

# 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

## 更新招募说明书

(2013年第1号)

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司



### 重要提示

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2011年11月9日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1801号文核准募集。本基金的基金合同于2012年5月25日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

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，由于基金投资者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，投资者在申购本基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 11 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 9 月 30 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目录

第一节	绪言	2
第二节	释义	3
第三节	基金管理人	8
第四节	基金托管人	16
第五节	相关服务机构	20
第六节	基金的募集	34
第七节	基金合同的生效	35
第八节	基金份额的申购与赎回	36
第九节	基金的转换	44
第十节	基金的非交易过户与转托管	45
第十一节	基金的投资	46
第十二节	基金的业绩	58
第十三节	基金的财产	59
第十四节	基金资产的估值	60
第十五节	基金的收益与分配	66
第十六节	基金的费用和税收	68
第十七节	基金的会计与审计	70
第十八节	基金的信息披露	71
第十九节	风险揭示	76
第二十节	基金的终止和清算	81
第二十一节	基金合同的内容摘要	83
第二十二节	基金托管协议的内容摘要	107
第二十三节	对基金份额持有人的服务	120
第二十四节	其他披露事项	122
第二十五节	基金管理人和基金托管人的更换	124
第二十六节	招募说明书的存放及查阅方式	127
第二十七节	备查文件	128

## 第一节 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》）及其他有关规定以及《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二节 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金
2. 基金管理人：指海富通基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书：指《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7. 基金份额发售公告：指《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金份额发售公告》
8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他规范性文件
9. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10. 《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13. 《办理规则》：指上海证券交易所 2005 年 7 月 14 日发布并施行的《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》
14. 《实施细则》：指中国证券登记结算有限责任公司 2005 年 7 月 27 日发

布并施行的《开放式基金通过上海证券交易所场内认购、申购与赎回登记结算业务实施细则》

15.《操作指引》:指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司 2005 年 7 月 27 日发布并施行的《通过上海证券交易所办理开放式基金相关业务操作指引》

16.中国证监会:指中国证券监督管理委员会

17.银行业监督管理机构:指中国银行业监督管理委员会

18.基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19.个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20.机构投资者:指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21.合格境外机构投资者:指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

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

23.基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24.基金销售业务:指基金管理人或代销机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25.会员单位:指具有开放式基金代销资格,经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员

26.销售机构:指直销机构和代销机构

27.直销机构:指海富通基金管理有限公司

28.代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构,包括可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理有关业务的会员单位

29. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
30. 场内：指通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所
31. 场外：指通过上海证券交易所开放式基金销售系统外办理开放式基金份额认购、申购、赎回等业务的销售机构和场所
32. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等
33. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为海富通基金管理有限公司或接受海富通基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构
34. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
35. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的本基金的基金份额变动及结余情况的账户
36. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
37. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月
38. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
39. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
40. T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
41. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日 (不包含 T 日)
42. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
43. 《业务规则》：指《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金

管理人和投资人共同遵守

44. 认购：指在基金募集期内，投资人按基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

45. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

46. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

47. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

48. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的行为

49. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由该销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

50. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 的情形

51. 元：指人民币元

52. 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

53. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

54. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

55. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额所得数值

56. 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

57. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体



58. 中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

59. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免的任何事件

### 第三节 基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：包瑾

注册资本：1.5 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎投资管理 BE 控股公司 49%。

#### (二) 主要人员情况

**邵国有先生**，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

**吉宇光先生**，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997 年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

**艾德加 (Stewart Edgar) 先生**，董事，英国籍，学士。历任英国 Ivory & Sime 公共有限公司基金经理，美国 Fiduciary 国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国 HD 国际有限公司高级基金经理、董事，美国 F&C 管理公司高级基金经理、董事，比利时富通基金管理公司董事总经理，法国巴黎投资管理公司亚太区董事总经理。

**田仁灿先生**，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁 Euroequipment S.A. 公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

**张文伟先生**，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

**郑国汉先生**，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院院长及经济系讲座教授。

**巴约特 (Marc Bayot) 先生**，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，Pionner 投资公司独立副董事长、Fundconnect 独立董事长、Degroof 资产管理公司独立董事和法国巴黎银行 B Flexible SICAV 独立董事。

**杨国平先生**，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通(集团)股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业(集团)股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

**王明权先生**，独立董事，硕士，高级经济师。历任武汉市人民政府副市长、交通银行行长、党委(组)书记、副董事长、中国光大(集团)总公司董事长、党委书记。现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

**李础前先生**，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

**谷若鸿 (Mr. Laurent couraudon) 先生**，法国籍，国际贸易硕士。历任法国巴黎银行瑞士日内瓦分行商品及贸易融资部高级客户经理，法国巴黎银行莫斯科代表处能源及商品融资首席代表，法国外贸银行莫斯科分行董事及企业金融部主管，法国巴黎银行俄罗斯分行业务拓展主管，法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯区总裁，现任法国巴黎银行(中国)有限公司董事会主席兼中国区总裁。

**奚万荣先生**，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003 年 4 月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理、监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003 年 4 月至今任海富通精选混合基金经理，2003 年 4 月至 2012 年 9 月任海富通基金管理有限公司投资总监，2005 年 7 月至 2006 年 9 月任海富通股票基金经理，2006 年 3 月至 9 月任海富通收益增长混合基金经理，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007 年 2 月至 2007 年 8 月任海富通风格优势股票基金经理，2007 年 4 月至 2007 年 8 月任海富通精选贰号混合基金经理，2008 年 6 月至 2011 年 2 月任海富通中国海外股票（QDII）基金经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006 年 5 月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

刘璿女士，硕士。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司，曾任华安上证 180ETF 基金经理助理；2007 年 3 月至 2010 年 6 月担任华安上证 180ETF 基金经理，2008 年 4 月至 2010 年 6 月担任华安中国 A 股增强指数基金经理。2010 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2010 年 11 月起任海富通上证周期 ETF 及海富通上证周期 ETF 联接基金经理，2011 年 4 月起兼任海富通上证非周期 ETF 及海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2012 年 1 月起兼任海富通中证 100 指数（LOF）基金经理。2012 年 5 月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理；戴德舜，投资总监；蒋征，股票相对收益组合部总监；丁俊，研究总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

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. 中国证监会规定的其他职责。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，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）用基金资产承销证券；
- （6）用基金资产向他人贷款或提供担保；
- （7）用基金资产从事承担无限责任的投资；
- （8）用基金资产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- （9）以基金资产向基金管理人、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；
- （10）以基金资产买卖与基金管理人、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；

(11) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(12) 法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

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

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(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；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；

(9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(10) 贬损同行，以提高自己；

(11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(12) 以不正当手段谋求业务发展；

(13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(14) 法律法规禁止的其他行为。

#### 4. 基金经理承诺

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

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

(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) 基金管理人的内部控制制度

### 1. 内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

(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，并普遍适用于公司每一位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部和监察稽核部，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

(3) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(4) 有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

(6) 适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性；

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

(9) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

### 2. 内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性

原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1) 公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟定，其制定和实施需事先报经公司业务管理委员会讨论通过和总经理批准。

公司致力于将国际资产管理行业成熟的专业经验同中国资产管理行业的实际情况相结合，建立既符合国际规范又行之有效的内部控制机制。

### 3. 完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系，董事会层面设立督察长，管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部和风险管理部，通过风险管理制度、合规性制度和稽核监察制度三个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系，对公司内部控制和风险管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈，保障公司内部控制机制的严格落实。

风险管理制度由董事会下设的风险委员会制定风险管理政策，由管理层的风险管理委员会负责实施，由风险管理部专职落实和监督，公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施，全面把握风险点，将风险管理责任落实到人，实现对风险的日常管理和过程中管理，防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

合规性制度由监察稽核部具体落实，通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估及检查，监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况，识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险，提出并完善公司各项合规性制度，以



充分维护公司客户的合法权益。

稽核监察制度在督察长的领导下严格实施，由监察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职能，通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节，对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

#### 4. 基金管理人关于内部控制的声明

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

## 第四节 基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### (1) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2011 年 9 月 30 日，中国建设银行资产总额 117,723.30 亿元，较上年末增长 8.90%。截至 2011 年 9 月 30 日止九个月，中国建设银行实现净利润 1,392.07 亿元，较上年同期增长 25.82%。年化平均资产回报率为 1.64%，年化加权平均净资产收

益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元,较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%,净利息收益率为2.68%,分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元,较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科、台北设有代表处,海外机构已覆盖到全球13个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家,拥有建行亚洲、建银国际,建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年,中国建设银行主要国际排名位次持续上升,先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10,较去年上升3位;在美国《财富》世界500强中排名第108位,较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”,先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

## (二) 主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部副总经理(主持工作),曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国

建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格

有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第五节 相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

联系人：康旭

电话：021-38650797

传真：021-33830160

#### 2、场外代销机构

##### (1) 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

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

联系人：张静

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

##### (2) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66593777

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

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

(4) 交通银行股份有限公司

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

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

(5) 招商银行股份有限公司

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

客户服务电话：95555

联系人：邓炯鹏

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

(6) 中国民生银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍

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

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

联系人：徐伟、汤嘉惠

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

(8) 中国农业银行股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

传真：010-85108557

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

(9) 浙商银行股份有限公司

地址：中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

客户服务电话：95527

联系人：毛真海

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

(10) 海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

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

(11) 东北证券股份有限公司

地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：4006000686

联系人：潘锴

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(12) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：万建华

客户服务电话：95521



联系人：芮敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

(13) 申银万国证券股份有限公司

地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

客户服务电话：95523

联系人：高夫

网址：www.sywg.com.cn

(14) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

(15) 招商证券股份有限公司

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：官少林

客户服务电话：95565

联系人：林生迎

网址：www.newone.com.cn

(16) 兴业证券股份有限公司

地址：福建省福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

(17) 长江证券股份有限公司

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

客户服务电话：95579

联系人：李良

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

**(18) 广发证券股份有限公司**

法定代表人：孙树明

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

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

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

**(19) 东方证券股份有限公司**

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

客户服务电话：95503

联系人：吴宇

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

**(20) 国信证券股份有限公司**

地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层到 26 层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

联系人：齐晓燕

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

**(21) 中国银河证券股份有限公司**

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

客户服务电话：4008-888-888

联系人：田薇

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

**(22) 平安证券有限责任公司**

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

客户服务电话：95511 转 8

联系人：郑舒丽

网址：stock.pingan.com

**(23) 财通证券有限责任公司**

地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客户服务电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

联系人：徐轶青

网址：www.ctsec.com

**(24) 中信万通证券有限责任公司**

地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：0532-96577

联系人：吴忠超

网址：www.zxwt.com.cn

**(25) 天相投资顾问有限公司**

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客户服务电话：010-66045678

联系人：林爽

网址：www.txsec.com

**(26) 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

客户服务电话：95597

联系人：肖亦玲

网址：www.htsc.com.cn

**(27) 光大证券股份有限公司**

地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客户服务电话：95525

联系人：刘晨、李芳芳

网址：www.ebscn.com

**(28) 中信证券股份有限公司**

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

电话：95558

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

**(29) 中信证券（浙江）有限责任公司**

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

客户服务电话：0571-96598

联系人：俞会亮

网址：www.bigsun.com.cn

**(30) 瑞银证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

客户服务电话：400-887-8827

联系人：谢亚凡

网址：www.ubssecurities.com

**(31) 中航证券有限公司**

地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

电话：4008866567

联系人：戴蕾

网址：www.scstock.com

**(32) 国元证券股份有限公司**

地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：蔡咏

客户服务电话：95578

联系人：陈琳琳

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

**(33) 德邦证券有限责任公司**

住所：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 层

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

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

**(34) 宏源证券股份有限公司**

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

客户服务电话：4008-000-562

联系人：李巍

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

**(35) 齐鲁证券有限公司**

地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙豪志

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

**(36) 第一创业证券股份有限公司**

地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人：刘学民

客户服务电话：4008881888

联系人：魏颖

网址：<http://www.fcsc.com>

(37) 安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

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

(38) 中国中投证券有限责任公司

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

法定代表人：龙增来

客户服务电话：95532 或 400-600-8008

联系人：刘毅

网址：<http://www.china-invs.cn/>

(39) 华宝证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

联系人：刘闻川

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

(40) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

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

(41) 长城证券有限责任公司

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

客户服务电话：4006666888

联系人：高峰

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

(42) 华福证券有限责任公司

地址：福州五四路新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：0591-96326

联系人：张腾

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

(43) 渤海证券股份有限公司

地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

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

(44) 广州证券有限责任公司

地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

法定代表人：刘东

客户服务电话：020-961303

联系人：林洁茹

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

(45) 大通证券股份有限公司

地址：大连市沙河口区会展路 129 号

法定代表人：于宏民

客户服务电话：4008169169

联系人：谢立军

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

(46) 江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：高悦铭

客服电话：400-666-2288

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

**(47) 山西证券股份有限公司**

地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

**(48) 国都证券有限责任公司**

地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

**(49) 财富证券有限责任公司**

地址：湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26~28 层

法定代表人：周晖

电话：0731-84403360

联系人：朱友谊

网址：www.cfzq.com

**(50) 中山证券有限责任公司**

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

客户服务电话：4001022011

联系人：李珍

网址：www.zszq.com.cn

**(51) 日信证券有限责任公司**

地址：呼和浩特市新城區錫林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

客户服务电话：010-88086830

联系人：冯杰

网址：www.rxzq.com.cn



**(52) 国联证券股份有限公司**

地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦7-9楼

法定代表人：雷建辉

客户服务电话：95570

联系人：沈刚

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

**(53) 国金证券股份有限公司**

地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼

法定代表人：冉云

客户服务电话：4006600109

联系人：金喆

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

**(54) 深圳众禄基金销售有限公司**

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

客户服务电话：4006-788-887

联系人：张玉静

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

**(55) 杭州数米基金销售有限公司**

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

客户服务电话：4000-766-123

联系人：周瑾旻

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

**(56) 上海好买基金销售有限公司**

地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：唐眉

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

(57) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-089-1289

联系人：张裕

网址：www.erichfund.com

### 3、场内代销机构

具有开放式基金代销资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构，相关信息同时通过上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）登载。

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并按照相关规定及时公告。

#### (二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：010-59378835

传真：010-59378907

联系人：任瑞新

#### (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

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：吕红

联系电话：021-31358666

经办律师：吕红、李永波

**(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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：汪棣、金毅

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：刘莉

## 第六节 基金的募集

本基金经 2011 年 11 月 9 日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】第 1801 号文核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从 2012 年 4 月 23 日起，至 2012 年 5 月 22 日止，共募集 756,241,204.93 份基金份额，有效认购户数为 5,355 户。

## 第七节 基金合同的生效

本基金的基金合同已于2012年5月25日正式生效。本基金基金合同生效后，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；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，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 第八节 基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体业务办理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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。

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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于2012年6月8日起开始办理包括日常申购、赎回在内的日常交易业务。

基金管理人于申购、赎回开放日前已依照有关规定在指定媒体上公告。

3. 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、赎回或转换申请且基金管理人或注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回、转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金份额申购、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，即按照投资人认购、申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基金管理人规定的时间以内撤销。

5. 场内申购、赎回需遵守《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》及其相关的《实施细则》和《操作指引》的规定。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （四） 申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金份额持有人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内（包括该日）对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式及时查询申请的确认情况。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内，注册登记机构可根据《业务规则》，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

### （五） 申购与赎回的数额限制

1、场外单笔申购的最低金额为 1000 元，各代销渠道在此最低起点金额以上有其他规定的，以各代销渠道的业务规定为准；场内单笔申购的最低金额为 1000 元，最高金额为 99,999,900.00 元，且场内单笔申购金额必须是 100 的整数倍；

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 1000 份基金份额，且通过场内单笔申请赎回的基金份额必须是整数份；基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 1000 份的，需一并全部赎回；

3、本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 1000 份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的基金份额低于 1000 份时，注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理；

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

### （六） 申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。本基金场内的申购、赎回费率与场外的申购、赎回费率相同。

2、申购费率按照申购金额逐级递减，注册登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。实际执行的申购费率如下：

业务类型	金 额 (M)	费率
申购	M ≥ 500 万	按笔收取, 1000 元/笔
	100 万 ≤ M < 500 万	0.8%
	M < 100 万	1.2%

3、赎回费率按照持有时间逐级递减。本基金赎回费率按持有期分档如下：

业务类型	持有期	费率
赎回	1 年以下	0.50%
	1 年 (含) 以上, 2 年以下	0.25%
	2 年 (含) 以上	0%



4、在不违背法律法规规定及基金合同约定的前提下，基金管理人可根据市场情况制定基金促销计划。基金促销计划可以针对以特定交易方式（如网上交易等）进行基金交易的投资者等定期或不定期地开展。在基金促销活动期间，按照相关监管部门要求履行相关手续后，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购费率、赎回费率。

5、基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

### （七） 申购份额与赎回金额的计算

#### 1、 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。注册登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算，计算公式如下：

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

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

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

申购费以四舍五入方式保留到小数点后两位。场内申购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给投资者；场外申购份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如，某投资者通过投资 5,000 元场外申购本基金，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,940.71 = 59.29 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 4,940.71 / 1.128 = 4,380.06 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5,000 元场外申购本基金份额，在基金合同生效时，投资者账户登记有本基金 4,380.06 份。

如果该投资者通过场内申购，将得到 4,380 份基金份额，0.06 份所对应的资金 0.07 元（4940.71 元 - 4380 份 \* 1.128 元/份 = 0.07 元）将退还投资者。

#### 2、 赎回金额的计算

投资者在赎回基金份额需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

赎回金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费 = 赎回份额 × T 日基金份额净值 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费

赎回费、赎回金额以四舍五入方式保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份基金份额一年后(未满 2 年)决定赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 = 10,000 × 1.148 = 11,480 元

赎回费用 = 11,480 × 0.25% = 28.70 元

净赎回金额 = 11,480 - 28.70 = 11,451.30 元

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金基金份额一年后(未满 2 年)赎回，假设赎回当日本基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,451.30 元。

### 3、 基金份额净值的计算公式

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

$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日基金资产净值} / T \text{ 日基金份额的余额数量}$

本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，由此产生的误差计入基金财产中。

## (八) 申购与赎回的注册登记

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

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

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

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

## (九) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 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现有基金份额持有人利益时。
5. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
6. 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利益的情形。
7. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4 项的暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

#### **（十） 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人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不能支付赎回款项。
2. 证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停赎回时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已成功确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不

得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

### （十一） 巨额赎回的情形及处理方式

#### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按基金份额持有人提交的每笔赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定该笔赎回申请当日部分确认的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

#### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方

法，同时在指定媒体上刊登公告。

**(十二) 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，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2. 重新开放申购或赎回时，基金管理人应于重新开放日，在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。

## 第九节 基金的转换

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决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，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，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 第十节 基金的非交易过户与转托管

### （一）非交易过户

基金的非交易过户是指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注册登记机构的规定办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

### （二）转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费

### （三）冻结与解冻

注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分所产生的权益按照法律法规以及国家有权机关的要求决定是否冻结。

## 第十一节 基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数。在正常市场情况下，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

### （二）投资方向和范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（包括中小板、创业板股票及其它经中国证监会核准上市的股票）、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、权证、股指期货、现金、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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

低碳经济是未来全球经济发展的重要方向，发展低碳经济给企业带来巨大的商机和广阔的发展前景。本基金以跟踪中证内地低碳经济主题指数为原则，采用被动式指数化投资实现跟踪偏离度与跟踪误差的最小化，使投资者以较低的成本获取与标的指数同步的收益，帮助投资者分享中国低碳经济发展的成果。

### （四）投资策略

本基金将采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以股指期货等金融衍生工具



进行投资管理，以便实现对跟踪误差的有效控制。

### （1）资产配置比例

本基金主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

### （2）股票投资组合构建

#### 1. 股票组合构建原则及方法

本基金股票资产投资采用完全复制标的指数的方法进行投资。通常情况下，本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。但在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- （a）法律法规的限制；
- （b）标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依据指数权重购买某成份股；
- （c）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；
- （d）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- （e）预期标的指数的成份股即将调整；
- （f）有充分而合理的理由认为其市场价格被操纵等。

为了减小跟踪误差，本基金按照同行业，相近市值，相关性高及  $\beta$  值相近等原则来选择替代股票。

#### 2. 股票组合调整

##### （a）定期调整

本基金股票组合将根据标的指数的编制规则、备选股票的预期及调整公告，

对股票投资组合及时进行调整。

(b) 不定期调整

i) 标的指数成份股日常跟踪

当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他原因而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

ii) 标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

iii) 申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3. 跟踪偏离的监控与管理

基金管理人将每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金与标的指数表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪方案。

(3) 债券资产的配置策略

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。债券投资上，本基金将坚持稳健投资的原则，采取“自上而下”的投资策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化等趋势，综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，选择合适的债券品种进行投资。

(4) 股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差，本基金可在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

#### (5) 跟踪误差控制策略

在本基金的管理中，基金管理人将每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案，从而有效控制和管理跟踪误差。

### (五) 投资决策

#### 1、决策依据

- (1) 投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- (2) 投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；
- (3) 投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

#### 2、决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

(1) 投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2) 投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金

进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资总监授权下, 根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标, 在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见, 进行投资组合的资产及行业配置; 之后, 在股票分析师设定的股票池内, 根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征, 构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 定量分析师负责完成内部基金业绩评估, 并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要, 对上述投资管理程序做出调整。

#### (六) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证内地低碳经济主题指数 $\times 95\%$  + 人民币税后活期存款利率 $\times 5\%$ 。

本基金是被动型投资的指数基金, 以紧密跟踪中证内地低碳经济主题指数为投资目标。

中证内地低碳经济主题指数是为了反映在中国内地上市的低碳经济类公司股票的整体走势, 从沪深 A 股中挑选日均总市值较高的 50 只低碳经济主题公司股票组成样本股, 基日为 2010 年 6 月 30 日, 基点为 1000 点。

低碳经济是指以低能耗、低污染、低排放为基础的经济模式, 包括了清洁能源发电(太阳能、风能、核能、水电、清洁煤等)、能源转换及存储(智能电网、电池等)、清洁生产及消费(能源效率等)、废物处理(水处理和垃圾处理)等投资主题。

中证内地低碳经济主题指数是以沪深 A 股为样本空间, 根据营业收入占比挑选出其中低碳经济主题股票, 再从其中挑选日均总市值较高的 50 只公司股票组成样本股。中证内地低碳经济主题指数每年定期调整两次, 调整时间分为每年 1 月和 7 月的第一个交易日, 特殊情况也作临时调整。

在编制方法上, 中证内地低碳经济主题指数采用了主流的市值加权方法, 具有较好的市场代表性; 另外还采用了分级靠档技术, 分级靠档技术的采用可以使在样本公司股本发生微小变动时保持用于指数计算的样本公司股本数的稳定, 可

以降低股本变动频繁带来跟踪投资成本，便于投资者进行跟踪投资。

如果中证内地低碳经济主题指数被上海证券交易所停止发布、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的情形下、或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，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，在取得基金托管人同意后，履行适当程序来变更基金的投资目标和投资范围，而无须召开基金份额持有人大会。

### （七）风险收益特征

本基金属于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的投资品种，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### （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) 本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 90%；

(2) 投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；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%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(5) 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%；

(6) 本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；

(7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(8) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证等；

(9) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(10) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(11) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(12) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(13) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价、新股申购、上市公司停牌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，基金管理人应当在可上市交易日起 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理

人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会及基金合同规定禁止的其他活动；

(9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

### (九) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，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) 投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 12 月 17 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至 2012 年 9 月 30 日（“报告期末”）。

#### 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	161,477,326.81	76.64
	其中：股票	161,477,326.81	76.64
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-

4	买入返售金融资产	38,000,000.00	18.03
	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	10,277,072.56	4.88
6	其他各项资产	947,017.15	0.45
7	合计	210,701,416.52	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	2,509,080.00	1.20
C	制造业	81,553,110.23	38.93
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	1,961,424.00	0.94
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	14,147,264.72	6.75
C6	金属、非金属	4,139,950.80	1.98
C7	机械、设备、仪表	60,758,878.71	29.00



C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	545,592.00	0.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	49,162,538.02	23.47
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	12,132,346.20	5.79
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	13,065,493.00	6.24
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,054,759.36	1.46
	合计	161,477,326.81	77.08

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 3.1 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

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	600900	长江电力	4,147,173	26,790,737.58	12.79
2	600406	国电南瑞	683,880	12,132,031.20	5.79
3	600089	特变电工	1,778,975	11,403,229.75	5.44
4	600703	三安光电	558,117	8,544,771.27	4.08
5	002202	金风科技	1,126,800	6,434,028.00	3.07
6	600875	东方电气	469,100	6,403,215.00	3.06

7	300070	碧水源	174,535	6,061,600.55	2.89
8	601727	上海电气	1,390,900	5,619,236.00	2.68
9	000826	桑德环境	229,001	5,599,074.45	2.67
10	600674	川投能源	754,600	5,206,740.00	2.49

3.2 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。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

(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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	21,470.13
2	应收证券清算款	889,549.41
3	应收股利	-
4	应收利息	27,302.03
5	应收申购款	8,695.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	947,017.15

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## (5) -a. 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600406	国电南瑞	12,132,031.20	5.79	重大资产重组

## (5) -b. 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 第十二节 基金的业绩

基金业绩截止日为 2012 年 9 月 30 日。

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。

### (一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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)	业绩比较基准标准差 (4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2012 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) - 2012 年 9 月 30 日	-9.70%	0.84%	-12.90%	1.20%	3.20%	-0.36%

### (二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:

(2012 年 5 月 25 日至 2012 年 9 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2012 年 5 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未  
满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。自 2012  
年 5 月 25 日基金合同生效日起至 2012 年 9 月 30 日，本基金运作时间未  
满 6 个

月，仍处于建仓期中。

## 第十三节 基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管及处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用。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。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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

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

## 第十四节 基金资产的估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金资产的价值。本基金份额的申购、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

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场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

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

### （四）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如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）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 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市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国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。

4、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。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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

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

### (五) 估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### (六) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1. 差错类型

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

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

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

#### 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任



责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则该当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，由责任方承担；但若经诉讼或仲裁的终局裁判，基金财产未获得补偿的部分可列入基金费用项下的相关科目，从基金资产中支付。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法, 需要修改基金注册登记机构交易数据的, 由基金注册登记机构进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1) 基金份额净值计算出现错误时, 基金管理人应当立即予以纠正, 通报基金托管人, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时, 基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

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

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定处理。如果行业有通行做法, 双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### **(七) 暂停估值的情形**

1. 基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时;
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变, 而基金管理人为保障投资人的利益, 决定延迟估值;
4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(八) 基金净值的确认**

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

#### **(九) 特殊情况的处理**

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因,或由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,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。

## 第十五节 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. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；
3. 本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；
4. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；同一基金账户在不同销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响；
5. 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）的时间不得超过 15 个工作日；
6. 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；
7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体上公告。

### (四) 收益分配方案

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

#### **(五) 收益分配的时间和程序**

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

2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定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. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 第十六节 基金的费用和税收

### (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. 基金的指数使用费；
4. 基金财产划拨支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 证券帐户开户费用、银行账户维护费用；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

### (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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 5 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. 基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提。通常情况下，指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元，费用从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

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

I 为基金管理人与本基金的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年费率。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

4. 除管理费、托管费及指数使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### (三) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### (四) 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根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

### (五) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第十七节 基金的会计与审计

### (一) 基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二) 基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，经通报基金托管人并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。



## 第十八节 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。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销售机构；
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）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。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，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的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。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

## **(二) 基金合同、托管协议**

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## **(三) 基金份额发售公告**

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## **(四) 基金合同生效公告**

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

## **(五) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告**

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

2. 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## **(六) 基金份额申购、赎回价格公告**

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

## **(七) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告**

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

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，

并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

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

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本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。

5. 基金定期报告应当按有关规定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。

### **(八) 临时报告与公告**

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

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；
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、增加或减少代销机构；
20. 基金更换注册登记机构；
21. 本基金开始办理申购、赎回；
22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### **(九) 投资流通受限证券公告**

基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### **(十) 澄清公告**

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

#### **(十一) 基金份额持有人大会决议**

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### **(十二) 中国证监会规定的其他信息**

在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策

和投资目标等。

### (十三)信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第十九节 风险揭示

### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1. 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，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。随着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，基金投资的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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能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的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。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。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5. 购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，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。

### （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、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

### （三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有

效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

#### （四）流动性风险

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资者的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

#### （五）操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，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甚至导致基金持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

#### （六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### （七）模型风险

指在估计资产价值、市场分析和风险估计中采用了错误的估计方法或选择了不恰当的模型而导致投资结果不确定风险。

#### （八）本基金特有的风险

本基金为股票型指数基金，投资标的为中证内地低碳经济主题指数，在基金的运营过程中可能面临本基金特有的风险：

##### 1. 指数基金投资风险

###### （1）标的指数的系统性风险

本基金为股票型基金，主要投资于中证内地低碳经济主题指数的成份股及其备选成份股，由于该指数成份股及备选股主要来自于清洁能源发电、能源转换及存储、清洁生产及消费、废物处理等投资板块，具有比较鲜明的特征和行业属性，

基金的投资将面临着这些板块特有的市场风险,以及由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。本基金采用被动的指数化投资策略,当指数下跌时,不会采取防守策略,由此可能对基金资产产生不利影响。

#### (2) 投资替代风险

因特殊情况(比如市场流动性不足,成份股被限制投资等原因)而导致本基金无法实现成份股比例配置时,基金管理人将可能采用其他方法进行适当的替代,由此可能对基金产生不利影响。

#### (3) 跟踪偏离风险

因为标的指数成份股调整、增发、配股、分红等,或者因为新股认购、基金现金资产拖累、基金交易成本和交易冲击以及基金费用的提取等原因,基金的收益水平相对于标的指数的回报率可能出现偏离,从而导致出现跟踪偏离风险。

#### (4) 标的指数变更风险

根据《基金合同》的规定,如果中证内地低碳经济主题指数被上海证券交易所停止发布、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的情形下,或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则,变更基金的投资目标和投资范围。基金的风险收益特征可能发生变化,投资者须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

### 2. 股指期货的投资风险

本基金若投资股指期货,面临以下特殊风险:

#### (1) 杠杆风险。

股指期货交易采用保证金交易方式,由于高杠杆特征,当出现不利行情时,股价指数微小的变动就可能会使本基金遭受较大损失。

#### (2) 到期日风险。

股指期货合约到期时,交易所将按照交割结算价将本基金的期货合约进行现金交割,届时本基金将无法继续持有到期合约。另外,期货交割日可能会出现期货合约与现货指数不完全收敛,或基差向不利方向变动,影响套保效率。

#### (3) 保证金追加风险。

在套保过程中,期货市场的不利变动可能会造成保证金不足,引发期货和现货的强行平仓,由于强行平仓价格的不确定性,会可能造成收益率的减小甚至



损失。在极端情况下，由于市场向不利方向运行，或保证金比例临时大幅提高，导致保证金不足、又未能在规定的时间内补足，本基金持有的期货合约可能因被强行平仓而遭受损失。

(4) 套保策略的风险。

由于市场上尚无与标的指数股指期货相匹配的标准现货产品，即使完全套保，由于交易成本的原因无法频繁调整期现的仓位、或期货部分被强行平仓或强行减仓、或在长期套保策略中期货部分无法滚动操作、或由于流动性不足导致市场冲击成本过大、或期现之间的相关性发生变动，均可能降低套保的效率。

(5) 强制平仓的风险。

如果市场走势对本基金持有的期货合约不利从而导致账户保证金不足时，期货公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知追加保证金，以使本基金能继续持有未平仓合约。如未于规定时间内存入所需保证金，本基金持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被强行平仓，导致套保策略失败，本基金必须承担由此导致的一切损失。

(6) 无法平仓的风险。

在市场剧烈变化的情况下，投资管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如市场达到涨跌停板或现货组合因停牌等情况无法卖出。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失，本基金必须承担由此导致的全部损失。

(7) 强行减仓的风险。

在极端情况下，本基金持有的期货合约可能被期货交易所强行减仓，从而使得本基金无法继续持有期货合约，从而导致套保失败。

(8) 政策变化的风险。

由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因导致未平仓合约可能无法继续持有从而导致损失。

(9) 客户资产保全的风险。

由于期货经纪公司内部控制不当，期货经纪公司本身可能面临巨大的风险，导致基金资产无法保全。

(10) 与交易相关的风险。

期货经纪公司的交易佣金比例、系统执行效率等都可能影响基金的收益率，投资管理人不承担相应责任。

(11) 交易系统的风险。

由于无法控制和不可预测的系统故障、设备故障、通讯故障、电力故障、网络故障及其它因素，可能导致交易系统非正常运行甚至瘫痪，使得交易指令出现延迟、中断、数据错误等情况；由于网上交易系统存在被网络黑客和计算机病毒攻击的可能性，由此可能导致交易系统故障，使交易无法进行及行情信息出现错误或延迟；互联网上的数据传输可能因通信繁忙等原因出现延迟、中断、数据错误或不完整，从而使网上交易出现延迟、中断。上述风险均可能导致基金资产发生损失。

(12) 模型风险。

由于套保模型错误，或波动性、相关性等参数计算错误，可能导致套保失败，从而给基金资产带来损失。

(13) 非可控因素导致的风险

例如：地震、水灾、火灾等不可抗力因素或者通讯系统故障等，可能造成指令无法成交或者无法全部成交从而导致损失。

**(九) 其他风险**

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

## 第二十章 基金的终止和清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

### （二）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

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

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

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

#### 2. 基金财产清算程序

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。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；

- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9) 公布基金财产清算结果;
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿:

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

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

### 5. 基金财产清算的公告

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

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十一节 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利与义务

#### (一) 基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

#### (二) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用并管理基金财产；
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 发售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率、管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
9. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11. 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
12. 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;
13. 依法召集基金份额持有人大会;
14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### (三) 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. 自基金合同生效之日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;
6. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作基金财产;
7. 依法接受基金托管人的监督;
8. 计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回价格;
9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
10. 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
12. 编制季度、半年度和年度基金报告;
13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定, 履行信息披露及报告义务;
14. 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、投资意向等, 除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不得向他人泄露;

15. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19. 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### (四) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；
3. 自本基金合同生效日起，依法保管基金资产；
4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金

合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6. 依法召集基金份额持有人大会；
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (五) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

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. 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；
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7. 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人



依法召集基金份额持有人大会；

17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19. 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. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23. 建立并保存基金份额持有人名册；

24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### (六) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益；

2. 参与分配清算后的剩余基金财产；

3. 依法申请赎回其持有的基金份额；

4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7. 监督基金管理人的投资运作；

8. 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (七) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

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

(八) 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) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成, 基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

### (二) 召开事由

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

- (1) 终止基金合同;
- (2) 转换基金运作方式;
- (3) 变更基金类别;
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
- (5) 变更基金份额持有人大会程序;
- (6) 更换基金管理人、基金托管人;
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;
- (8) 本基金与其他基金的合并;
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的, 可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合

同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

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

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

3. 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4. 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(四) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(五) 基金份额持有人出席会议的方式

1. 会议方式

- (1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法

规和监管机关允许的其他方式。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定。

## 2. 召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

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

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

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，监督人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具书面意见和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；

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

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

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## (六) 议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(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：

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

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

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次

提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

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

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会做出的决议的效力。

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

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%

(含本数)以上通过方为有效,除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

## (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

4. 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## (八) 计票

### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选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,由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主



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

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第(二)条所规定的第(1)-(8)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第(二)条所规定的第(9)、(10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 三、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. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；
3. 本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；
4. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；同一基金账户在不同销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响；
5. 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）的时间不得超过 15 个工作日；
6. 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；
7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体上公告。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；
2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定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. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定

#### 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. 基金的指数使用费；
4. 基金财产划拨支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 证券帐户开户费用、银行账户维护费用；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

##### (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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

###### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 5 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. 基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提。通常情况下，指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元，费用从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

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

I 为基金管理人与本基金的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率。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

4. 除管理费、托管费及指数使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### (三) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(四) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

#### (五) 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。

## 五、基金财产的投资方向与投资限制

### (一) 投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（包括中小板、创业板股票及其它经中国证监会核准上市的股票）、新股（含首次公开发行和增发）、债券、

债券回购、权证、股指期货、现金、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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。

## （二）投资禁止行为与限制

### 1. 组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 90%；

（2）投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；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%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）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%；

（6）本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；

（7）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

（8）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证等；

（9）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(10) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(11) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(12) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(13) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价、新股申购、上市公司停牌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，基金管理人应当在可上市交易日起 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会及基金合同规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制

## 六、基金资产的估值

### (一) 估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如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) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价

值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 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市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国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。

4、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。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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

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

## (二) 估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，



由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### (三) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

## 七、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. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起2日内在指定媒体公告。

## (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

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

## (三) 基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

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

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

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

### 2. 基金财产清算程序

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。基金财产清算程序主要包括:

- (1) 基金合同终止后,发布基金财产清算公告;
- (2) 基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;
- (3) 对基金财产进行清理和确认;
- (4) 对基金财产进行估价和变现;

- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9) 公布基金财产清算结果;
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5. 基金财产清算的公告

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

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 八、争议的处理和适用的法律

对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

#### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 第二十二节 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

邮政编码：200120

法定代表人：邵国有

成立日期：2003 年 4 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]48 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

#### (二) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；

办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（包括中小板、创业板股票及其它经中国证监会核准上市的股票）、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、权证、股指期货、现金、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前1个工作日内书面告知基金托管人。基金管理人与基金托管人完成确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动

性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

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

(七)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

(八)基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九)若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、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,由此造成的损失由基金管理人承担。

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

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金



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

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一个工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### 四、基金财产的保管

##### (一) 基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用)。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金

管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间，基金募集的资金应存于“基金募集专户”，该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集到的基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金托管账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

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

#### （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不

得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

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

4. 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开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人

保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额所得数值，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。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （二）基金份额净值错误的处理方式

（1）当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通告基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明,基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对投资人或基金支付赔偿金,就实际向投资人或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

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

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

(3) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误,基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

(5) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的,从其规定。如果行业另有通行做法,双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

### (三) 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地

设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （四）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

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

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

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

###### （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（五）基金管理人应在编制季度报告、半年度报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括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由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

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

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

(3) 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

## 2. 基金财产清算程序

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。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

## 3. 清算费用

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

## 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结



果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十三节 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。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送服务

基金管理人负责向通过基金管理人的直销中心认购或申购本基金的基金份额持有人寄送相关资料，基金代销机构将负责向通过其代销网点认购或申购本基金的基金份额持有人寄送相关资料。

#### 1. 投资者对账单

基金投资者对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单在每季结束后的 15 个工作日内向有交易的持有人以书面或电子文件形式寄送，年度对账单由注册登记人在每年度结束后 20 个工作日内对所有持有人以书面或电子文件形式寄送。

#### 2. 其他相关的信息资料

介绍国内外金融市场动态、投资机会和投资产品等。

### （二）红利再投资服务

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金，注册登记人将基金份额持有人所获现金红利按除权日经除权后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）基金间转换服务

投资者可在基金管理人管理的不同开放式基金间转换基金份额。

### （四）定期定额计划

定期定额计划包含定期定额申购（或称定期定额投资）和定期定额赎回，基金管理人利用直销网点或代销网点为投资者提供定期定额计划的服务。通过定期定额计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购或定期定额赎回基金份额。定期定额计划的有关规则详见基金管理人公告。

### （五）在线服务

基金管理人利用自己的网站为基金投资者提供与基金经理（或投资顾问）的

定期在线交流服务；基金管理人还提供网上交易服务，具体操作详见网上交易业务规则。

#### **（六） 咨讯服务**

投资者如果想了解申购和赎回等交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，请拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或登录公司网站进行咨询、查询。

##### **1. 客户服务电话**

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

传真：021-50479997

##### **2. 互联网站**

公司网址：<http://www.hftfund.com>

电子信箱：[info@hftfund.com](mailto:info@hftfund.com)

#### **（七） 投诉受理**

投资者可以拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或致函，投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

#### **（八） 网上开户与交易服务**

基金管理人已开通网上交易平台，投资者可登陆海富通基金网站（[www.hftfund.com](http://www.hftfund.com)）实现网上开户和交易（包括认购、申购、定期定额计划、转换、赎回等），并获得申购费率和部分转换费率优惠。海富通网上交易支持工商银行、农业银行、建设银行、兴业银行、浦发银行、中信银行等银行的借记卡及天天盈、支付宝账户，具体的费率优惠标准请参见相关公告。基金管理人将依据业务发展状况，逐步增加网上交易支持的银行卡种，并以公告形式告知投资者。

## 第二十四节 其他披露事项

### （一）基金注册登记机构

#### 1. 委托与更换程序

基金管理人委托中国证监会认定的机构办理本基金的注册登记业务。基金管理人委托上述机构办理登记业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资者基金账户管理、基金份额登记过户、基金清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

注册登记机构的更换程序：

（1）提名：由基金管理人提名。

（2）核准：新任注册登记机构报中国证监会审查资格并核准后，原任注册登记机构方可退任。

（3）公告：基金注册登记机构更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（4）交接：原基金注册登记机构应做出处理基金注册登记事务的报告，并与新任基金注册登记机构完成业务移交手续，向新任基金注册登记机构提交完整的书面材料和电子数据；新任基金注册登记机构与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金注册登记机构仍有义务保留本基金正式移交日之前的注册登记业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金注册登记机构处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金注册登记机构业务移交产生的问题，原基金注册登记机构仍有协助解决之义务。

2.基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的注册登记业务。

#### 3.基金注册登记机构概况

基金注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：金颖

注册资本：6 亿元

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证券监督管理委员会批准，在国家工商行政管理局注册登记的中国唯一的证券登记结算机构。由上海证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

- (1) 证券账户和结算账户的设立和管理；
- (2) 证券登记与过户；
- (3) 证券托管与转托管；
- (4) 证券和资金的清算与交收；
- (5) 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- (6) 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

## 第二十五节 基金管理人和基金托管人的更换

### (一)基金管理人的更换

#### 1.基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，基金管理人职责终止：

- (1)基金管理人被依法取消基金管理资格；
- (2)基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- (3)基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 2.基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

(1)提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金总份额10%以上的基金份额持有人提名；

(2)决议：基金份额持有人大会在原任基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3)核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4)交接：原任基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值；

(5)审计：原任基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；

(6)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后2日内公告；

(7)基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

## (二)基金托管人的更换

### 1.基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- (1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 2. 基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在原任基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3) 核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4) 交接：原任基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时与新任基金托管人或临时基金托管人办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值；

(5) 审计：原任基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；

(6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在新任基金托管人获得中国证监会核准后 2 日内公告。

## (三)基金管理人与基金托管人同时更换

1. 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

2. 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3. 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管

人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上联合公告。

**(四)** 新任基金管理人接收基金管理业务或新任基金托管人接收基金托管业务前，原任基金管理人或原任基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。



## 第二十六节 招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理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。投资者也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。上述备查的文件其内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十七节 备查文件

本招募说明书的备查文件包括：

- （一）中国证监会批准海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金设立的文件
- （二）《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》
- （三）《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金托管协议》
- （四）注册登记协议
- （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）海富通基金管理有限公司募集设立海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金的法律意见书
- （八）《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。