

# 嘉实优化红利股票型证券投资基金 更新招募说明书

(2014年第1号)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

(一) 嘉实优化红利股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2012年5月22日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实优化红利股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2012】684号）和2012年5月24日《关于嘉实优化红利股票型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2012】348号）的核准进行募集。本基金基金合同于2012年6月26日起生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。本基金类型为契约型开放式，根据本基金的投资目标和投资范围，本基金属于股票型证券投资基金。

(二) 本招募说明书是对原《嘉实优化红利股票型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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

(四) 本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、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。本基金为股票型基金，本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金

及货币市场基金。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

（五）基金的过往业绩并不预示其未来表现。

（六）投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

（七）本招募说明书所载内容截止日为2014年6月26日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2014年3月31日(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 .....	15
五、相关服务机构 .....	16
六、基金的募集 .....	35
七、基金合同的生效 .....	36
八、基金份额的申购、赎回 .....	37
九、基金转换 .....	45
十、基金的转托管、定期定额投资计划、非交易过户、冻结与解冻.....	51
十一、基金的投资 .....	52
十二、基金的业绩 .....	61
十三、基金的财产 .....	63
十四、基金资产估值 .....	63
十五、基金收益与分配 .....	68
十六、基金的费用与税收 .....	69
十七、基金的会计与审计 .....	71
十八、基金的信息披露 .....	72
十九、风险揭示 .....	76
二十、基金合同的变更、终止与基金资产的清算.....	79
二十一、基金合同内容摘要 .....	81
二十二、基金托管协议的内容摘要 .....	104
二十三、对基金份额持有人的服务 .....	116
二十四、其他应披露事项 .....	117
二十五、招募说明书存放及查阅方式 .....	118
二十六、备查文件 .....	118

## 一、绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《嘉实优化红利股票型证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 二、释义

本《招募说明书》中，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

词语或简称	含义
基金或本基金	指嘉实优化红利股票型证券投资基金
基金管理人	指嘉实基金管理有限公司
基金托管人	指中国银行股份有限公司
基金合同或本基金合同	指《嘉实优化红利股票型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的有效修订和补充
托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实优化红利股票型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
招募说明书	指《嘉实优化红利股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
基金份额发售公告	指《嘉实优化红利股票型证券投资基金基金份额发售公告》
法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《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
《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
《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
中国证监会	指中国证券监督管理委员会

银行业监督管理机构	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
基金合同当事人	指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
机构投资者	指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法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
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
基金份额持有人	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
基金销售业务	指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。
销售机构	指嘉实基金公司以及符合《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协议,代为办理基金销售业务的机构
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和办理非交易过户等
登记机构	指办理登记业务的机构。基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
基金账户	指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
基金交易账户	指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户
基金合同生效日	指基金募集达到法律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

基金合同终止日	指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
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
存续期	指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、深圳证券交易所的正常交易日
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开放日
T+n日	指自T日起第n个工作日(不包含T日)
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
开放时间	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
《业务规则》	指《嘉实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登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
认购	指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
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
赎回	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
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其他基金基金份额的行为
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操作
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、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
累计定投期数	指投资者在开放期内通过基金管理人直销“定期定额投资”的方式，在同一定额投资计划下以等额扣款的方式申购本基金

	的累计成功扣款期数。对于募集期间曾成功认购本基金的投资者,在距离本基金合同生效日一年之内的开放期内通过基金管理人直销“定期定额投资”的方式在同一定额投资计划下以等额扣款的方式申购本基金时,在累计定投期数计算时将认购行为视为第1期“定期定额投资”
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)超过上一开放日基金总份额的10%
元	指人民币元
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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
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
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	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
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
货币市场工具	指现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;期限在一年以内(含一年)的债券回购;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具
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
不可抗力	指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件



### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人基本情况

##### 1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	安奎
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、福州、南京、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

##### 2. 管理基金情况

截止2014年7月25日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、62只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、

嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

安奎先生，董事长，大学本科，中共党员，曾任吉林农业机械研究所主任；吉林省信托投资公司外经处处长、香港吉信有限公司总经理；吉林省证券公司总经理；东北证券有限责任公司监事长；吉林天信投资公司总经理；中诚信托有限责任公司副总经理。2011 年 8 月 5 日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理，中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000 年 10 月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长，外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996 年 9 月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理、副总裁，现任中诚信托有限责任公司副总裁。

Bernd Amlung 先生，董事，德国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士。自 1989 年起加入德意志银行以来，曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司（Deutsche Asset & Wealth Management, London）全球战略与业务发展部负责人，MD。

Mark Cullen 先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD。

韩家乐先生，董事，1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士。清华大学商法研究中心副主任、清华大学法学院副教授，担任中国证券法学研究会常务理事、中国商法学研究会理事、北京市经济法学学会常务理事、中国法学会检察学研究会金融检察专业委员会委员。曾任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现任上海证券交易所第三届上市委员会委员。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限责任公司财务总监。

王利刚先生，监事，经济学学士。2001年2月至今，就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部，历任人力资源部副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

张峰先生，副总经理，中共党员、硕士。曾就职于国家计委，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大大不列颠哥伦比亚大学 MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

翟琳琳女士，硕士研究生，8年证券从业经历。2005年7月加入嘉实基金，先后担任过金属与非金属行业分析师、基金经理助理职务，具有基金从业资格。2014年2月11日至今任嘉实回报混合基金经理。2014年2月7日至今任本基金基金经理。

### (2) 历任基金经理

2013年7月20日起至2014年7月23日，赵勇先生任本基金基金经理。

2012年6月26日起至2013年7月20日，郭志喜先生任本基金基金经理。

## 3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司总经理助理兼公司首席投资官（股票业务）邵健先生，公司总经理赵学军先生，公司研究部总监陈勤先生，资深基金经理邹唯先生、张弢先生，定量投资部负责人张自力先生。

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1、基金管理人严格遵守法律法规和基金合同的规定，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《证券法》的行为，并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。

3、基金管理人不得从事违反《证券投资基金法》及其他有关法律法规规定的行为，并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）基金之间相互投资；
- （2）基金管理人以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- （3）基金管理人从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其他证券自营业务；
- （4）基金管理人从事资金拆借业务；
- （5）动用银行信贷资金从事基金投资；
- （6）将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- （7）从事证券信用交易；
- （8）以基金资产进行房地产投资；
- （9）从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- （10）将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
- （11）中国证监会或有关法律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、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- （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、人员的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 除为公司进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- (9) 协助、接收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；
- (11) 以不正当手段谋求业务发展；
- (12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (13) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (14) 将其固有财产或他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (15) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (16) 向基金份额持有人违规承诺收益或承担损失；
- (17) 其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、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) 基金管理人内部控制制度**

#### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本公司建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。内部控制制度是公司

为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。它由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

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,是对各项基本管理制度的总揽和指导,包括内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。公司基本管理制度包括内部会计控制制度、风险管理控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。部门业务规章是在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、操作守则等进行了具体规定。

## 2. 内部控制的原则

(1) 健全性原则: 内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节;

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

(3) 独立性原则: 公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立;

(4) 相互制约原则: 组织结构体现职责明确、相互制约的原则,各部门有明确的授权分工,操作相互独立。

(5) 成本效益原则: 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。

## 3、内部控制组织体系

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会,负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况,充分发挥独立董事监督职能,保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 股票投资决策委员会由公司总经理、总经理助理、总监及资深基金经理组成,负责指导权益类基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3) 风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构,由公司总经理、督察长以及部门总监组成,负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险,并提出防范化解措施。

(4) 督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核,定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5) 监察稽核部: 公司管理层重视和支持监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和权威性,配备了充足合格的监察稽核人员,明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流

程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6) 业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

(7) 岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

#### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

(1) 公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。



④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制,对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度,基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作,分别核算,及时、准确和完整地反映基金财产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度,明确划分各岗位职责,投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统,严格信息管理,保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通,建立清晰的报告系统,各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准,加强基金销售管理,规范基金宣传推介,不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施,建立危机处理机制和程序,对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件,按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度,督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督,保证内部控制制度落实;定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细,按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查,确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点,界定风险责任人,设计内部风险点自我评估表,对风险点进行评估和分析,并由监察稽核部监督风险控制措施的执行,及时防范和化解风险。

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为,在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时,向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、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控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：(010) 66594942

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2014年6月30日，中国银行已托管276只证券投资基金，其中境内基金251只，QDII基金25只，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

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉

承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，包括风险识别，风险评估，工作程序设计与制度建设，风险检视，工作程序与制度的执行，工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2013年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （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）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	赵虹		

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023

联系人	鲍东华
-----	-----

## (3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段 86 号城市之心 30H		
电话	(028) 86202100	传真	(028) 86202100
联系人	王启明		

## (4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场 T1-1202		
电话	(0755) 25870686	传真	(0755) 25870663
联系人	周炜		

## (5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路 10 号颐和国际大厦 A 座 3502 室		
电话	(0532) 6677766	传真	(0532) 66777676
联系人	陈建林		

## (6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 313 室		
电话	(0571) 87759328	传真	(0571) 87759331
联系人	章文雷		

## (7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元		
电话	(0591) 88013673	传真	(0591) 88013670
联系人	吴志锋		

## (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室		
电话	(025) 66671118	传真	(025) 66671100
联系人	徐莉莉		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 2415-2416 室		
电话	(020) 87555163	传真	(020) 81552120
联系人	庄文胜		

## 2、代销机构

## (1) 中国银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼		
注册地址	北京市西城区复兴门内大街1号		
法定代表人	田国立		
电话	(010) 66596688	传真	(010) 66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

## (2) 中国农业银行股份有限公司

住所、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	联系人	滕涛
电话	(010) 85108227	传真	(010) 85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

## (3) 中国工商银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街55号		
法定代表人	姜建清	联系人	陶仲伟
电话	010-66105662	传真	010-66107914
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

## (4) 招商银行股份有限公司

住所、办公地址	深圳市深南大道7088号招商银行大厦		
法定代表人	傅育宁	联系人	邓炯鹏
电话	(0755) 83198888	传真	(0755) 83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

## (5) 交通银行股份有限公司

办公地址	上海市银城中路188号		
注册地址	上海市银城中路188号		
法定代表人	牛锡明	联系人	曹榕
电话	021-58781234	传真	021-58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

## (6) 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址	上海市中山东一路 12 号		
注册地址	上海市中山东一路 12 号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	高天、虞谷云
电话	(021) 61618888	传真	(021) 63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

## (7) 中国民生银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街 2 号		
法定代表人	董文标	联系人	杨成茜
电话	(010) 58560666	传真	(010) 57092611
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

## (8) 中信银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座		
法定代表人	常振明	联系人	廉赵峰
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

## (9) 青岛银行股份有限公司

住所、办公地址	青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦		
法定代表人	郭少泉	联系人	于庆君
电话	68602127	传真	85709799
网址	www.qdccb.com	客服电话	96588 (青岛)、 4006696588 (全国)

## (10) 徽商银行股份有限公司

住所、办公地址	安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座		
法定代表人	李宏鸣	联系人	叶卓伟
电话	(0551) 62667635	传真	(0551) 62667684
网址	www.hsbank.com.cn	客服电话	4008896588

## (11) 临商银行股份有限公司

住所、办公地址	山东省临沂市沂蒙路 336 号		
法定代表人	王傢玉	联系人	寇廷柱
电话	(0539) 8304657	传真	(0539) 8051127
网址	www.lsbchina.com	客服电话	400-699-6588

## (12) 杭州银行股份有限公司

住所、办公地址	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦		
法定代表人	吴太普	联系人	严峻
电话	(0571) 85108309	传真	(0571) 85108309
网址	www.hzbank.com.cn	客服电话	400-888-8508

## (13) 上海农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址	上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼		
法定代表人	胡平西	联系人	吴海平
电话	(021) 38576977	传真	(021) 50105124
网址	www.srcb.com	客服电话	(021) 962999

## (14) 浙商银行股份有限公司

住所、办公地址	浙江省杭州市庆春路 288 号		
法定代表人	张达洋	联系人	毛真海
电话	(0571) 87659546	传真	(0571) 87659188
网址	www.czbank.com	客服电话	95527

## (15) 渤海银行股份有限公司

住所、办公地址	天津市河西区马场道 201-205 号		
法定代表人	刘宝凤	联系人	王宏
电话	(022) 58316666	传真	(022) 58316569
网址	www.cbhb.com.cn	客服电话	400-888-8811

## (16) 洛阳银行股份有限公司

住所、办公地址	洛阳市洛龙区开元大道 256 号		
法定代表人	王建甫	联系人	董鹏程
电话	(0379) 65921977	传真	(0379) 65921869
网址	www.bankofluoyang.com.cn	客服电话	(0379) 96699

## (17) 深圳农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦		
法定代表人	李伟	联系人	王璇
电话	0755-25188269	传真	0755-25188785
网址	www.4001961200.com	客服电话	961200 (深圳) 4001961200 (全国)

## (18) 北京农村商业银行股份有限公司

办公地址	北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦		
注册地址	北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦		
法定代表人	王金山	联系人	王薇娜
电话	(010) 85605006	传真	(010) 85605345
网址	www.bjrcb.com	客服电话	96198

**(19) 烟台银行股份有限公司**

住所、办公地址	山东省烟台市芝罘区海港路 25 号		
法定代表人	叶文君	联系人	王淑华
电话	0535-6699660	传真	0535-6699884
网址	www.yantaibank.net	客服电话	4008-311-777

**(20) 哈尔滨银行股份有限公司**

住所、办公地址	哈尔滨市道里区尚志大街 160 号		
法定代表人	郭志文	联系人	王超
电话	0451-86779007	传真	0451-86779218
网址	www.hrbb.com.cn	客服电话	95537

**(21) 河北银行股份有限公司**

住所、办公地址	石家庄市平安北大街 28 号		
法定代表人	乔志强	联系人	王娟
电话	0311-88627587	传真	0311-88627027
网址	www.hebbank.com	客服电话	4006129999

**(22) 包商银行股份有限公司**

住所、办公地址	内蒙古包头市钢铁大街 6 号		
法定代表人	李镇西	联系人	张晶 刘芳
电话	(0472) 5109729	传真	(0472) 5176541
网址	http://www.bsb.com.cn	客服电话	0472-96016 010-96016 0574-967210 0755-967210 028-65558555

**(23) 嘉实财富管理有限公司**



住所	上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层		
法定代表人	赵学军	联系人	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	www.harvestwm.cn	客服电话	400-021-8850

**(24) 杭州联合农村商业银行股份有限公司**

住所、办公地址	杭州市建国中路99号杭州联合银行大楼		
法定代表人	张晨	联系人	胡莹
电话	0571—87923324	传真	0571—87923214
网址	www.urcb.com	客服电话	96592

**(25) 万银财富（北京）基金销售有限公司**

办公地址	北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元		
注册地址	北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元		
法定代表人	李招弟	联系人	高晓芳
电话	010-59393923	传真	010-59393074
网址	www.wy-fund.com	客服电话	400-808-0069

**(26) 上海好买基金销售有限公司**

办公地址	上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室		
注册地址	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	联系人	张茹
电话	021-20613999	传真	021-68596916
网址	www.ehowbuy.com	客服电话	4007009665

**(27) 上海天天基金销售有限责任公司**

办公地址	上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼		
注册地址	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层		
法定代表人	其实	联系人	潘世友
电话	021-54509998	传真	021-64385308
网址	http://www.1234567.com.cn/	客服电话	400-1818-188

**(28) 杭州数米基金销售有限公司**

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		
注册地址	杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号		
法定代表人	陈柏青	联系人	张裕
电话	021-60897840	传真	0571-26697013
网址	http://www.fund123.cn/		客服电话 4000-766-123

**(29) 上海长量基金销售投资顾问有限公司**

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		
注册地址	上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室		
法定代表人	张跃伟	联系人	单丙焯
电话	021-20691869	传真	021-20691861
网址	www.erichfund.com	客服电话	400-089-1289

**(30) 苏州银行股份有限公司**

办公地址	江苏省苏州市钟园路 728 号		
注册地址	江苏省苏州市东吴北路 143 号		
法定代表人	王兰凤	联系人	熊志强
电话	0512-69868390	传真	0512-69868370
网址	www.suzhoubank.com	客服电话	0512-96067

**(31) 和讯信息科技有限公司**

办公地址	北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层		
注册地址	北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层		
法定代表人	王莉	联系人	习甜
传真	021-20835879		
网址	http://fund.licaik.com/		客服电话 4009200022

**(32) 浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司**

办公地址	浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号		
注册地址	浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号		
法定代表人	俞俊海	联系人	孔张海
电话	0575-84788101	传真	0575-84788100
网址	www.borf.cn	客服电话	4008896596

**(33) 中信证券股份有限公司**

住所、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	联系人	陈忠
电话	(010) 60833722	传真	(010) 60833739
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

**(34) 广发证券股份有限公司**

住所	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 18、19、36、38、41 和 42 楼		
法定代表人	孙树明	联系人	黄岚
电话	(020) 87555888	传真	(020) 87555305
网址	www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点

**(35) 中信建投证券股份有限公司**

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

**(36) 海通证券股份有限公司**

住所	上海淮海中路 98 号		
办公地址	上海市广东路 689 号		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021) 23219000	传真	(021) 23219100
网址	www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

**(37) 申银万国证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市常熟路 171 号		
法定代表人	储晓明	联系人	李清怡
电话	(021) 54033888	传真	(021) 54030294
网址	www.sywg.com	客服电话	(021) 962505

**(38) 国泰君安证券股份有限公司**

住所	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	联系人	芮敏祺
电话	(021) 38676666	传真	(021) 38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

**(39) 中国银河证券股份有限公司**

住所、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	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

**(40) 招商证券股份有限公司**

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
法定代表人	宫少林	联系人	林生迎
电话	(0755) 82943666	传真	(0755) 82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008888111、95565

**(41) 华泰证券股份有限公司**

住所	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦、深圳市深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼		
办公地址	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦、深圳市深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼		
法定代表人	吴万善	联系人	庞晓芸
电话	0755-82492193	传真	025-51863323 (南京) 0755-82492962 (深圳)
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

**(42) 长城证券有限责任公司**

住所、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	刘阳
电话	(0755) 83516289	传真	(0755) 83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006668888、(0755) 33680000

**(43) 国都证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	(010) 84183389	传真	(010)84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

**(44) 华福证券有限责任公司**

住所	福州市五四路157号新天地大厦7、8层		
办公地址	福州市五四路157号新天地大厦7至10层		
法定代表人	黄金琳	联系人	张腾
电话	(0591) 87383623	传真	(0591) 87383610
网址	www.hfzq.com.cn	客服电话	(0591) 96326

**(45) 光大证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市静安区新闻路1508号		
法定代表人	薛峰	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788 、 10108998

**(46) 渤海证券股份有限公司**

住所	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
办公地址	天津市南开区滨水西道8号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	(022) 28451861	传真	(022) 28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

**(47) 安信证券股份有限公司**

住所	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02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凤凰大厦1栋9层		
法定代表人	牛冠兴	联系人	陈剑虹
电话	(0755) 82825551	传真	(0755) 82558355
网址	www.essence.com.cn	客服电话	4008001001

**(48) 东北证券股份有限公司**

住所、办公地址	长春市自由大路 1138 号		
法定代表人	杨树财	联系人	潘锴
电话	(0431) 85096709	传真	(0431) 85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	4006000686、(0431) 85096733

**(49) 平安证券有限责任公司**

住所	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 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 (518048)		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	(0755) 82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511—8

**(50) 中国中投证券有限责任公司**

住所	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元		
办公地址	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层		
法定代表人	龙增来	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

**(51) 湘财证券股份有限公司**

住所、办公地址	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼		
法定代表人	林俊波	联系人	钟康莺
电话	(021) 68634518	传真	(021) 68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

**(52) 中银国际证券有限责任公司**

住所	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	联系人	李丹
传真	(021) 50372474		
网址	www.bocichina.com.cn	客服电话	4006208888

**(53) 德邦证券有限责任公司**

住所	上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼		
办公地址	上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼		
法定代表人	姚文平	联系人	罗芳
电话	(021) 68761616	传真	(021) 68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

**(54) 财富证券有限责任公司**

住所、办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼		
法定代表人	周晖	联系人	郭磊
电话	(0731) 84403319	传真	(0731) 84403439
网址	www.cfzq.com	客服电话	(0731) 84403360

**(55) 中信证券（山东）有限责任公司**

住所、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		
法定代表人	杨宝林	联系人	吴忠超
电话	(0532) 85022326	传真	(0532) 85022605
网址	www.citicssd.com	客服电话	95548

**(56) 中航证券有限公司**

住所、办公地址	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	联系人	戴蕾
电话	(0791) 86768681	传真	(0791) 86770178
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

**(57) 中信证券（浙江）有限责任公司**

住所、办公地址	浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层		
注册地址	浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层		
法定代表人	沈强	联系人	王霏霏
电话	0571-85783737	传真	0571-85106383
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571) 95548

**(58) 长江证券股份有限公司**

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦		
法定代表人	杨泽柱	联系人	李良
电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
网址	www.95579.com	客服电话	95579 或 4008-888-999

**(59) 国盛证券有限责任公司**

住所	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦		
办公地址	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼		
法定代表人	曾小普	联系人	徐美云
电话	(0791) 86285337	传真	(0791) 86282293
网址	www.gsstock.com	客服电话	4008222111

**(60) 山西证券股份有限公司**

住所、办公地址	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
电话	(0351) 8686659	传真	(0351) 8686619
网址	www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

**(61) 西部证券股份有限公司**

住所、办公地址	陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼		
法定代表人	刘建武	联系人	刘莹
电话	(029) 87416787	传真	(029) 87417012
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

**(62) 广州证券有限责任公司**

住所、办公地址	广州市天河区珠江新城珠江江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼		
法定代表人	刘东	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020) 961303

**(63) 东吴证券股份有限公司**

住所、办公地址	苏州工业园区翠园路 181 号		
法定代表人	吴永敏	联系人	方晓丹
电话	(0512) 65581136	传真	(0512) 65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	4008601555

**(64) 南京证券股份有限公司**

住所、办公地址	江苏省南京市大钟亭 8 号		
法定代表人	步国旬	联系人	潘月
电话	(025) 83367888	传真	(025) 83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

**(65) 恒泰证券股份有限公司**



住所、办公地址	内蒙古呼和浩特市新城区新华大街 111 号		
法定代表人	庞介民	联系人	王旭华
电话	(010) 66297386	传真	(0471) 4961259
网址	www.cnht.com.cn	客服电话	(0471) 4972343

**(66) 东海证券股份有限公司**

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层		
法定代表人	刘化军	联系人	王一彦
电话	(021) 20333910	传真	(021) 50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531; 400-888-8588

**(67) 东方证券股份有限公司**

住所	上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层		
办公地址	上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	吴宇
电话	(021) 63325888	传真	(021) 63326173
网址	www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

**(68) 第一创业证券股份有限公司**

住所、办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层		
法定代表人	刘学民	联系人	崔国良
电话	(0755) 25832852	传真	(0755) 82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

**(69) 宏源证券股份有限公司**

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街 19 号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010) 88085858	传真	(010) 88085195
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

**(70) 民生证券股份有限公司**

住所、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	联系人	赵明
电话	(010) 85127622	传真	(010) 85127917
网址	www.msizq.com	客服电话	400-619-8888

**(71) 新时代证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501		
法定代表人	刘汝军	联系人	孙恺
电话	(010) 83561149	传真	(010) 83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

## (72) 上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市西藏中路 336 号		
法定代表人	郁忠民	联系人	张瑾
电话	(021) 53519888	传真	(021) 53519888
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518 、 4008918918

## (73) 世纪证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层		
法定代表人	卢长才	联系人	方文
电话	(0755) 83199599	传真	(0755) 83199545
网址	www.csc.com.cn	客服电话	(0755) 83199511

## (74) 中原证券股份有限公司

住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路 10 号		
法定代表人	菅明军	联系人	程月艳
电话	0371-65585670	传真	0371-65585665
网址	www.ccnew.com	客服电话	0371-967218 、 4008139666

## (75) 国金证券股份有限公司

住所、办公地址	成都市东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	(028) 86690126	传真	(028) 86690126
网址	www.gjzq.com.cn	客服电话	4006600109

## (76) 齐鲁证券有限公司

住所、办公地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531) 68889155	传真	(0531) 68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

## (77) 大同证券经纪有限责任公司

住所	大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层		
办公地址	山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351) 4130322	传真	(0351) 4130322
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

**(78) 瑞银证券有限责任公司**

住所、办公地址	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	程宜荪	联系人	牟冲
电话	(010) 58328112	传真	(010) 58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

**(79) 华鑫证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元		
法定代表人	洪家新	联系人	孔泉
电话	(0755) 82083788	传真	(0755) 82083408
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	(021) 32109999 , (029) 68918888

**(80) 中山证券有限责任公司**

住所、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	联系人	李珍
电话	(0755) 82570586	传真	(0755) 82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011

**(81) 中国国际金融有限公司**

住所	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
办公地址	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层		
法定代表人	李剑阁	联系人	廉赵峰
电话	(010) 65051166	传真	(010) 85679535
网址	www.ciccs.com.cn	客服电话	(010) 85679238 ; (010) 85679169

**(82) 天相投资顾问有限公司**

办公地址	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层 邮编: 100088		
注册地址	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编: 100032		
法定代表人	林义相	联系人	尹伶
电话	010-66045529	传真	010-66045518
网址	http://www.jjm.com.cn http://www.txsec.com	客服电话	010-66045678

**(83) 江海证券有限公司**

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
注册地址	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	张背北
电话	0451-85863696	传真	0451-82287211
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

**(84) 厦门证券有限公司**

住所、办公地址	厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼		
法定代表人	傅毅辉	联系人	卢金文
电话	(0592) 5161642	传真	(0592) 5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	(0592) 5163588

**(85) 爱建证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼		
法定代表人	宫龙云	联系人	陈敏
电话	(021) 32229888	传真	021- 68728782
网址	www.ajzq.com	客服电话	(021) 63340678

**(86) 华宝证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

**(87) 日信证券有限责任公司**

住所	呼和浩特市新城区锡林南路 18 号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层		
法定代表人	孔佑杰	联系人	冯杰
电话	(010)83991743	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn	客服电话	4006609839

**(88) 信达证券股份有限公司**

住所、办公地址	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	联系人	唐静
电话	(010) 63081000	传真	(010) 63080978
网址	www.cindasc.com	客服电话	400-800-8899

**(89) 华融证券股份有限公司**

住所	北京市西城区金融大街8号		
办公地址	北京市西城区金融大街8号中国华融A座3层、5层		
法定代表人	宋德清	联系人	黄恒
电话	010-58568235	传真	010-58568062
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	(010) 58568118

**(90) 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		
法定代表人	何如	联系人	齐晓燕
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

**(91) 财富里昂证券有限责任公司**

注册地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼		
法定代表人	罗浩	联系人	倪丹
电话	021-38784818	传真	021-68775878
网址	www.cf-clsa.com	客服电话	68777877

**(二) 基金注册登记机构**

嘉实基金管理有限公司（同上）

**(三) 律师事务所和经办律师**

名称	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	吕红、黎明		

**(四) 会计师事务所和经办注册会计师**

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
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	联系人	洪磊
电话	(021) 23238888	传真	(021) 2238800
经办注册会计师	许康玮、洪磊		

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会2012年5月22日《关于核准嘉实优化红利股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]684号）核准募集。

### （一）基金运作方式和类型

契约型开放式，股票型证券投资基金。

### （二）基金存续期

不定期。

### （三）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象、募集目标

1. 募集期限：2012年5月28日到2012年6月21日

2. 募集方式及场所：本基金通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。

3. 募集对象：符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

4. 募集规模上限：本基金不设募集规模上限，在本基金的募集达到备案条件的前提下，基金管理人可视募集情况提前结束募集。

### （四）基金的面值、认购价格及计算公式、认购费用及利息处理方式

#### 1、认购费率

本基金认购费率不超过5%，按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率

越低。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体认购费率如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
M < 100万元	1.2%
100万元 ≤ M < 200万元	0.8%
200万元 ≤ M < 500万元	0.5%
M ≥ 500万元	按笔收取，1000元/笔

本基金的认购费用由投资者承担，不列入基金资产，认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

#### 2、募集期利息的处理方式：

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前，任何人不得动用。有效认购款项在募集期间产生的利息将在基金合同生效后折算为基金份额，归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

#### 3、认购份额的计算：

本基金每份基金份额初始面值均为人民币1.00元。

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算方法如下：

- (1) 净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)；
- (2) 认购费用 = 认购金额 - 净认购金额；
- (3) 认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值。

其中：认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

#### 4、募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 七、基金合同的生效

### (一) 基金合同生效

本基金基金合同自 2012 年 6 月 26 日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

## （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。法律法规另有规定时，从其规定。

# 八、基金份额的申购、赎回

## （一）基金投资者范围

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

## （二）申购、赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人及基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当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份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。

若基金管理人或其委托的代销机构开通电话、移动通信或网上交易等非现场方式实现的自助交易业务的，投资者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。

## （三）申购、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。

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

自 2012 年 7 月 27 日起开始办理本基金的日常申购和赎回业务

### (四) 申购、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、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；

4、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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### (五) 申购、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。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。

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。

#### 3、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有效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，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在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

他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

## （六）申购、赎回的数额限制

### 1. 申请申购基金的金额

投资者通过代销机构首次申购单笔最低限额为人民币5,000元，投资者通过嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币500元；投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元，但已认购本基金的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币1,000元；投资者通过代销机构或直销中心柜台追加申购单笔最低限额为人民币1,000元，通过嘉实基金管理有限公司网上直销追加申购单笔最低限额为人民币500元。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

### 2. 申请赎回基金的份额

投资者通过代销机构或直销中心柜台单笔赎回不得少于1,000份（如该账户在该销售机构托管的基金余额不足1,000份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金份额余额不足1,000份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

投资者通过嘉实基金管理有限公司网上直销单笔赎回不得少于100份（如该账户在该销售机构托管的基金余额不足100份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足100份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，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》的有关规定在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

## （七）申购、赎回的费率

1、本基金的申购费用最高不超过申购金额的5%。

申购费率按申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
------------	------

M<100万元	1.5%
100万元≤M<200万元	1.0%
200万元≤M<500万元	0.6%
M≥500万元	单笔1000元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购开放式基金业务，其中申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，但中国银行长城借记卡、招商银行借记卡持卡人申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。

投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

2、本基金的赎回费率按照持有时间递减，并对持有期限少于两年的基金份额的赎回收取赎回费，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，随持有期限的增加而递减。具体如下：

持有期限	赎回费率
T<365天	0.50%
365天≤T<730天	0.25%
T≥730天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、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，基金管理人应按照《信息披露办法》的相关规定在调整实施前在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

在开放期内，本基金可对通过基金管理人直销“定期定额投资”的方式申购基金的投资者按累计定投期数实施特殊申购费率安排，具体规定以本基金份额发售公告和届时相关公告为准。

## （八）申购份额、赎回金额的计算方式

### 1. 申购份额的计算

采用“金额申购”方式，申购价格以申购当日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

基金份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

例二：投资者甲和乙于同一日分别对本基金提出申购要求，申购金额分别为110,000元和1,100,000元，当日的基金份额净值为1.200元。两位投资者申购份数计算如下：

	投资者甲	投资者乙
申购金额（元，A）	110,000	1,100,000
适用申购费率（B）	1.5%	1.0%
净申购金额（元，C）	108,374.38	1,089,108.91
申购费用（元，D）	1,625.62	10,891.09
申购份额（E=C/1.2）	90,311.98	907,590.75

### 2. 基金赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额保留至小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

例三：假定三笔赎回申请的赎回份额均为10,000份，但持有时间长短不同，其中基金份额净值为假设数，那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下：

	赎回1	赎回2	赎回3

赎回份额（份，A）	10,000	10,000	10,000
基金份额净值（元，B）	1.100	1.300	1.400
持有时间	100天	366天	731天
适用赎回费率（C）	0.5%	0.25%	0%
赎回总额（元，D=A×B）	11,000	13,000	14,000
赎回费（E=C×D）	55	32.5	0
赎回金额（F=D-E）	10,945	12,967.5	14,000

### 3. 基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。

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。本基金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。

## （九）申购、赎回的注册登记

1、投资者 T 日申购基金成功后，正常情况下，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。

2、投资者 T 日赎回基金成功后，正常情况下，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。

3、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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## （十）巨额赎回的认定及处理方式

### 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)超过前一开放日的基金总份额的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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的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，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；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个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受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。

#### (十一) 拒绝或暂停申购、赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式

1、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) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。
- (3) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- (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。

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)、(2)、(3)、(5)、(6)项暂停申购情形时, 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。

2、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) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(5) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时, 基金管理人应在当日报中国证监会备案, 已确认的赎回申请, 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。若出现上述第(4)项所述情形, 按基金合同的相关条款处理。基金份额持有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公告。

3、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。

4、如发生暂停的时间为1日, 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。

如果发生暂停的时间超过1日但少于两周, 暂停结束, 基金重新开放申购或赎回时, 基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于重新开放申购或赎回日前在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1个开放日的基金份额净值。

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, 基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定提前在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1个开放

日的基金份额净值。

注：2013年4月9日，本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》，自2013年4月12日起，在本公司基金网上直销系统（含电话交易）开通旗下部分基金产品的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统（含电话交易）交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

## 九、基金转换

基金转换是基金管理人给基金份额持有人提供服务的一种服务，是指基金份额持有人按基金管理人规定的条件将其持有的某一只基金的基金份额转换为同一基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为。

### （一）基金转换开始日及时间

基金转换的开始办理时间：自2012年7月27日起。

### （二）、基金转换费用

#### 1、通过代销机构办理基金转换业务（仅限“前端转前端”的模式）

（1）嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B转换为嘉实优化红利时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B为转出的基金份额；

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F为转入基金适用的申购费率；

M为嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实安心货币A或嘉实安心货币B全部转出时账户当前累计未付收益。

（2）嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券转换为嘉实优化红利时，采用“赎回费+申购费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + F)$$



$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

F 为转入基金适用的申购费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(3) 嘉实优化红利与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、嘉实领先成长股票、嘉实周期优选、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实泰和混合之间互转，以及转入嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实稳固收益债券、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实中创400联接、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(4) 嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接转入嘉实优化红利时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的固定补差费率：1) 当转出金额 $\geq$ 500万元时，固定补差费率为零；2) 当转出金额 $<$ 500万元，并且转出基金的持有期 $\geq$ 90天，则固定补差费率为零；3) 当转出金额小于500万元，并且转出基金的持有期 $<$ 90天，则固定补差费率为0.2%。

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(5) 嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实信用债券A、嘉实纯债债券A、嘉实丰益纯债定期债券转入嘉实优化红利时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的固定补差费率：1) 当转出金额 $\geq$ 500万元时，固定补差费率为零；2) 当转出金额 $<$ 500万元，并且转出基金的持有期 $\geq$ 90天，则固定补差费率为零；3) 当转出金额小于500万元，并且转出基金的持有期 $<$ 90天，则固定补差费率为0.5%。

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

## 2、通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务

### 1) 对于“前端转前端”的模式，采用以下规则：

(1) 嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B转换为嘉实优化红利时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F为转入基金适用的申购费率；

M为嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实安心货币A或嘉实安心货币B全部转出时账户当前累计未付收益。

(2) 嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券转换为嘉实优化红利时，采用“赎回费+申购费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + F)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

F为转入基金适用的申购费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(3) 嘉实优化红利与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、嘉实多元债券A、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实领先成长股票、嘉实周期优选、嘉实中创400联接、嘉实纯债债券A、嘉实中证500ETF联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实泰和混合之间互转，以及转入嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

2) 对于“后端转后端”的模式，采用以下规则：

- (1) 若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；
- (2) 若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

转出基金时，如涉及的转出基金有赎回费用，收取该基金的赎回费用。收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

注：自2011年1月7日起嘉实增长混合暂停转入业务；2014年3月12日起，嘉实货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过100万元；2014年3月12日起，嘉实安心货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过100万元；2014年5月9日起，嘉实研究精选股票单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过50万元；2014年5月23日起，嘉实超短债债券单日单个基金账户累计申购（或转入）不超过500万元；嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券为定期开放，在封闭期内无法转换。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

### （三）其他与转换相关的事项

（1）基金转换的时间：投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日，方可办理基金转换业务。

#### （2）基金转换的原则：

- ①采用份额转换原则，即基金转换以份额申请；
- ②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；
- ③基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算；
- ④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金；
- ⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

#### （3）基金转换的程序

##### ①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续,在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时,帐户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

#### ②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日(T日),并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

#### (4) 基金转换的数额限制

基金转换时,由本基金转换到基金管理人管理的其他开放式基金时,最低转出份额为1000份基金份额。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的有关限制并及时公告。

#### (5) 基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下,投资者自T+2日起有权赎回转入部分的基金份额。

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,并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

#### (6) 基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时,本基金转出与基金赎回具有相同的优先级,基金管理人可根据基金资产组合情况,决定全额转出或部分转出,并且对于本基金转出和基金赎回,将采取相同的比例确认;但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下,对未确认的转换申请将不予顺延。

#### (7) 拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

①除非出现如下情形,基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的转入申请:

(i) 因不可抗力导致基金无法正常工作;

(ii) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的转入申请;

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

(iv) 基金管理人认为接受某笔或某些转入申请可能会影响或损害现有基金份额持

有人利益时；

(v) 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的利益的情形；

(vi) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他可暂停转入的情形。

②除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的转出申请或者延缓支付转出款项：

(i) 因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项；

(ii) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的转出申请；

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

(iv) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

(v) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

③如发生基金合同、《招募说明书》或本公告中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准后在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

投资者到本基金代销机构的销售网点办理本基金转换业务时，其相关具体办理规定以各代销机构的规定为准。

## 十、基金的转托管、定期定额投资计划、非交易过户、冻结与解冻

### 1、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标准收取转托管费。

### 2、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另行规定。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。

### 3、非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户(可补充其他情况)。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登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

#### 4、冻结与解冻

基金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,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十一、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。

### (二) 投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金资产配置范围:股票资产占基金资产的比例为60-95%;债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5-40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票。

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

### （三）投资理念

红利是投资者进行股票投资并获得投资收益的重要组成，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，通过严格执行投资风险管理固化和明晰基金的风格特征，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

### （四）投资策略

红利是投资者进行股票投资并获得投资收益的重要组成，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，通过严格执行投资风险管理固化和明晰基金的风格特征，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，股票的收益由两部分构成，当期红利和未来的资本利得。本基金在高现金红利的股票中精选具备成长潜力的公司股票进行投资，追求稳定的股息收入和长期的资本增值；同时以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险；并且严格执行投资风险管理，主要通过对股票资产相对于业绩基准的跟踪误差及行业分布的偏离进行严格控制来固化和明晰基金的风格特征。

#### 1、大类资产配置策略

在大类资产配置上，本基金首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，投资决策委员会将重点评估以下几个因素：宏观因素——包含重要经济数据以及货币和财政政策的变化；市场因素——包含货币供给指标以及流动性的变化对资本市场的影响；估值因素——包含不同市场之间的相对估值变化；同时，本基金作为主动管理的股票基金，也将参考宏观策略部门提供的研究分析建议，并结合投资组合的长期收益获取能力综合考虑作出大类资产配置决策。

在控制风险的前提下，本基金将优先配置股票资产，同时以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。本基金股票资产占基金资产的比例为60-95%，本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续



现金分红的股票。

## 2、红利股票投资策略

本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票。在高现金红利的股票中精选具备成长潜力的公司股票进行投资，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

股票的收益由两部分构成，当期红利和未来的资本利得。本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票，稳定的股息收入是当期收益的重要组成部分，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。市场的波动也为投资者进行红利再投资以获得高额复利回报提供了机会。红利策略在牛市中是锦上添花，在熊市中提供复利回报，这是红利策略能够穿越牛熊市，实现长期价值投资回报的基本逻辑。监管层提出的要求上市公司树立牢固的分红意识，上市公司采取措施完善分红政策及其决策机制，进一步加强对上市公司利润分配决策过程和执行情况监管，以及要求在公司招股说明书中细化回报规划、分红政策和分红计划是对分红理念的肯定。

本基金在股票池的选取上突出对红利股票的侧重，本基金的股票池由市场上高股息率的股票组成，不分红或低分红的股票被自动排除在股票池外。本基金根据上市公司的分红历史，选取在过去两年连续分红，过去两年累积净利润大于0的公司组成备选股票池，本基金按照股息率对备选股票池的股票进行排序，选取排名前50%的股票构成最终的红利股票池。

高红利的股票提供了高的当期回报，而红利的稳定增长决定了未来的资本利得。在一个偏重价值属性的股票库中挑选具有成长性的股票是本基金投资策略的核心。本基金通过运用嘉实优化红利股票模型，通过选取能够体现公司的竞争优势、盈利能力、内生增长能力的因子和能够体现公司财务状况、抗周期波动能力、和分红持续性的因子，寻找基本面健康、具有技术优势、品牌优势和市场优势、内生增长能力好、财务健康、经营风险小、抗周期能力强，且能够实现稳定增长的高红利股票进行投资。

具体的，本基金主要运用下列量化指标分析上市公司的基本面特征，具体包括：

(1) 毛利率。高毛利率的公司具有一定的技术优势，品牌优势和市场优势，主要集中在壁垒较高的行业或掌握核心技术，具有技术优势，品牌优势和市场优势的细分行业龙头；

(2) ROE，即净资产收益率。高ROE公司具有较高的资本的利用效率，在没有外来融

资的情况下，高ROE的公司具有高的内生增长的潜力；

(3) 业绩波动。低业绩波动的公司经营稳定，抗周期能力强，分红的持续性好；

(4) 负债率和流通比率。低负债率和高流通比率的公司财务健康、流通性好、经营风险小。

本基金将充分利用基金管理人强大的研究平台及有关团队的成果，对高红利的公司股票进行深入分析，尽力降低陷入价值陷阱的概率，从而降低投资的非系统性风险，力争提高长期的投资回报。本基金在充分考虑交易成本后，对股票组合进行优化分析，以实现风险收益的最佳匹配。

### 3、债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

### 4、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

### 5、风险管理策略

本基金严格执行投资风险管理，主要通过对股票资产相对于业绩基准的跟踪误差及行业分布的偏离进行严格控制来固化和明晰基金的风格特征。本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如Barra多因子模型、风险预算模型等，并结合公司现有的风险管理流程，在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。

具体而言，在大类资产配置策略的风险控制上，由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控；在行业配置策略的风险控制上，风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外，也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大中小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上，本基金将严格遵守公司的内部规章制度，控制单一个股投资风

险。

## （五）投资限制

### （A）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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

### （B）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）股票资产占基金资产的比例为 60-95%，其中 80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票；
- （2）债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5-40%；
- （3）保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- （4）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （9）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%；

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

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 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%；

(16) 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；

(17) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门调整上述限制性规定，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，本基金在履行适当程序后，按照调整后的规定执行。如有相关法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

## (六) 业绩比较基准

中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本，指数加权方式同沪深300指数，以

反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。

如果指数编制单位停止计算编制该指数、或今后法律法规发生变化或更改指数名称、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，调整业绩比较基准并及时公告。

### （七）风险收益特征

本基金为股票型基金，本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### （八）基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

### （九）基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

### （十）基金投资组合报告

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18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至2014年3月31日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

**1. 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	21,080,874.18	69.94
	其中：股票	21,080,874.18	69.94
2	固定收益投资	2,101,300.00	6.97
	其中：债券	2,101,300.00	6.97
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	5,000,000.00	16.59
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,880,907.10	6.24
7	其他资产	76,987.14	0.26
	合计	30,140,068.42	100.00

**2. 报告期末按行业分类的股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,240,200.00	4.18
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,602,448.18	49.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,273,268.00	11.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	911,598.00	3.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,053,360.00	3.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,080,874.18	71.04

**3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	50,000	1,791,500.00	6.04
2	000028	国药一致	39,947	1,757,668.00	5.92
3	002049	同方国芯	41,000	1,535,860.00	5.18
4	000970	中科三环	116,000	1,513,800.00	5.10
5	000039	中集集团	103,000	1,513,070.00	5.10
6	000333	美的集团	33,121	1,493,094.68	5.03
7	002041	登海种业	45,000	1,240,200.00	4.18
8	600594	益佰制药	30,000	1,228,500.00	4.14
9	600138	中青旅	57,000	1,053,360.00	3.55
10	002349	精华制药	61,900	1,047,967.00	3.53

**4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,101,300.00	7.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	2,101,300.00	7.08

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019113	11国债13	11,000	1,101,100.00	3.71
2	090018	09付息国债18	10,000	1,000,200.00	3.37

注：报告期末本基金仅持有上述2只债券。

**6. 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资产支持证券投资明细**

报告期末，本基金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序的前五名贵金属投资明细**

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

**8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

报告期末，本基金未持有权证。

**9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

**10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

**11. 投资组合报告附注**

- (1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
- (2) 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
- (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	19,435.21
2	应收证券清算款	1,779.22
3	应收股利	-
4	应收利息	49,978.67
5	应收申购款	5,794.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	76,987.14

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

报告期末，本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**

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

**十二、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。



## 1. 本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效 (2012年6月26日)起至2012年 12月31日	1.70%	1.04%	5.56%	1.13%	-3.86%	-0.09%
2013年度	-1.18%	1.22%	-9.43%	1.41%	8.25%	-0.19%
2014年1月1日至 2014年3月31日	-10.55%	1.12%	-1.17%	1.15%	-9.38%	-0.03%

## 2. 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实优化红利股票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

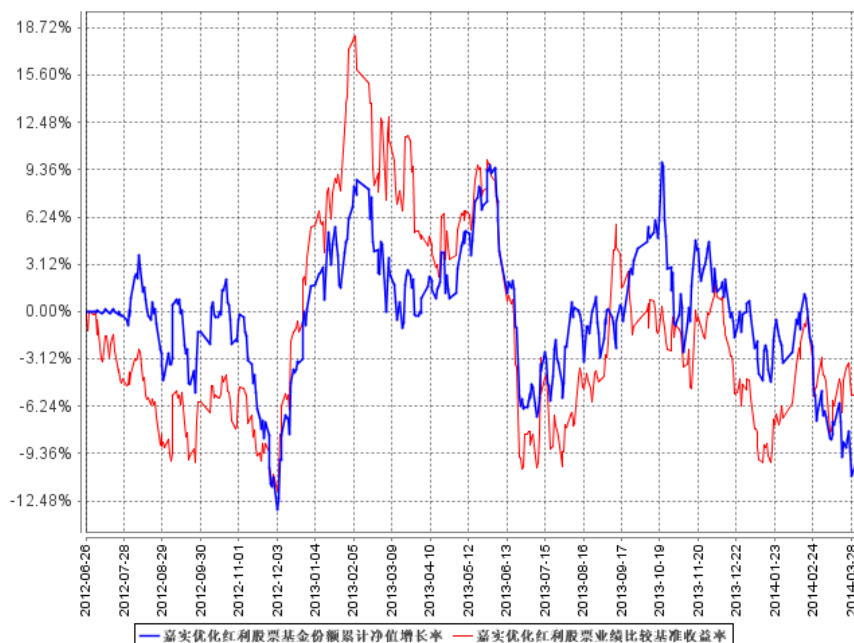


图: 嘉实优化红利股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月26日至2014年3月31日)

注1: 按基金合同和招募说明书的约定, 本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期, 建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分 二、投资范围和 四、投资限制”的有关约定。

注2: 2014年2月7日, 本基金管理人发布《关于嘉实优化红利股票基金经理变更的公告》, 聘请翟琳琳女士担任本基金基金经理职务, 与现任基金经理赵勇先生共同管理本基金。

## 十三、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金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

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十四、基金资产估值

### （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

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

## （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、其它投资等资产及负债。

## （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估值方法估值；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估值方法估值；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、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。

5、因持有股票而享有的配股权，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。

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。

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。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。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。

#### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （七）基金净值的确认

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和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净值予以公布。

#### （八）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三位以内(含第三位)发生估值错误时，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、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确

认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误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，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”)，则估值错误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估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(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。

(3) 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。

### (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4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，或由于证券交易所或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或减轻由此造成的影响。

#### **（十）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和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净值予以公布。

## **十五、基金收益与分配**

#### **（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**

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 90%，如本基金当季度末每份基金份额可供分配利润超过 0.05 元时，本基金管理人应在下季度第一个月进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后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。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **（四）收益分配方案**

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

#### **（五）收益分配方案的确定、公告与实施**

本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，在2个工作日内在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（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

#### **（六）收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## **十六、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》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；



8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—7 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### **（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协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

#### **（五）税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## **十七、基金的会计与审计**

### **（一）基金会计政策**

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；

3、基金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会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

## （二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 十八、基金的信息披露

（一）本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。

### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）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。

（四）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。

#### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

##### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；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网站上。

##### 2、基金份额发售公告

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

##### 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

##### 4、基金资产净值、基金份额净值

《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后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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款规定的市场交易日的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同），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媒体上。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《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，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 6、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

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媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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媒体上。

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媒体上。

《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。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

#### 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作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的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下列事件：

- (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百分之五十；
- (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百分之三十；
- (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百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金登记机构；
- (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) 基金份额持有人大会的决议；
- (27) 中国证监会规定的其他事项。

## 8、澄清公告

在《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。

## 9、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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。

## 10、中国证监会规定的其他信息。

### （六）信息披露事务管理

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

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 15 年。

### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

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，以供公众查阅、复制。

## 十九、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

### （1）政策风险

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

### （2）经济周期风险

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

### （3）利率风险

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

### （4）购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，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。

### （5）上市公司经营风险

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

## （二）信用风险

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

## （三）流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

## （四）管理风险

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



### （五）操作或技术风险

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

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

### （六）合规性风险

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

### （七）本基金特定投资策略带来的风险

本基金为股票型基金，本基金股票资产占基金资产的比例为60-95%；债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票。

本基金为股票型基金，股票投资比例为基金资产的60%-95%，当股票市场发生波动时，将无法完全规避此类市场下跌的风险。本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票，A股市场上的红利投资策略主要通过红利股票价格的波动而非现金红利来实现投资损益的，由于本基金对红利股票的严格界定以及运作中的品种选择结果可能带来的业绩偏离风险是本基金产品的一个重要风险来源。此外，由于本基金还可以投资其它品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

### （八）其它风险

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

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

## 二十、基金合同的变更、终止与基金资产的清算

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更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，自决议生效之日起在指定媒体公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 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；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 13 个月。

#### **(四) 清算费用**

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

#### **(五) 基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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。

#### **(六) 基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **(七) 基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、基金合同内容摘要

### （一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）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；
- （13）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；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）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、转换和非交易过户的业务规则；

- (17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集基金，办理或者委托经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、谨慎勤勉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) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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) 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，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 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；
- (12) 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保密，不向他人泄露；
- (13) 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；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 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；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者

能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 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；

(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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 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；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 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费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
  - (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
  - (7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
  - (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
  - (3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
  - (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
  - (5) 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，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；
  - (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予以保密，不得向他人泄露；
  - (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
  - (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
  - (10) 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；
  - (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
  - (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
  - (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - (14) 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；
  - (15) 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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
  - (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 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监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### **(三) 基金份额持有人的权利与义务**

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法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或仲裁；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其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；



- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **(四) 基金份额持有人大会**

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拥有平等的投票权。

##### **(A) 召开事由**

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有

人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》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。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(4) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更本基金的费率结构或收费方式；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(6) 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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

#### (B) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、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，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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（含10%）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。

5、代表基金份额10%以上（含10%）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，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）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。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、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(C) 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、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前40日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（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；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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，不影响表决意见的计票效力。

#### (D) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式或法律法规及监管机关允许的其他开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。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、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%（含50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

(4) 上述第(3)项中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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

3、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。

#### (E) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项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。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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所持表决权的10%以上（含10%）选举产生一名基金份额持有人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拒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作出的决议的效力。

会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前40日公布提案，在所通知的表决截止日期后第2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （F）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项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，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定

的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

## (G) 计票

### 1、现场开会

(1) 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和代理人中选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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 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) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（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拒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。

## (H) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，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的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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日内在指定媒体上公告。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。

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议。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。

## （五）基金收益分配原则与执行方式

### （A）收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 90%，如本基金当季度末每份基金份额可供分配利润超过 0.05 元时，本基金管理人应在下季度第一个月进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后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。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （B）收益分配方案

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

### （C）收益分配方案的确定、公告与实施

本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，在 2 个工作日内在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（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

(D) 收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

**(六) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例**

(A) 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》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(B) 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“(A)基金费用的种类中第 3—7 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(C) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(D) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## (七) 基金财产的投资方向和投资限制

### (A) 投资目标

本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

### (B) 投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金资产配置范围：股票资产占基金资产的比例为 60-95%；债券等固定收益类资产

以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。本基金将 80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票。

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

### (C) 投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 股票资产占基金资产的比例为 60-95%，其中 80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票；

(2) 债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5-40%；

(3) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(4) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(6) 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%；

(7) 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%；

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

(9) 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%；

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

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 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%；

(16) 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；

(17) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

## (八)基金资产净值的计算方法和公告方式

### (A) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### (B) 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、其它投资等资产及负债。

### (C) 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估值方法估值；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估值方法估值；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、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。

5、因持有股票而享有的配股权，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。

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。

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。

#### (D) 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。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。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。

#### (E) 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三位以内(含第三位)发生估值错误时，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、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误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，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”），则估值错误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估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(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。

(3) 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。

(F) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(G) 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和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净值予以公布。



## (九)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### (A)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更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，自决议生效之日起在指定媒体公告。

### (B)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (C) 基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估值和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)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；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产的清算期限为 13 个月

(D) 清算费用

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

(E) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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。

(F) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(G) 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。

## (十) 争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，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。

《基金合同》受中国法律管辖。

## (十一) 基金合同的存放及查阅方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### (一) 基金托管协议当事人

#### 1. 基金管理人（或简称“管理人”）

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元

法定代表人：安奎

成立时间：1999年3月25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【1999】5号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5亿元人民币

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

#### 2. 基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整

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

（A）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。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金资产配置范围：股票资产占基金资产的比例为60-95%；债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

基金管理人应将拟投资的股票库、红利股票股票库、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；

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

股票资产占基金资产的比例为 60-95%；债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。本基金将 80% 以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票。

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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

- (a) 股票资产占基金资产的比例为 60-95%，其中 80% 以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票；
- (b) 债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5-40%；
- (c) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- (d) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (e) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (f) 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%；
- (g) 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%；
- (h) 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%；

- (i) 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%;
- (j) 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%;
- (k) 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%;
- (l) 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%;
- (m) 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;
- (n) 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;
- (o) 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%;
- (p) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 3%;
- (q) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

### (3) 法规允许的基金投资比例调整期限

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。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

### (4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效日起开始。

3、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；

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任；

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；

(B) 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复核。

(C) 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。

(D) 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。

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

### (三) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，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）基金财产保管**

##### **（A）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。

##### **（B）《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依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基



金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

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

(C) 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。

(D) 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。

(E) 基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

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,按照有关规定办理;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。

#### (F) 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。

#### (G) 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。

#### (H) 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

#### (A) 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基金负债后的价值。基金份额净值是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。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》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工作日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机构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、由于证券交易所或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。

## (B) 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

### （A）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。

### （B）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。

### （C）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）争议解决方式**

1. 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2. 基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，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。

3. 除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

### **（八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算**

#### **（A）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。

#### **（B）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。

#### **（C）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。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### (一) 资料寄送

#### 1、开户确认书和交易对账单

首次基金交易(除基金开户外其他交易类型)后的15个工作日内向基金份额持有人寄送开户确认书和交易对账单。

#### 2、基金份额持有人对账单

基金管理人在每年第1-3季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易的投资者寄送季度对账单,在每年第4季度结束后向定制纸质对账单且季度内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资者寄送年度对账单;每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对账单。

3、由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者,敬请及时通过本公司网站,或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

### (二) 红利再投资

若基金份额持有人选择将基金收益以基金份额形式进行分配,该持有人当期分配所得的红利将按照除息日的基金份额净值自动转为本基金份额。红利再投资免收申购费用。

### (三) 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另行规定并公告。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。

### (四) 手机短信服务

基金管理人向定制净值短信的基金份额持有人提供基金净值短信服务。基金份额持有人可通过拨打客户服务电话400-600-8800(免长途话费)、(010)85712266,也可通过基金管理人网站定制短信服务。

### (五) 在线服务

通过本公司网站www.jsfund.cn,基金份额持有人还可获得如下服务:

### 1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

### 3、网上交易和电话交易服务

投资者可登录本基金管理人网站，通过直销网上交易办理认购/申购、赎回、转换、定期定额申购、定期定额赎回、定期定额转换、查询等业务。网上交易投资者开通电话交易后可以通过电话交易赎回、转换所持基金份额，持工行借记卡、建行龙卡储蓄卡、农行金穗卡、广发银行理财通卡、招行借记卡、中国民生银行借记卡、浦发银行东方卡等可以通过电话交易系统购买基金。具体参见相关公告。

## （六）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800（免长途话费）、(010)85712266，传真：（010）65182266。

### 2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：[service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

## 二十四、其他应披露事项

2013年12月26日至2014年6月26日，本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》的临时报告如下：

序号	公告事项	法定披露日期	备注
1	关于嘉实优化红利股票基金经理变更的公告	2014年2月7日	
2	嘉实基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金网上直销申购、赎回及最低账面份额的单笔最低要求的公告	2014年2月26日	含本基金
3	关于调整嘉实旗下部分开放式基金的日常转换费率的公告	2014年4月16日	含本基金



4	关于增加苏州银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	2014年4月17日	含本基金
5	关于增加和讯信息科技为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	2014年4月28日	含本基金
6	关于增加瑞丰银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与瑞丰银行费率优惠活动的的公告	2014年6月16日	含本基金

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

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

## 二十六、备查文件

1. 中国证监会核准嘉实优化红利股票型证券投资基金募集的文件；
2. 《嘉实优化红利股票型证券投资基金基金合同》；
3. 《嘉实优化红利股票型证券投资基金托管协议》；
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和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

嘉实基金管理有限公司

2014年8月8日