先生, 理学硕士; 2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司; 2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司; 2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司, 担任产品与金融工程部高级研究员; 2012 年 8 月 14 日起担任泰达宏利财富大盘指数证券投资基金基金经理; 具备 5 年基金从业经验, 5 年证券投资管理经验, 具有基金从业资格。

本基金历任基金经理: 王咏辉先生, 自 2010 年 4 月起至 2012 年 8 月管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理缪钧伟, 副总经理兼投资总监及基金经理刘青山, 投资部总经理兼基金经理梁辉, 研究部总监兼基金经理陈少平, 交易部负责人陈力。

#### 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、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、办理本基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账, 进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案, 及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制中期和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金资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，代表本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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （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）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；

（3）承销证券；

（4）将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；

（5）从事可能使基金财产承担无限责任的投资；

（6）依照法律、行政法规的有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

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、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

（4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

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

- 
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
  - (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
  - (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
  - (11) 贬损同行，以提高自己；
  - (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
  - (13) 以不正当手段谋求业务发展；
  - (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
  - (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着勤勉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、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

- (1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；
- (2) 独立性原则：设立独立的监察稽核与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；
- (3) 相互制约原则：各部门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。



---

## 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）督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（3）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；

（4）风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

（5）监察稽核部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

（6）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

## 3、内部控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

---

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

(5) 建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 4、基金管理人关于内部合规控制声明书

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

---

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

### （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，现有员工120余人。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。2011年末，中国银行各类托管资产规模突破两万亿元，居同业前列。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2012年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富

---

通收益增长混合、海富通中证 100 指数 (LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业 (TMT) 50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、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、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、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)、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等 164 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，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

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

## **五、相关服务机构**

### **（一）基金份额发售机构**

#### **1、直销机构**

##### **1) 泰达宏利基金管理有限公司直销中心**

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

联系人：延慧、崔冉

联系电话：010-66577619、010-66577617

客服信箱：[irm@mfcteda.com](mailto:irm@mfcteda.com)

客服电话：400-698-8888

---

传真：010-66577760/61

公司网站：<http://www.mfcteda.com>

2) 泰达宏利基金网上直销系统

交易系统网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

目前，本基金的网上开户、交易功能可以通过以下途径实现：持有农业银行卡、建设银行卡、兴业银行卡、浦发银行卡、中信银行卡、光大银行卡、招商银行卡、民生银行卡、交通银行卡、汇付天下“天天盈”帐户的客户，可通过基金管理人的网站（<http://www.mfcteda.com>）网上基金直销交易系统开户与交易。

客户服务电话：400-698-8888 或 010-66555662

客户服务信箱：[irm@mfcteda.com](mailto:irm@mfcteda.com)

2、代销机构

**1) 中国银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖 钢

客服电话：95566

银行网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

**2) 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

客服电话：95533

银行网站：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

**3) 中国农业银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

---

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客服电话：95599

银行网站：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

#### 4) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

银行网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

#### 5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

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

#### 6) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：(010) 68858117

客服电话：95580

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



---

**7) 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：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

**8) 深圳发展银行股份有限公司**

注册地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

客户服务电话：95501

联系人：张青

传真：0755-25841098

公司网址：www.sdb.com.cn

**9) 东莞银行股份有限公司**

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

办公地址：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

客服电话：4001196228

公司网址：www.dongguanbank.cn

---

#### 10) 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

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：400 888 8811

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

#### 11) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：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

客户服务热线：96528（上海地区 962528）

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

#### 12) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

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

---

**13) 华夏银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

**14) 北京银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

**15) 温州银行股份有限公司**

注册地址：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

客户服务热线：浙江省 96699，上海 962699，其他地区（0577）96699

公司网站：www.wzbank.cn

**16) 湘财证券有限责任公司**

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

---

客服电话：400-888-1551

传真：021- 68865680

联系人：钟康莺

联系电话：021-68634518

公司网站：www.xcsc.com

#### **17) 渤海证券股份有限公司**

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

电子邮箱：wangzq@bhzq.com

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

#### **18) 中国银河证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568430

联系人：田薇

公司网站：www.chinastock.com.cn

#### **19) 广发证券股份有限公司**

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

---

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575 或致电各地营业网点

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

## 20) 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

客服电话：4008888108

传真：010—65182261

公司网站：www.csc108.com

## 21) 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 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

客服电话：4008888666

联系人：吴倩

公司网站：www.gtja.com

## 22) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

全国免费业务咨询电话：95511-8

---

传真：0755-82400862

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

**23) 东方证券股份有限公司**

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：吴宇

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

**24) 世纪证券有限责任公司**

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：卢长才

联系人：方文

客服电话：0755-83199511

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

**25) 申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

联系电话：021-54033888

客服电话：95523 或 4008895523

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

---

**26) 齐鲁证券有限公司**

注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

**27) 中银国际证券有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：许刚

客服电话：4006208888

传真：021-50372474

联系人：李丹

公司网站：www.bocichina.com

**28) 华泰证券股份有限公司**

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：025-95597

传真：025-84579763

联系人：孙菁菁

公司网站：www.htsc.com.cn

**29) 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: 4006000686  
网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

### 30) 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  
办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号  
法定代表人: 徐浩明  
联系人: 刘晨、李芳芳  
客户服务电话: 4008888788 10108998  
传真: 021-22169134  
公司网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

### 31) 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 38-45 层  
办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层  
法定代表人: 宫少林  
联系人: 林生迎  
联系电话: 0755-82943666  
传真: 0755-82943636  
客户服务电话: 95565, 4008888111  
公司网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

### 32) 长城证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层  
办公地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层  
法定代表人: 黄耀华  
联系人: 李春芳



---

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400 6666 888

公司网址：www.cgws.com

### 33) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：徐翔

联系电话：025-83367888

客户服务电话：400 828 5888

公司网址：www.njq.com.cn

### 34) 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：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

联系人：谢高得

联系电话：021-38565785

客户服务电话：4008888123

公司网址：www.xyzq.com.cn

### 35) 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 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

---

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

### 36) 广州证券有限责任公司

注册地址: 广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19 楼

法定代表人: 刘东

客服电话: 020-961303

联系电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

联系人: 林洁茹

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

### 37) 华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

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

客服电话: 96326 (福建省外请先拨 0591)

传真: 0591-87383610

联系人: 张腾

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

### 38) 国信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

客服电话: 95536

联系人: 齐晓燕

联系电话: 0755-82130833

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

---

### 39) 金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层  
办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼  
法定代表人：陆涛  
客户服务电话：4008-888-228  
传真：0755-83025625  
联系人：马贤清  
网站：www.jyzq.cn

### 40) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼  
办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼  
法定代表人：姚文平  
客服电话：4008888128  
传真：021-68767032  
联系人：罗芳  
公司网站：www.tebon.com.cn

### 41) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
深圳市福田区深南大道 2008 号凤凰大厦 1 栋 9 层  
法定代表人：牛冠兴  
客服电话：4008001001  
联系人：陈剑虹  
联系电话：0755-82825551  
网址：www.essence.com.cn

---

#### 42) 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：梁旭

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

公司网络地址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

客服电话：400-888-8588

#### 43) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层  
(100007)

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层  
(100007)

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

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

#### 44) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼 (410005)

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼 (410005)

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

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

---

#### 45) 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 号宏源大厦  
办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券  
法人：冯戎  
联系人：李巍  
联系电话：010-88085858  
客服电话：4008-000-562  
网址：www.hysec.com

#### 46) 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  
客户服务热线：95579 或 4008-888-999  
联系人：李良  
电话：027-65799999  
传真：027-85481900  
长江证券客户服务网站：www.95579.com

#### 47) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层  
公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层  
法定代表人：雷杰  
客户服务热线：95571  
网址：www.foundersc.com

#### 48) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层  
办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

---

法定代表人：余政  
公司网址：www.msza.com  
客服热线：4006198888

**49) 国金证券股份有限公司**

注册地址：成都市东城根上街 95 号  
办公地址：成都市东城根上街 95 号  
法定代表人：冉云  
公司网址：www.gjzq.com.cn  
客服热线：4006 600109

**50) 中信证券股份有限公司**

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层  
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦  
法定代表人：王东明  
公司网址：www.citics.com  
客服热线：95558

**51) 西藏同信证券有限责任公司**

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号  
办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼  
法定代表人：贾绍君  
公司网址：www.xzsec.com  
客服热线：40088-11177

**52) 中山证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层  
办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层  
法定代表人：吴永良

---

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

客服热线: 4001022011

**53) 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)

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

法定代表人: 张智河

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

客服热线: 96577

**54) 中信证券(浙江)有限责任公司**

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

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦 19 层

法定代表人: 沈强

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

客服热线: 0571-96598

**55) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司**

注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 68 号 8 楼

法定代表人: 汪静波

公司网址: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

客服热线: 400-821-5399

**56) 深圳众禄基金销售有限公司**

注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人: 薛峰

公司网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn); [www.ijmmw.com](http://www.ijmmw.com)

---

客服热线：4006-788-887

**57) 上海好买基金销售有限公司**

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

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

客服热线：400-700-9665

**58) 杭州数米基金销售有限公司**

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

**59) 上海天天基金销售有限公司**

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C-9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

网站：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

**60) 上海长量基金销售投资顾问有限公司**

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟



---

客服电话：400-089-1289

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

（二）注册登记机构

名称：泰达宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

联系人：王泉

联系电话：010-66577768

传真：010-66577750

（三）律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：廖海

（四）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

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：曹银华、单峰

---

## 六、基金的募集

(一) 本基金依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已获中国证监会证监许可『2010』 176 号文核准。

### (二) 基金类型、运作方式及存续期

本基金类型：股票型

本基金运作方式：契约型开放式

本基金存续期：不定期

### (三) 基金份额的发售时间、发售方式和发售对象

1、募集时间：本基金于 2010 年 3 月 15 日至 2010 年 4 月 20 日向社会公开发售。募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月。具体时间由基金管理人与销售机构约定（详见基金份额发售公告及销售机构相关公告）。基金管理人根据认购的具体情况可适当延长募集期，但最长不超过本基金的设立募集期，同时基金管理人也可根据基金认购和市场情况提前结束发售。

2、发售方式：本基金通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心、网上直销及代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告）公开发售。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

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

### (四) 基金份额的认购原则

1、投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2、投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3、通过代销机构认购，单个基金账户单笔最低认购金额为 1000 元（含认购费）；通过基金管理人直销中心认购，单个基金账户单笔首次认购最低金额

为 10 万元（含认购费），追加认购最低金额为 1000 元（含认购费）；通过基金管理人网上直销进行认购，单个基金账户单笔最低认购金额为 1000 元（含认购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销相关说明。

4、募集期间单个投资者的累计认购规模没有限制。

（五）基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

1、基金份额面值：基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。

2、认购费率

投资者如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。本基金认购费率如下表：

认购金额（M）	认购费率
M < 50 万	1.00%
50 万 ≤ M < 250 万	0.60%
250 万 ≤ M < 500 万	0.40%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.20%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期间发生的各项费用。

3、认购份额的计算

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购期间的利息) / 基金份额初始面值

基金份额份数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。

有效认购资金募集期间的利息，在基金合同生效后折算成基金份额，归基金份额持有人所有。

例如：某投资者认购本基金 10 万元，所对应的认购费率为 1.00%。假定该笔认购产生利息 100 元。则认购份额为：

---

净认购金额=认购金额 / (1+认购费率) =100,000 / (1+1.00%)  
=99,009.90

认购费用=认购金额-净认购金额=100,000-99,009.90=990.10

认购份额=(净认购金额+认购期间的利息) / 基金份额初始面值=  
(99,009.90+100) / 1.00=99,109.90 份

即：投资者投资 10 万元认购本基金，假定该笔认购产生利息 100 元，在基金合同生效时，投资者账户登记有本基金 99,109.90 份。

#### (六) 认购的办法

投资者认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金份额发售公告。

#### (七) 认购的确认

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

于网上直销系统认购的投资者可于申请日（T 日）后的第 2 个工作日（T+2）起在本公司网站查询认购结果，但此确认是对认购申请的确认，其最终结果要待本基金合同生效后才能够确认；投资者对于确认后的认购交易不能进行撤销，有关网上直销的相关认购程序请以本公司网站最新的说明及发售公告为准。

#### (八) 募集期利息的处理方式

有效认购资金在募集期形成的利息在基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有，不收取认购费用。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

#### (九) 募集期间的资金

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金合同生效前，任何人不得动用。

---

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同备案的条件

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

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

### （二）基金的验资和备案

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

### （三）基金合同生效

自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （四）基金募集失败

1、基金募集期满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

### （五）基金存续期内基金份额持有人数量和资金数额

---

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 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

---

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过本基金管理人的直销机构及代销机构的代销网点进行。具体的销售网点参见以上“五、相关服务机构”中“（一）基金份额发售机构”。

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）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为本合同生效后基金管理人公告开始办理申购或赎回之日，具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者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，视为下一个开放日的申请，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。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

### （三）申购与赎回的原则

- 
- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
  - 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
  - 3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申(认)购的先后次序进行顺序赎回；
  - 4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在至少一种指定媒体上公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购与赎回申请的提出

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、申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

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 个工作日内支付。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。



---

## （五）申购和赎回的限制

### 1、申请申购基金的金额

通过代销机构申购本基金，单个基金账户单笔最低申购金额为 1000 元（含申购费）；通过直销中心申购本基金，单个基金账户单笔首次申购最低金额为 10 万元（含申购费），追加申购最低金额为 1000 元（含申购费），已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

通过本公司网上直销进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为 1000 元（含申购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销说明。

### 2、申请赎回基金的份额

投资人可将全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回的基金份额不得低于 100 份。

3、基金份额持有人赎回时或赎回后，在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 100 份的，基金管理人有权一次将持有人在該交易账户保留的剩余基金份额全部赎回。

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

5、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额、赎回份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额上限的数量限制，基金管理人进行前述调整必须依照有关规定在至少一种指定媒体上公告。

## （六）申购和赎回的数额和价格

### 1、基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金单位净值

基金份额份数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。

例如：某投资者投资 5 万元申购基金，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

---

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率) = 50000 / (1 + 1.2%) = 49407.11

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额 = 50000 - 49407.11 = 592.89

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值 = 49407.11 / 1.016 =  
48629.05 份

即：投资者投资 5 万元申购基金，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则可得到 48629.05 份基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算

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

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

例如：某投资者赎回基金 1 万份基金份额，持有期小于 1 年，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回金额 = 10000 × 1.016 = 10160 元

赎回费 = 10160 × 0.5% = 50.80 元

净赎回金额 = 10160 - 50.80 = 10109.20 元

即：投资者赎回基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的净赎回金额为 10109.20 元。

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

4、申购份额的处理方式：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，有效份额单位为份。基金份额份数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。

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。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。

6、本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

7、申购费用由投资人承担，并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、注册登记等各项费用。

投资者如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。申购费率具体如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
M < 50万	1.20%
50万 ≤ M < 250万	1.00%
250万 ≤ M < 500万	0.60%
500万 ≤ M < 1000万	0.40%
M ≥ 1000万	每笔1000元

8、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

赎回费率具体如下表所示：

连续持有期限（日历日）	赎回费率
1天 ~ 365天	0.5%
366天（含）~ 730天	0.25%
731天（含）以上	0

9、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施3个工作日前在至少一种指定媒体上公告。

10、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，针对特定范围、特定地域、特定时间、特定交易方式等的基金投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，

---

按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金转换费率。

11、对特定交易方式(如:网上直销)的费率,基金管理人将另行公告。

#### (七) 申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后,基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续,投资者在 T+2 日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

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

基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体上公告。

#### (八) 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管理人无法受理投资者的申购申请;

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况;

(4) 基金财产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或基金管理人认为其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益的情形;

(5) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的;

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时,申购款项将退回投资者账户,由此产生的利息等损失由投资者自行承担。基金管理人决定暂停接受申购申请时,应当依法公告(上述第(5)项除外)。在暂停申购的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

---

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法准确计算当日基金资产净值和基金份额净值；

(3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并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) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种指定媒体，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，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应

---

提前三个工作日，在至少一种指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

### （九）巨额赎回的认定及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

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

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种指定媒体上予以公告。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个或 2 个以上开放日发生连续巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

---

#### （十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内至少在一种指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，至少在一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日至少在一种指定媒体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。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日至少在一种指定媒体上连续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。

#### （十一）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，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本基金合同的规定制定并公告。

#### （十二）基金的非交易过户

基金的非交易过户是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以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有

---

的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### （十三）基金的转托管

基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。转托管在转出方进行申报，基金份额转托管一次完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

### （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的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

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以及法律法规认可的其他情况下的冻结与解冻。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。



---

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

采用指数化投资策略，紧密跟踪中证财富大盘指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差不超过 4%。

### （二）投资理念

采用被动式投资方法，在最小化基金投资组合与标的指数之间跟踪误差与偏离度的同时，实现与标的指数的长期同步增长，获得中国经济增长过程中企业创造的真实财富价值。

### （三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。

### （四）投资策略

本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以使跟踪误差控制在限定范围内。

#### 1、标的指数

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国 A 股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选样，挑选最具创造财富能力的 300 家 A 股上市公

---

司作为样本；此外该指数在加权方式上亦有所创新，不同于一般的市值加权指数，该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应，从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系，预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落，提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

## 2、投资组合的构建

本基金原则上采用指数完全复制方法构建基金的股票投资组合，即根据个股在标的指数中相应的权重构建基金的指数化股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。

## 3、组合的调整

### (1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和对备选股的预期，对股票投资组合及时进行调整。

### (2) 不定期调整

①当成份股实施增发、配送或使股本发生变动等行为时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整。

②当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整。

③根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标的指数的有效跟踪。

④因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整。

⑤在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

## 4、股票的替代

在建仓阶段和基金后续运作过程中，如遇到特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将根

---

据市场情况以跟踪误差最小化为原则，行业、规模、历史表现相似度为标准，采用合理的方法进行适当调整和替代。

#### 5、金融衍生品投资策略

本基金以最小化跟踪误差及风险可控为原则，在法律法规及监管机构允许范围内，采用市场公认的定价技术，适度参与金融衍生品的投资，以实现以下目标：

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

#### 6、跟踪误差的监控与管理

跟踪误差的管理将作为本基金主要的风险控制手段之一，基金经理及风险控制部门将每日跟踪投资组合与标的指数投资回报率之间的偏离度。月末、季末定期对基金投资组合与标的指数收益率间的累积偏离程度进行归因分析，并对控制跟踪误差提出解决方案。

#### （五）业绩比较基准

业绩比较基准： $95\% \times$  中证财富大盘指数收益率  $+5\% \times$  同业存款利率。

如果基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的跟踪目标和投资对象，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

#### （六）风险收益特征

本基金为股票型指数基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

#### （七）投资决策依据及程序

---

## 1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

## 2、投资决策程序

本基金的投资管理程序由研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,降低交易成本,避免重大风险的发生。开放式指数基金跟踪误差的来源包括对受限成份股的替代投资、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入/流出的建仓/变现策略、成份股股息的再投资策略等。基金管理人将通过对这些因素的有效管理并搭配使用其他合理的方法进行适当替代,以使跟踪误差控制在限定范围内。

1) 研究: 基金经理、研究人员依托基金管理人整体研究平台, 整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、组合优化和股票的替代、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作, 撰写研究报告, 作为基金投资决策的重要依据。

2) 投资决策: 投资决策委员会依据研究部提供的研究报告, 定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议, 决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议和基金管理人的研究报告及相关研究成果, 每日进行基金投资管理的日常决策。

3) 组合构建: 基金经理根据标的指数, 结合研究报告, 原则上以复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下, 基金经理将采取适当的技术和方法, 利用股票的替代或其他数量化交易方法来降低买入成本和冲击成本, 控制投资风险。

4) 交易执行: 交易部负责具体的交易执行并利用有效的日内数量化交易方法来降低冲击成本, 同时履行一线监控的职责。

5) 投资绩效评估: 风险管理与基金评估部定期和不定期对基金进行投资绩效评估, 并提供相关报告和建议。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否, 基金经理可以据此检视投资策略, 进而调整投资组合。

---

6)组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、量化分析、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资体制和程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中列示。

## （八）投资限制

### 1.组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1)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%；

(2)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%；

(3)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4)基金投资组合中投资中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

(5)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%；

(6)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%；

(7)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%；

(8)本基金管理人管理的全部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)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

---

(10)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；

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

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

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

## 2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

3.若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

#### （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、融券。

#### （十）基金投资组合报告（未经审计）

##### 1、重要提示

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年11月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止2012年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 2、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	239,366,861.84	88.17
	其中：股票	239,366,861.84	88.17
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	12,074,758.49	4.45
6	其他资产	20,047,815.11	7.38
7	合计	271,489,435.44	100.00

### 3、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 3.1、指数投资部分

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	22,197,062.84	8.82
C	制造业	62,546,050.95	24.85
C0	食品、饮料	6,652,406.98	2.64
C1	纺织、服装、皮毛	755,154.77	0.30
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	436,858.46	0.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,375,419.35	2.14
C5	电子	3,975,916.36	1.58
C6	金属、非金属	17,297,557.00	6.87
C7	机械、设备、仪表	22,474,885.73	8.93
C8	医药、生物制品	5,400,758.80	2.15
C99	其他制造业	177,093.50	0.07
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,570,971.34	2.61
E	建筑业	11,072,812.24	4.40
F	交通运输、仓储业	9,195,451.42	3.65
G	信息技术业	6,057,020.27	2.41
H	批发和零售贸易	6,107,328.13	2.43
I	金融、保险业	97,123,896.23	38.58
J	房地产业	12,281,009.25	4.88
K	社会服务业	3,535,888.39	1.40
L	传播与文化产业	297,163.83	0.12
M	综合类	2,382,206.95	0.95
	合计	239,366,861.84	95.09

#### 3.2、积极投资部分

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 4、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

#### 4.1、期末指数投资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

	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净
--	------	------	-------	---------	--------



序号					值比例 (%)
1	600016	民生银行	2,243,673	12,676,752.45	5.04
2	601166	兴业银行	813,632	9,771,720.32	3.88
3	600000	浦发银行	1,272,445	9,390,644.10	3.73
4	600036	招商银行	709,282	7,206,305.12	2.86
5	601328	交通银行	1,681,218	7,161,988.68	2.85
6	600015	华夏银行	711,129	5,717,477.16	2.27
7	601818	光大银行	2,057,770	5,473,668.20	2.17
8	601169	北京银行	755,346	5,189,227.02	2.06
9	601318	中国平安	115,802	4,856,735.88	1.93
10	601668	中国建筑	1,508,681	4,631,650.67	1.84

#### 4.2、 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 5、 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。

#### 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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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。

#### 8、 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。

#### 9、 投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2) 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	271,494.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	77,917.62
4	应收利息	3,473.63
5	应收申购款	19,694,929.16

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,047,815.11

(4) 报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明。

(5.1) 本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

(5.2) 报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(6) 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十、基金的业绩

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。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。

本基金合同生效日为 2010 年 4 月 23 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

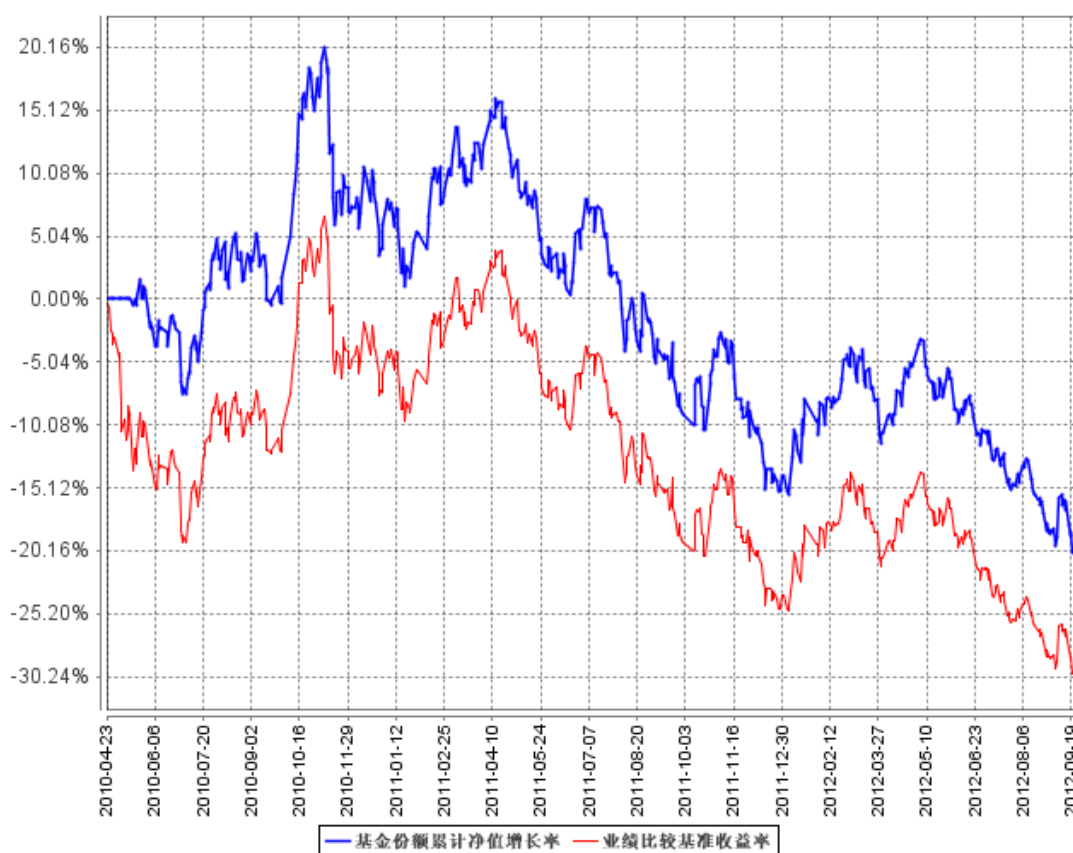
### (一) 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值 收益率 ①	基金净值 收益率标 准差②	比较基准 收益率 ③	比较基准 收益率标 准差 ④	①-③	②-④
2010.4.23 至 2010.12.31	5.91%	1.32%	-5.90%	1.55%	11.81%	-0.23%
2011.1.1 至 2011.12.31	-18.96%	1.20%	-18.87%	1.20%	-0.09%	0.00%
2012.1.1 至 2012.9.30	-3.68%	1.11%	-4.71%	1.10%	1.03%	0.01%

自基金合同生效日 (2010年4月23日)至 2012年9月30日	-17.33%	1.21%	-27.26%	1.28%	9.93%	-0.07%
---	---------	-------	---------	-------	-------	--------

(二) 本基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2010年4月23日-2012年9月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。根据证券投资基金运作管理办法第三十二条的规定，基金建仓期为自合同生效之日起6个月。本基金合同于2010年4月23日生效，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

---

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金的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负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

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

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、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。

---

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法

##### （1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

##### （2）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

---

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

### (3) 有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

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

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

## 3、权证估值：

### (1) 配股权证的估值：

---

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、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、在任何情况下，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。

(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、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，决定延迟估值；
  - 4、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的确认

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

基金份额净值的计算精确到 0.001 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、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后 3 位（含第 3 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资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

- 3、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、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、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、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。

---

## 十三、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

本合同项下基金收益指基金利润，即基金本期利息收入、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止收益分配基准日资产负债表中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

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式分为两种：现金分红或红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者事先未作出选择，本基金默认的收益分配方式为现金分红；选择红利再投资的，分红资金将按除息日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

3、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；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 10%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

5、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可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （五）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

---

#### （六）收益分配中发生的费用

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。当基金份额持有人所获现金红利不足支付银行转账或其他手续费用时，注册登记机构可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。

---

## 十四、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的指数许可使用费；
- 4、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）；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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

### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常市场情况下，基金管理费按基金前一日基金资产净值的 0.65% 的费率计提，具体计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

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

#### 2、基金托管人的托管费

在通常市场情况下，基金托管费按基金前一日基金资产净值的 0.12% 的费率计提，具体计算方法如下：

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

---

H 为每日应计提的基金托管费；

E 为前一日基金资产净值。

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

### 3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法每日计提指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用从基金财产中列支；基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率每日计提，逐日累计。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人与指数许可方约定了每季度（包括基金成立当季）指数许可使用费人民币伍万元（5 万元）（即不足人民币 5 万元时按照人民币 5 万元收取）的收取下限，则该下限超出当季累计指数使用费的部分（即：每季度指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费）由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。基金合同生效后的指数许可使用费按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

4、除管理费、托管费和基金合同生效后的指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## （四）与基金销售有关的费用

### 1、基金的申购费用

---

本基金的申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

## 2、基金的赎回费用

本基金的赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

### （五）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本基金财产的损失，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。

（六）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。

### （七）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

---

## 十五、基金的会计和审计

### （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、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。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 日内公告。
- 3、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；

---

## 十六、基金的信息披露

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

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

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

(一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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



---

基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

## （二）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及更新的招募说明书。

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到或超过基金份额净值 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、基金托管人和代销机构的住所，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，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

---

## 十七、风险揭示

本基金存在的主要风险有：

### （一）市场风险

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

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

2、经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险：上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险：基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

### （三）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管

---

理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

#### （四）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回和基金间转换。由于应对基金赎回和基金间转换的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回和基金间转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

#### （五）本基金特定投资策略带来的风险

本基金为股票型指数基金，存在的风险包括跟踪偏离风险和标的指数风险。

**跟踪误差风险：**本基金管理人将尽责进行严格风险控制，并控制基金投资组合与标的指数之间的跟踪误差及偏离度，但由于法律法规及其他限制，本基金不能投资于部分成分股；此外，在基金的日常运作中由于受到运作费用、交易成本、日常申购赎回以及市场流动性影响，不可避免的会产生与标的指数之间的跟踪偏离。

**标的指数风险：**标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

#### （六）基金间转换所产生的风险

在基金间转换时，可能使相关的基金的规模发生较大改变，从而对转出和转入基金的原持有人利益产生影响。

#### （七）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

- 
- 3、因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;
  - 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;
  - 5、因业务竞争压力可能产生的风险;
  - 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失,影响基金收益水平,从而带来风险;
  - 7、其他意外导致的风险。

---

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

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

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

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

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、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；

3、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、从基金财产中获得补偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

---

## 2、基金财产清算组

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

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

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

## 3、清算程序

(1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

(2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

(3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

(4) 对基金财产进行评估和变现；

(5) 制作清算报告；

(6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对基金财产进行分配。

## 4、清算费用



---

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

## 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

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

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

## 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。

---

## 十九、基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### (一)基金管理人

名称：泰达宏利基金管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

邮政编码：100033

法定代表人：刘惠文

成立时间：2002年6月6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[2002]37号

组织形式：有限责任公司

注册资本：一亿八千万元人民币

存续期间：持续经营

#### (二)基金托管人

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：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

#### (三)基金份额持有人

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。

(四) 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) 在本基金合同的有效期限内，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基金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和更换适当的代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行承担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。

#### (五) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (1) 依法申请并募集基金，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。

#### (六) 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。

#### (七) 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非法利益，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) 根据法律法规及本基金合同的约定，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、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) 建立并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，其赔偿责任不因其退任而免除；

(19) 因基金管理人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。

- 
- (八) 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。
- (九) 基金份额持有人的义务
- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
  - (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
  - (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
  - (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
  - (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
  - (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
  - (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。
- (十) 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

## 二、基金份额持有人大会

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金的每一基金份额都拥有平等的投票权。

---

(二) 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。

(三) 有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- 3、因相应的法律法规发生变动或监管部门要求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交易、非交易过户、转托管等业务规则；
- 7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四) 召集方式：

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



---

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

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

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项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。

#### （五）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 天在至少一种指定媒体上公告。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，包括授权委托书的内容（如委托人身份、代理人身份、代理权限、代理有效期限等）、送达时间和地点；

4、会务常设联系人姓名、电话；

5、权益登记日；

6、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

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。

#### （六）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；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，全部有效凭证所代表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，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

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

---

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

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定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。

#### (七) 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) 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。

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决

---

的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，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。

### (八) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 特别决议

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

#### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 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。

### (九) 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

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

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。基金管理人或基金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。

## (十) 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指定媒体上公告。

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。

(十一) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### (一) 基金合同的变更

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

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

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

#### (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、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；

3、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、从基金财产中获得补偿的权利。

---

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

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

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

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

#### 3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；

---

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

#### 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。

### 四、争议的处理

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 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，按照其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。

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

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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。



---

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：泰达宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

邮政编码：100033

法定代表人：刘惠文

成立日期：2002年6月6日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2002]37号

组织形式：有限责任公司

注册资本：一亿八千万元人民币

存续期间：持续经营

#### (二) 基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机

---

构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人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）款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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（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，并依照法律法规的规定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，并依照法律法规的规定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 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基

---

金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

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。

#### 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，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。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会计核算

#### （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。

2、基金管理人应于每个开放日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》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。基金管理人和基金托管人也可以其他双方确认的方式确认基金份额净值。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时及时进行公告。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及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。

## （二）基金会计核算

### 1、基金账册的建立

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

### 2、会计数据和财务指标的核对

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

### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管



---

理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

## 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。

## 七、适用法律与争议解决方式

(一) 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 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，并按其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。

(三) 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、终止与基金财产的清算

### (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。

### (三) 基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

---

## 二十一、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。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）资料寄送服务

#### 1、基金投资人交易资料的对账服务

每次交易结束后，基金投资人可在 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投资人意愿向有交易的基金投资人以书面形式寄送季度对帐单；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持有人意愿对所有的持有人以书面形式寄送年度对帐单。

#### 2、其他相关的信息资料

### （二）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。

### （三）基金间转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，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本基金合同的规定制定并公告。

### （四）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以定时定额申购基金份额。具体实施时间和业务规则另行公告。

---

### （五）资讯服务

基金管理人利用公司客户服务平台定期为投资人提供日报、周报、月报等投资理财相关资讯，让投资者即时了解市场最新动态。

### （六）咨询服务

泰达宏利客服中心为投资者提供 7×24 小时的电话语音服务，投资者可通过客服电话 400-698-8888 的语音系统或登录公司网站 <http://www.mfcteda.com>，查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间还将为投资者提供周到的人工答疑服务。

### （七）投诉受理

投资人可以拨打泰达宏利基金管理有限公司客户服务中心电话 400-698-8888 或客服信箱：[irm@mfcteda.com](mailto:irm@mfcteda.com) 投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

## 二十二、其他应披露事项

1. 本基金管理人已于 2012 年 4 月 24 日发布《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金 2012 年第 1 季度报告》。
2. 本基金管理人已于 2012 年 4 月 26 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于网上交易暂停服务的公告》。
3. 本基金管理人已于 2012 年 4 月 28 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告》。
4. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 7 日发布《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金招募说明书（更新）》。
5. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 7 日发布《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金更新招募说明书摘要》。
6. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 13 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并实施申购费率优惠的公告》。

---

7. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 13 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳众禄基金销售有限公司为代销机构并实行申购费率优惠的公告》。

8. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 15 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于推迟上海好买基金销售有限公司代销公司旗下基金的公告》。

9. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 15 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告》。

10. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 27 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于开通兴业银行卡网上直销定期定额投资、定期不定额投资业务的公告》。

11. 本基金管理人已于 2012 年 6 月 29 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告》。

12. 本基金管理人已于 2012 年 7 月 5 日发布《关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为开放式基金代销机构的通知》。

13. 本基金管理人已于 2012 年 7 月 13 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并实施费率优惠的公告》。

14. 本基金管理人已于 2012 年 7 月 19 日发布《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金 2012 年第 2 季度报告》。

15. 本基金管理人已于 2012 年 7 月 19 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并实施费率优惠的公告》。

16. 本基金管理人已于 2012 年 7 月 20 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构并实施费率优惠的公告》。

17. 基金管理人已于 2012 年 8 月 12 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构并实施费率优惠的公告》。

---

18. 基金管理人已于 2012 年 8 月 16 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》。

19. 管理人已于 2012 年 8 月 22 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。

20. 管理人已于 2012 年 8 月 29 日发布《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金 2012 年半年度报告》及摘要。

21. 管理人已于 2012 年 9 月 28 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告》。

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒体上公告。

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

招募说明书分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，投资者可在办公时间查阅、复制；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(<http://www.mfcteda.com>)查阅和下载招募说明书。

## 二十四、备查文件

(一) 本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

---

7、中国证监会要求的其他文件。

(二) 备查文件的存放地点和投资者查阅方式

1、存放地点：基金合同、托管协议存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

泰达宏利基金管理有限公司

2012年12月7日