

# 华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金

## 招募说明书

### 【重要提示】

本基金根据 2015 年 7 月 8 日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1531 号的注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金主要投资于境内和境外上市的互联网主题相关的中国公司。受国际政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化，本基金的资产将有可能存在以下风险：政治风险、境外市场风险、政府管制风险、汇率风险、法律风险、利率风险、税务风险、境外上市公司经营风险、税务风险、集中投资某个国家或地区的风险等。同时，投资本基金的风险还包括：本基金特有的投资风险（股票型基金风险、主题型基金风险）、股指期货投资风险、其他衍生品投资的风险、证券借贷风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、交易对手的信用风险、大宗交易风险等。

本基金是一只主动投资的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的预期风险和预期收益都较高的品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

## 目 录

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 一、绪 言.....                 | 1   |
| 二、释 义.....                 | 2   |
| 三、风险揭示.....                | 6   |
| 四、基金的投资.....               | 11  |
| 五、基金管理人.....               | 21  |
| 六、基金的募集.....               | 30  |
| 七、基金的备案.....               | 35  |
| 八、基金份额的申购与赎回.....          | 36  |
| 九、基金的费用与税收.....            | 47  |
| 十、基金的财产.....               | 49  |
| 十一、基金资产估值.....             | 50  |
| 十二、基金的收益与分配.....           | 55  |
| 十三、基金的会计与审计.....           | 57  |
| 十四、基金的信息披露.....            | 58  |
| 十五、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 63  |
| 十六、基金托管人.....              | 65  |
| 十七、境外托管人.....              | 69  |
| 十八、相关服务机构.....             | 70  |
| 十九、基金合同的内容摘要.....          | 72  |
| 二十、基金托管协议的内容摘要.....        | 87  |
| 二十一、对基金份额持有人的服务.....       | 100 |
| 二十二、其他应披露事项.....           | 102 |
| 二十三、招募说明书存放及查阅方式.....      | 103 |
| 二十四、备查文件.....              | 104 |

## 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》”)、《公开募集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》”)、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称“《试行办法》”)、《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》(以下简称“《通知》”)、其他有关规定及《华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

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

## 二、释 义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指华宝兴业基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、境外托管人：指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构
- 5、基金合同：指《华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝兴业中国互联网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
- 7、招募说明书或本招募说明书：指《华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 8、基金份额发售公告：指《华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、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
- 10、《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，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，并自 2013 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
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 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
- 12、《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
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集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
- 14、《试行办法》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日颁布、同年 7 月 5 日实施的《合格

境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《通知》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日颁布、同年 7 月 5 日实施的《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

18、外管局：指国家外汇管理局或其授权的代表机构

19、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

20、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

21、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

22、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

23、投资者：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以人民币、美元购买证券投资基金相应币种份额的其他投资者的合称

24、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者

25、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、转托管及定期定额投资等业务

26、销售机构：指华宝兴业基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

27、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者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

28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华宝兴业基金管理有限公司或接受华宝兴业基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

29、基金账户：指登记机构为投资者开立的、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

30、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务导致基金份额变动及结余情况的账户

31、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

32、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

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、T日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日

37、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

38、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（即上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外，其中境外主要投资市场在招募说明书中载明和更新）

39、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他业务申请的时间段

40、《业务规则》：指《华宝兴业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者共同遵守

41、认购：指在基金募集期内，投资者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

42、申购：指基金合同生效后，投资者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

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

44、基金转换：指基金份额持有人按照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

45、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

46、定期定额投资计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、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者指定银行账户内自动完成扣款及受

理基金申购申请的一种投资方式

47、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%

48、基金份额类别：指本基金根据认购/申购、赎回所使用的货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为美元份额

49、基准货币：指基金资产估值的记账本位币。本基金的基准货币为人民币

50、人民币：指中国法定货币及法定货币单位

51、美元：指美国法定货币及法定货币单位

52、元：如无特指，指人民币元

53、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

54、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

55、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

56、基金份额净值：人民币份额的基金份额净值指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额后得出的单位基金份额的价值，计算日基金份额余额为计算日各币种基金份额余额的合计数；美元份额的基金份额净值以人民币份额的基金份额净值为基础，按照计算日中国人民银行公布的人民币对美元汇率中间价进行计算

57、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

58、公司行为信息：指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动，及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息，包括但不限于权益派发、配股、股本变动等信息

59、指定媒介：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介

60、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。



### 三、风险揭示

#### （一）全球投资的风险

本基金主要投资于境内和境外上市的互联网主题相关的中国公司。受国际政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化，本基金的资产将有可能存在以下风险：

##### 1、政治风险

政治风险是指本基金所投资的国家出现大的政治变化，例如政府更迭、国内动乱、政策调整、对外政治关系发生危机等，以及财政、货币、产业和地区发展政策等宏观政策发生变化等，这些事件甚至可能造成市场剧烈波动，从而带来投资风险，影响基金的投资收益。

##### 2、境外市场风险

境外市场风险是指由于市场因素如基础利率、汇率、股票价格和商品价格的变化或由于这些市场因素的波动率的变化而引起的证券价格的非预期变化，并产生损失的可能性。

由于本基金除投资境内证券市场外，也将投资于美国和香港特别行政区证券市场，因此一方面基金净值会因美国、香港特别行政区证券市场的整体变化而出现价格波动；另一方面美国、香港特别行政区所特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势等也将对基金的业绩产生影响。另外由于美国、香港特别行政区的证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，使得证券的每日涨跌幅空间相对较大。以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险的增加。

##### 3、政府管制风险

政府管制风险是指国家政府机关通过制定相关法律法规或采用行政干预手段对社会经济行为实施直接控制而使基金资产有遭受损失的风险。在境外证券投资过程中，基金所投资的国家/地区（对本基金而言，主要是美国和香港特别行政区）可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、对公司或行业的国有化、没收资产以及征收高额税收等，造成相应的财产受损、交易延误等相关风险，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

##### 4、汇率风险

本基金每日的基金资产净值以人民币计价，但本基金所投资的资产部分以美元或港元计价，因此当美元、港元与人民币汇率发生变动时，将会影响到人民币计价的基金资产净值。

##### 5、法律风险

由于美国、香港特别行政区所适用法律法规与中国境内法律法规有所不同，可能导致本基金的某些投资行为在美国、香港特别行政区受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能性。

#### 6、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金可投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

#### 7、境外上市公司经营风险

境外上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。

#### 8、税务风险

本基金在美国、香港特别行政区进行投资时，需按照当地税务法律法规就股息、利息、资本利得等收益向税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。美国、香港特别行政区税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该国缴纳本基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

#### 9、集中投资某个国家或地区的风险

本基金可在投资范围内，根据市场情况，在某一时间集中投资某个国家或地区，由此产生相应的投资风险。

### （二）基金投资风险

#### 1、本基金的特有风险

本基金作为股票型基金，在投资管理中会至少维持 80%的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

本基金属于主题投资型股票基金，存在主题轮动风险，即集中投资于目标主题股票的业绩表现不一定领先于市场平均水平。

#### 2、股指期货投资的风险

本基金可能投资于股指期货，因此本基金可能面临如下风险：

（1）杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

(2) 流动性风险：由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

(3) 基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格变动方向不同所造成的风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差异常变动而遭受展期风险。

(4) 保证金风险：股指期货采取盯市结算制度，如果未能在规定的时间内补足保证金，可能面临被强制平仓的风险。

(5) 信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

(6) 操作风险：是指由于内部流程的不完善、业务人员出现差错或者疏漏、或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

### 3、其他衍生品投资的风险

本基金还可投资于期权以及外汇远期合约等其他衍生品。尽管本基金将谨慎地使用衍生品进行投资，但衍生品仍可能给基金带来额外风险，包括杠杆风险、交易对手的信用风险、衍生品价格与其基础品种的相关度降低带来的风险等，由此可能会增加基金净值的波动幅度。本基金衍生品的投资将仅用于避险和进行组合的有效管理。

### 4、证券借贷、正回购 / 逆回购风险

证券借贷、正回购 / 逆回购的主要风险在于交易对手风险，具体讲，对于证券借贷，作为证券借出方，如果交易对手方（即证券借入方）违约，则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致基金资产发生损失；对于正回购，交易期满时，可能会出现交易对手方未如约卖回已买入证券未如约支付售出证券产生的所有股息、利息和分红的风险；对于逆回购，交易期满时，可能会出现交易对手方未如约买回已售出证券的风险。

## （三）一般风险

### 1、管理风险

基金管理人、基金托管人及境外托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。

### 2、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级的变化或市场对某一信用等级水平下债券利率的变化都会迅速的改变债券的价格，从而影响到基金资产。

### 3、操作或技术风险

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操作失误而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

### 4、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。

### 5、流动性风险

本基金面临的证券市场流动性风险主要表现在几个方面:基金资产不能迅速转变成现金,或变现成本很高;不能应付可能出现的投资人大额赎回的风险;证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是:

(1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响,在某些时期成交活跃,流动性非常好,而在另一些时期,则可能成交稀少,流动性差。在市场流动性相对不足时,交易变现都有可能因流动性问题而增加变现成本,对本基金的资产净值造成不利影响。这种风险在发生大额赎回时表现尤为突出。

(2) 证券市场中流动性不均匀,存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异,即使在市场流动性比较好的情况下,一些个股的流动性可能仍然比较差,这种情况的存在使得本基金在进行个股和个券操作时,可能难以按计划买入或卖出相应的数量,或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响,增加个股和个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

另外,本基金可投资于境外证券市场,由于境外市场的交易日、交易时间、结算规则等与国内存在一定的差异,本基金有关申购、赎回的开放与交易确认的安排不同于国内一般开放式基金。本基金赎回款项到达投资者指定账户需要更长的时间。

### 6、会计核算风险

主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险,如经常性的串户,账务记重,透支、过失付款,资金汇划系统款项错划,日终轧帐假平,会计备份数据丢失,利息计算错误等。通过双会计制以及基金会计核算、托管方会计复核的方法可以有效控制会计核算风险。

### 7、大宗交易风险

大宗交易是指单笔交易规模远大于市场平均单笔交易规模的交易。大宗交易价格的形成

并非完全是由市场供求关系决定的，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

#### 8、交易结算风险

基金在证券交割或现金交割过程中，由于交易对手违约而引发的风险。

9、金融模型风险：模型风险指由于使用不恰当的模型来分析有价证券而引起损失的风险。导致模型失败的原因有以下几点：

- (1) 数据录入时可能出错；
- (2) 模型参数的估计错误；
- (3) 模型错误；
- (4) 错误地运用模型。

#### 10、其他风险

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

- (5) 其他意外导致的风险。

#### (四) 声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过其他销售机构销售，但是，基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 四、基金的投资

### （一）投资目标

把握中国互联网相关行业在中国境内外资本市场的投资机会，在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为依法发行上市的股票、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、创业板及其他依法上市的股票）、股指期货、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、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷；证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF）；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生品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相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于互联网主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有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%。

本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场，其中境外市场包括：美国和中国香港特别行政区。其中，投资各个市场股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例上限如下：境内市场为 95%，美国为 95%，香港特别行政区为 95%。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场。本基金将通过宏观策略研究，构造

适当的量化模型，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，从而决定全球资产配置比例。

在全球资产配置过程中，本基金主要考虑以下几类指标：

(1) 宏观经济方面：GDP 增速、消费价格指数、采购经理人指数、月度工业增加值、工业品价格指数、月度进出口数据以及汇率等；

(2) 宏观经济政策方面：财政政策、货币政策等；

(3) 境内外市场流动性方面：境内外市场的资金流动趋势和供需等；

(4) 境外和境内市场的相对估值方面：境内和境外股票市场的相对市盈率，市净率，净资产收益率等。

## 2、股票投资策略

本基金主要投资于在境内和境外上市的互联网主题相关的中国公司。对于股票投资，本基金将主要采用基于基本面研究、成长导向的主动性管理策略，自下而上地选择个股，同时兼顾行业变化。

### (1) 互联网主题的界定

本基金所涉及的互联网主题是指移动通信技术与互联网技术、平台、商业模式和应用相结合的公司，包括但不限于设备制造商、通信服务商、应用服务商、内容提供商等。

伴随着“互联网+”行动计划的正式确立，互联网技术今后必然将不断加深与传统行业的融合。在此过程中，部分传统行业公司因与互联网技术相结合，会带来商业模式的改进，生产效率的提升与增长，从而获得新的成长驱动力。本基金也会将此类公司纳入互联网主题的涵盖范围。

### (2) 子行业配置策略

互联网主题相关子行业主要包括：网络搜索、网络平台、网络社交、网络游戏、电子商务及为达成上述目的所需要的网络设备、网络通信及衍生应用等。由于互联网主题相关的各个子行业所处的商业周期不同，面临的上下游市场环境各不相同，各个子行业表现也并非完全同步，在不同子行业之间进行资产配置有助于提高组合的总体收益。

传统行业利用互联网技术、思维方式或商业模式对自身进行改造升级，也是本基金重点关注的对象。目前传统行业涉足互联网的主要有教育、医疗及文化娱乐等，未来工业制造、农业及能源等行业也均有可能出现与互联网结合的成功商业模式，对此本基金也会给予密切跟踪。

本基金在行业配置过程中需要考虑的具体因素包括：

#### 1) 行业的生命周期

不同子行业所处的行业生命周期的阶段不同，所蕴含的成长机会也不同。通常位于行业生命周期初期阶段的企业未来发展空间较大。

#### 2) 行业内部的竞争结构

不同子行业的内部竞争结构不同，导致企业收益的稳定性和成长性也有所不同。通常行业集中度高、竞争者较少的行业较少价格战的风险，利润率比较稳定。

#### 3) 政策因素

互联网各子行业本身具有弱经济周期的特性，很多情况下与政府政策高度相关。比如移动支付、移动社交、移动游戏等子行业都受到政府政策的高度影响。本基金将密切关注政府政策因素的变化，提前做出预判，积极配置于政策受益大的子行业。

#### 4) 商业模式的变化

传统行业与互联网结合后，将对原有模式进行变革，从而起到提升效率，提高资产收益的目的。

### 3、个股投资策略

本基金将依靠定量与定性相结合的方法，自下而上地精选个股。

定量的方法包括分析相关的财务指标和市场指标，选择财务健康，成长性好，估值合理的股票。具体分析的指标为：

- 1) 成长指标：预测未来两年主营业务收入、主营业务利润复合增长率等；
- 2) 盈利指标：毛利率、净利率、净资产收益率等；
- 3) 价值指标：PE、PB、PEG、PS 等。

定性的方法则是结合本基金研究团队的案头研究和实地调研，深入分析企业的基本面和长期发展前景，及短期重大影响事件，精选符合以下一项或数项定性判断标准的股票：

- 1) 公司的商业模式比较独特，难于被竞争对手复制
- 2) 公司产品或服务的用户粘性高，用户不易被竞争对手抢夺
- 3) 公司管理层的战略思考和执行能力突出，能够在不确定的竞争环境中不断做出正确的战略方向选择

- 4) 公司治理结构健全、信息披露透明，与投资者沟通坦诚、顺畅。

本基金可以同时投资境内市场和境外市场，不同市场均有其自身的市场特征，因此在个股选择上也会考虑这些特征，采取差异化的投资策略。本基金会根据不同市场发展的不同阶段，及时调整投资策略，尽可能最大化组合的投资收益。

### 4、固定收益类投资工具投资策略



本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

#### 5、股指期货投资策略

本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场 and 期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到管理投资组合风险的目的。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券  $\alpha$  策略等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在更新招募说明书中公告。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

（1）本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于互联网主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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；

（3）本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有同一机构发行的具有投票权的证券，不超过该证券的 10%（同一机构境内外上市的总股本将合并计算，同时全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券将一并计算，并假设对持有的股本权证行使转换）；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

(8) 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%；

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

(10) 本基金持有的同一(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%；

(11) 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%；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(16) 本基金在境内投资中，参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

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

(17) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中境外投资中，银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的

信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

(18) 本基金在境外投资中，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

(19) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前述非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

(20) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。持有货币市场基金可以不受上述限制；

(21) 基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

(22) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

(23) 本基金境外投资中，投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

① 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

② 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

③ 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

④ 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

⑤ 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(24) 本基金境外投资中，可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。

一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

① 现金；

② 存款证明；

③ 商业票据；

④ 政府债券；

⑤ 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(25) 本基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(26) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(27) 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。

(28) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的，则基金管理人与基金托管协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前，应向监管机关更新本基金注册或备案，并在实施前向投资者履行信息披露义务。

因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人根据《托管协议》对基金的投资进行监督和检查，对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；

- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 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；
- (14) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (15) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

#### (五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证互联网指数×50%+中证海外中国互联网指数×50%。

本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### (六) 风险收益特征

本基金是一只主动投资的股票型基金，属于证券投资基金中的预期风险和预期收益都较高的品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

#### (七) 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、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照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。

#### (八) 代理投票

基金管理人应作为基金份额持有人的代理人，行使所投资股票的投票权。基金管理人将本着维护持有人利益的原则，勤勉尽职地代理基金份额持有人行使投票权。在履行代理投票职责过程中，基金管理人可根据操作需要，委托境外资产托管人或其他专业机构提供代理投

票的建议、协助完成代理投票的程序等，基金管理人应对代理机构的行为进行必要的监督，并承担相应责任。

### （九）证券交易管理

#### 1、经纪商选择标准

（1）交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；

（2）研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；

（3）财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；

（4）后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

（5）组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

（6）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

#### 2、交易量分配

基金管理人将根据上述标准对经纪商进行综合考察，选取最适合基金投资业务的经纪商合作，并根据综合考察结果分配基金在各个经纪商的交易量。

#### 3、佣金管理

基金管理人将根据经纪商提供的服务内容和服务质量，按照最佳市场惯例原则确定佣金费率。交易佣金如有折扣或返还，应归入基金资产。

## 五、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：郑安国

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：021-38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东领先资产管理有限公司持有 49% 的股份。

### （二）基金管理人主要人员情况

#### 1、董事会成员

郑安国先生，董事长，博士、高级经济师。曾任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方证券公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理、总裁。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事长、华宝投资有限公司董事、总经理，中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝兴业基金管理有限公司总经理。

Lionel PAQUIN 先生，董事，硕士。曾在法国财政部、法国兴业银行、领先资产管理有限公司从事监察、风险管理和专户平台等业务，现任领先资产管理有限公司总裁。

Alexandre Werno 先生，董事，硕士。曾在法兴集团从事内审监察及国际业务战略风险管理工作；曾任法国兴业银行全球市场执行董事、中国业务发展负责人。2013 年 5 月加入



华宝兴业基金管理有限公司任总经理高级顾问。现任华宝兴业基金管理有限公司常务副总经理。

张群先生，独立董事，博士、教授、博导。曾任北京科技大学经济管理学院（现东凌经济管理学院）教授、院长。现任北京科技大学东凌经济管理学院教授、学术委员会副主席，管理科学研究所所长。

罗飞先生，独立董事，博士、教授、博导。曾任中南财经政法大学会计系讲师、会计系西方会计研究室主任、会计系副主任、会计学院院长。现任中南财经政法大学经济与会计监管中心主任。

江岩女士，独立董事，法学学士、工商管理硕士。曾任中国政法大学教师、深圳市轻工集团公司法律秘书、南方证券股份有限公司深圳总部总经理、国际业务总部总经理助理、总经理。现任北京竞天公诚律师事务所律师。

## 2、监事会成员

Anne MARION-BOUCHACOURT 女士，监事，硕士。曾任普华永道总监，杰米尼咨询金融机构业务副总裁，索尔文国际副总裁，法兴集团人力资源高级执行副总裁兼执行委员会委员。现任法兴集团中国区负责人，集团管理委员会委员。

贾璐女士，监事，硕士研究生，高级工程师。曾任宝钢自动化部组干科主办，宝钢国贸公司人事部人才开发室主任，宝钢国际公司人力资源部部长、组织部部长，宝钢资源（国际）公司总经理助理、华宝投资公司副总经理。现任宝钢集团金融系统党委副书记。

贺桂先先生，监事，毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理，现任华宝兴业基金管理有限公司营运副总监。

## 3、总经理及其他高级管理人员

郑安国先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

Alexandre Werno 先生，常务副总经理，简历同上。

任志强先生，副总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资责任有限公司发展研究中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理

有限公司市场部任职。2002 年加入华宝兴业基金基金管理有限公司参与公司的筹建工作，先后担任清算登记部总经理、营运副总监、营运总监。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

刘月华先生，督察长，硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝兴业基金管理有限公司督察长。

#### 4、拟任基金经理

周晶先生，经济学博士、工商管理硕士，曾在美国德亚投资任高级数量分析师、华宝兴业基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管、汇丰证券美国全球中央银行部人助理副总裁。2011 年加入华宝兴业基金管理有限公司，历任策略部总经理兼首席策略分析师。现任国际业务部总经理、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理、华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理，兼任华宝兴业资产管理（香港）有限公司策略研究部经理。

周欣先生，经济学硕士、工商管理硕士，曾在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009 年 12 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任海外投资管理部总经理。2009 年 12 月至今担任华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金基金经理。目前兼任华宝兴业资产管理（香港）有限公司投资部经理。

#### 5、投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、投资总监。

刘自强先生，投资副总监、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。

王智慧先生，助理投资总监、华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。

闫旭女士，助理投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

李卓先生，研究部总经理。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1、依法募集资金，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；基于谨慎的原则，控制基金资产的流动性风险，保证基金资产正常运作；

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，确定各类基金份额申购、赎回的价格；

9、确保基金管理人发送的交易数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据真实、准确、完整；

10、确保基金管理人向基金托管人发送的基金认购、申购和赎回数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据的真实、准确和完整；

11、委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；

12、与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行；

13、进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

14、如需在基金托管人选择的机构之外保管、登记基金财产，应严格审查，保证基金财产的安全，以及相关资产收益准确、按时归入基金财产；

15、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

16、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

- 17、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 18、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；
- 19、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；
- 20、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；
- 21、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 22、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；
- 23、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；
- 24、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；
- 25、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；
- 26、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；
- 27、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；
- 28、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；
- 29、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；
- 30、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；
- 31、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；
- 32、执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 33、建立并保存基金份额持有人名册；

34、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）基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不得有下列行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

#### 3、基金经理承诺

- （1）依照有关法律法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牟取不当利益；
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （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、风险管理体系

本基金的资产将有可能存在以下风险：政治风险、境外市场风险、政府管制风险、汇率风险、法律风险、利率风险、税务风险、境外上市公司经营风险、税务风险、集中投资某个国家或地区的风险等。同时，投资本基金的风险还包括：本基金特有的投资风险（股票型基金风险、主题型基金风险）、股指期货投资风险、其他衍生品投资的风险、证券借贷风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、交易对手的信用风险、

大宗交易风险等。

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

(1) 搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构、建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

(2) 识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

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

## 2、内部控制制度

### (1) 内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行；

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行；

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点；

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部

门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施；

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订；

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞；

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

#### （2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

#### （3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

#### （4）监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

### 3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。



## 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》、基金合同及其他有关规定募集。

准予注册文件：中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕1531号

准予注册日期：2015年7月8日

### （一）基金的类别、运作方式与存续期限

- 1、基金的类别：股票型证券投资基金
- 2、基金的运作方式：契约型开放式
- 3、基金存续期限：不定期

### （二）基金份额的发售时间、方式、对象及目标

#### 1、募集方式

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

以人民币认购的基金份额登记为人民币份额，以美元认购的基金份额登记为美元份额。

目前只有部分销售机构支持美元账户认购业务，具体请参照销售机构的业务规则执行。

#### 2、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以人民币、美元购买证券投资基金相应币种份额的其他投资者。

#### 3、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

#### 4、募集目标

基金最低募集金额（募集资金中的美元应以募集期最后一日中国人民银行公布的人民币对美元汇率中间价折算为人民币）不少于人民币2亿元。

本基金可根据中国证监会、外管局核准的境外投资额度（美元额度需折算为人民币）设定基金募集上限，具体规模限制在基金份额发售公告中约定。

同时，基金管理人可根据实际募集情况向外管局申请追加额度，若获得外管局批准的追

加额度，则募集期内本基金的最终募集规模将以外管局批准的额度为准。

### （三）基金的发售面值、认购价格、认购费用及认购份额的计算

1、本基金人民币份额的发售面值和认购价格为人民币 1.00 元。美元份额发售面值和认购价格为 1.00 元人民币按基金募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算的美元金额，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后三位。

#### 2、认购费用

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。

##### （1）人民币份额认购费率

人民币份额认购采用金额认购的方式，认购费率表如下：

| 认购金额（M）（人民币）        | 认购费率          |
|---------------------|---------------|
| M < 100 万元          | 1.20%         |
| 100 万元 ≤ M < 200 万元 | 0.80%         |
| 200 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.50%         |
| M ≥ 500 万元          | 按笔收取，1000 元/笔 |

##### （2）美元份额认购费率

美元份额认购采用金额认购的方式，认购费率表如下：

| 认购金额（M）（美元）         | 认购费率          |
|---------------------|---------------|
| M < 10 万美元          | 1.20%         |
| 10 万美元 ≤ M < 30 万美元 | 0.80%         |
| 30 万美元 ≤ M < 60 万美元 | 0.50%         |
| M ≥ 60 万美元          | 按笔收取，200 美元/笔 |

基金认购费用用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金财产。

#### 3、认购份额的计算

##### （1）认购人民币份额的计算

认购本基金人民币份额，采用金额认购的方式。

1) 认购费用适用比例费率的情形下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 人民币份额认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额=净认购金额/人民币份额发售面值

利息转份额=认购期间的利息/人民币份额发售面值

认购总份额=认购份额+利息转份额

2) 认购费用适用固定金额的情形下:

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=净认购金额/人民币份额发售面值

利息转份额=认购期间的利息/人民币份额发售面值

认购总份额=认购份额+利息转份额

认购金额在认购期间的利息折算的基金份额,按截尾法保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去归基金财产。认购份额的计算保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者投资 100,000 元人民币认购本基金人民币份额,假设其认购资金在认购期间产生的利息为 10.00 元,其对应的认购费率为 1.20%,则其可得到的认购份额为:

净认购金额 =  $100,000 / (1 + 1.20\%) = 98,814.23$  元

认购费用 =  $100,000 - 98,814.23 = 1,185.77$  元

认购份额 =  $98,814.23 / 1.00 = 98,814.23$  份

利息转份额 =  $10.00 / 1.00 = 10.00$  份

认购总份额 =  $98,814.23 + 10.00 = 98,824.23$  份

即:投资者投资 100,000 元人民币认购本基金人民币份额,假设其认购资金在认购期间产生的利息为 10.00 元,则可得到 98,824.23 份基金份额。

(2) 认购美元份额的计算

认购本基金美元份额,采用金额认购的方式。

1) 认购费用适用比例费率的情形下:

净认购金额=认购金额/(1+美元份额认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=净认购金额/美元份额发售面值

利息转份额=认购期间的利息/美元份额发售面值

认购总份额=认购份额+利息转份额

美元份额发售面值=1.00 元/募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇

率中间价，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后三位，由此产生的误差计入基金资产。

2) 认购费用适用固定金额的情形下：

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=净认购金额/美元份额发售面值

利息转份额=认购期间的利息/美元份额发售面值

认购总份额=认购份额+利息转份额

美元份额发售面值=1.00 元/募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后三位，由此产生的误差计入基金资产。

认购金额在认购期间的利息折算的基金份额，按截尾法保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去归基金财产。认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 10,000 美元认购本基金美元份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为 1.00 美元，其对应的认购费率为 1.20%，募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价为 6.2175，则其可得到的认购份额为：

净认购金额 =  $10,000 / (1+1.2\%) = 9,881.42$  美元

认购费用 =  $10,000 - 9,881.42 = 118.58$  美元

美元份额发售面值 =  $1.00 / 6.2175 = 0.161$  美元

认购份额 =  $9,881.42 / 0.161 = 61,375.27$  份

利息转份额 =  $1.00 / 0.161 = 6.21$  份

认购总份额 =  $61,375.27 + 6.21 = 61,381.48$  份

即：投资者投资 10,000 美元认购本基金美元份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为 1.00 美元，则可得到 61,381.48 份基金份额。

(四) 投资者对基金份额的认购

1、本基金的认购时间安排：具体认购时间安排请见基金份额发售公告。

2、认购应提交的文件和办理手续：投资者认购本基金应首先办理开户手续，开立基金账户（已开立华宝兴业基金管理有限公司基金账户的客户无需重新开户），然后办理基金认购手续。

投资者认购应提交的文件和办理手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

3、认购方式及确认

本基金认购采取金额认购的方式。

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。T日的申请是否有效应以基金登记机构的确认登记为准。投资者应自T+2日起,通过其原认购网点柜台或华宝兴业基金管理有限公司客户服务中心,查询认购申请的受理情况。投资者可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购份额。

投资者认购前,应认真阅读基金管理人及销售机构的业务规则,一旦选择在某销售机构提出认购申请,即视为投资者已完全阅读、理解并认可基金管理人及该销售机构的业务规则,并接受该规则的约束。

#### 4、认购限制

(1) 基金投资者在募集期内可多次认购,但已受理的认购申请不得撤销。

(2) 投资者认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

(3) 在募集期内,投资者认购本基金人民币份额时,在基金管理人直销e网金和其他销售机构每笔认购最低金额为100元人民币(含认购费);认购美元份额时,每笔认购最低金额为1,000美元(含认购费)。在基金管理人直销柜台首次认购人民币份额最低金额为10万元人民币(含认购费),追加认购人民币份额的最低金额为每笔100元人民币(含认购费)。已在基金管理人直销柜台购买过基金管理人管理的其他基金的投资者,不受直销柜台首次认购最低金额的限制,但受追加认购最低金额的限制。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

认购美元份额的投资者需注意,在现钞认购的情况下,投资者应将美元资金从现钞账户转入现汇账户,相应费用(若有)由投资者自行承担。由于美元资金的划款时间较长,投资者认购美元份额时,其认购申请的提交日和认购申请受理日可能有所不同。

(4) 募集期间的单个投资者的累计认购金额不设上限。

(五) 募集期利息的处理方式

本基金的有效认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后将折算为基金份额,归基金份额持有人所有。其中利息转份额以登记机构的记录为准。

(六) 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、基金的备案

### （一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集金额不少于2亿元人民币（募集资金中的美元应以募集期最后一日中国人民银行公布的人民币对美元汇率中间价折算为人民币）且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将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。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）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，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值（美元份额所对应的基金资产净值需按计算日中国人民银行公布的人民币对美元汇率中间价折算为人民币）低于5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

本基金同时设立人民币份额和美元份额。人民币份额以人民币计价并进行申购、赎回；美元份额以美元计价并进行申购、赎回。基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，增设以其它销售币种计价的基金份额以及接受其它销售币种基金份额的申购、赎回，其他销售币种基金份额申购、赎回的原则、费用等届时由基金管理人确定并提前公告。

### （一）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。各类基金份额的销售机构或有不同。具体的销售网点将由基金管理人在基金份额发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。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。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

上海证券交易所、深圳证券交易所和本基金投资的主要境外市场同时开放交易的工作日为本基金的开放日，投资者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基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。如本基金投资的主要境外市场遇节假日、休市或暂停交易，基金管理人将决定本基金是否暂停申购或赎回。

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介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日对应份额类别的基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的对应份额类别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，即按照投资者认购、申购、转托管时基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；

5、“分币种申赎”原则，即以人民币申购获得人民币份额，赎回人民币份额获得人民币赎回款，以美元申购获得美元份额，赎回美元份额获得美元赎回款，依此类推。

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开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资者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

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在 T+10 日(包括该日)内支付赎回款项。如遇外管局相关规定有变更、本基金所投资市场或外汇市场暂停交易、延迟支付赎回款项或交易清算规则发生变更等特殊情况下，赎回款项支付时间可相应调整。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照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+2日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资者应在T+3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者。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述业务的确认及办理的时间和程序进行调整,并提前公告。

#### (五) 申购与赎回的数量限制

##### 1、申请申购基金的金额

通过基金管理人直销 e 网金和其他销售机构申购本基金人民币份额时,单笔最低金额为 100 元人民币(含申购费);申购美元份额时,每笔申购最低金额为 1,000 美元(含申购费)。通过基金管理人直销柜台首次申购本基金人民币份额的最低金额为 10 万元人民币(含申购费),追加申购最低金额为每笔 100 元人民币(含申购费)。已在基金管理人直销柜台购买过基金管理人管理的其他基金的投资者,不受直销柜台首次申购最低金额的限制,但受追加申购最低金额的限制。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

申购美元份额的投资者需注意,在现钞申购的情况下,投资者应将美元资金从现钞账户转入现汇账户,相应费用(若有)由投资者自行承担。由于美元资金的划款时间较长,投资者申购美元份额时,其申购申请的提交日和申购申请受理日可能有所不同。

其他销售机构的投资者欲转入基金管理人直销柜台进行交易,要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整首次申购的最低金额。

##### 2、申请赎回基金的份额

投资者可将其全部或部分基金份额赎回,本基金按照份额进行赎回。人民币份额单笔赎回份额不得低于 100 份。人民币份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的人民币份额余额不足 100 份的,在赎回时必须一次全部赎回。美元份额单笔赎回份额不得低于 1,000 份。美元份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的美元份额余额不足 1,000 份的,在赎回时必须一次全部赎回。

3、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。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购费与赎回费

##### 1、申购费用

本基金采取前端收费模式收取基金申购费用。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。

##### （1）人民币份额申购费用

本基金人民币份额的申购费率表如下：

| 申购金额(M)(人民币)    | 申购费率          |
|-----------------|---------------|
| M<100 万元        | 1.50%         |
| 100 万元≤M<200 万元 | 1.00%         |
| 200 万元≤M<500 万元 | 0.50%         |
| M≥500 万元        | 按笔收取，1000 元/笔 |

##### （2）美元份额申购费用

本基金美元份额的申购费率表如下：

| 申购金额(M)(美元)     | 申购费率          |
|-----------------|---------------|
| M<10 万美元        | 1.50%         |
| 10 万美元≤M<30 万美元 | 1.00%         |
| 30 万美元≤M<60 万美元 | 0.50%         |
| M≥60 万美元        | 按笔收取，200 美元/笔 |

申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

##### 2、赎回费用

本基金人民币份额和美元份额的赎回费率表如下：

| 持有基金份额期限          | 赎回费率(%) |
|-------------------|---------|
| 小于 7 日            | 1.50%   |
| 大于等于 7 日, 小于 30 日 | 0.75%   |
| 大于等于 30 日, 小于 1 年 | 0.50%   |
| 大于等于 1 年, 小于 2 年  | 0.25%   |
| 大于等于 2 年          | 0       |

注：此处一年按 365 日计算

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于收取的持续持有期少于 30 日的投资者的赎回费, 基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于 30 日但少于 3 个月的投资者的赎回费, 基金管理人将不低于其总额的 75% 计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于 3 个月但少于 6 个月的投资者的赎回费, 基金管理人将不低于其总额的 50% 计入基金财产。对持续持有期长于 6 个月的投资者, 应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产, 其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

注：此处 1 个月按 30 日计算

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式, 并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 按相关监管部门要求履行必要手续后, 基金管理人可以适当调低申购费率和赎回费率。

#### (七) 申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

##### 1、申购份额的计算方式

###### (1) 申购人民币份额的计算方式

申购本基金人民币份额均采用金额申购的方式, 申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率的情形下:

净申购金额=申购金额/(1+人民币份额申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日人民币份额净值

申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T日人民币份额净值

申购人民币份额的计算按截尾法，留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例：某投资者投资 100,000 元申购本基金人民币份额，对应的申购费率为 1.50%，假定申购当日人民币份额净值为 1.086 元，该投资者可得到的基金份额为：

净申购金额 =  $100,000 / (1 + 1.50\%) = 98,522.17$  元

申购费用 =  $100,000 - 98,522.17 = 1,477.83$  元

申购份额 =  $98,522.17 / 1.086 = 90,720.23$  份

即：投资者投资 100,000 元申购本基金人民币份额，假定申购当日基金份额净值为 1.086 元，可得到 90,720.23 份人民币份额。

## (2) 申购美元份额的计算方式

申购本基金美元份额采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率的情形下：

净申购金额=申购金额/（1+美元份额申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日美元份额净值

申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T日美元份额净值

申购美元份额的计算按截尾法，留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例：某投资者投资 10,000 美元申购本基金美元份额，对应的申购费率为 1.50%，假定申购当日美元份额净值为 0.183 美元，该投资者可得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.50\%) = 9,852.22 \text{ 美元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 美元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 0.183 = 53,837.26 \text{ 份}$$

即：投资者投资 10,000 美元申购本基金美元份额，假定申购当日美元份额净值为 0.183 美元，可得到 53,837.26 份美元份额。

## 2、赎回金额的计算方式

本基金赎回均采用份额赎回的方式。赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回 10,000 份本基金人民币份额，持有时间为一年三个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日人民币份额净值是 1.152 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.152 = 11,520 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,520 \times 0.25\% = 28.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,520 - 28.80 = 11,491.20 \text{ 元}$$

即：投资者赎回 10,000 份本基金人民币份额，持有期限为一年三个月，假设赎回当日人民币份额净值是 1.152 元，则其可得到的赎回金额为 11,491.20 元。

3、本基金分别计算人民币份额和美元份额的基金份额净值。人民币份额净值和美元份额净值的计算分别精确到 0.001 元和 0.001 美元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金份额净值应当在估值日后 2 个工作日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## （八）申购与赎回的登记

1、投资者 T 日申购成功后，正常情况下，登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办

理登记手续，投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资者 T 日赎回成功后，正常情况下，登记机构在 T+2 日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

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。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

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受投资者的申购申请。

3、本基金投资所处的证券交易所或外汇市场正常或非正常停市，可能影响本基金投资，或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，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、基金管理人管理的境外证券投资基金的资产规模达到监管机构核定的本基金管理人境外证券投资额度。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1-3、5-8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 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受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、基金投资所处的证券交易所或外汇市场正常或非正常停市，可能影响本基金投资，或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、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，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。在计算单个赎回申请人的赎回申请量所代表的基金资产净值和赎回申请总量所代表的基金资产净值时，美元份额所代表部分依据当日适用的汇率折算为人民币。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。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的份额总数的10%，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据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者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投

投资者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；对于未能受理部分，投资者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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者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，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

#### (十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日各类基金份额的基金份额净值。如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停公告的次数，并应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个估值日各类基金份额的基金份额净值。

#### (十三) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。



#### （十四）基金的非交易过户

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。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者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指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。

#### （十五）基金份额的转托管

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

#### （十六）定期定额投资计划

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

#### （十七）基金份额的冻结和解冻

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。

#### （十八）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## 九、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，含境外托管代理行收取的费用；
- 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、税务顾问费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记、存管等各项费用）；
- 7、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 8、基金依照有关法律法規应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、除基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；
- 11、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 12、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 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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 0.35% 的年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—12 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。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人应按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

### （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。

### （四）基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。基金管理人对于最终税务的处理的真实准确负责。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规和境外市场的规定执行。

## 十、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买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。基金托管人可委托境外托管人根据基金财产所在地法律法规、证券/期货交易规则、市场惯例以及其与基金托管人签订的协议为本基金在境外开立资金账户、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、境外托管人、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）基金财产的保管和处分

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，并由基金托管人或境外托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人、境外托管人、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。

## 十一、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金的开放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。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、基金、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）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、存托凭证、ETF基金等），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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的债券，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

#### 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和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（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固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、开放式基金的估值以其在估值日公布的净值进行估值，开放式基金未公布估值日净值的，以估值日前最新的净值进行估值。

5、因持有股票而享有的配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若配股权证可以在交易所交易，则按照1中确定的方法进行估值；不能在交易所交易的配股权证，如果收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，如果收盘价低于或等于配股价，则估值为零。

6、基金持有的衍生品等其他有价证券，上市交易的，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

#### 7、汇率

本基金外币资产价值计算中，所涉及人民币对主要外汇的汇率应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

#### 8、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。基金管理人最终对税务处理的真实准确负责。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

9、在任何情况下，基金管理人如采用上述第 1-8 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。

10、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。

11、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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值程序

1、本基金分别计算并披露不同币种基金份额对应的基金份额净值。人民币份额净值和美元份额净值的计算分别精确到 0.001 元和 0.001 美元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2、基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人每个估值日的下一工作日内计算估值日的基金份额净值，并将各类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，由基金管理人按约定对外公布。

3、在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值（含人民币份额或美元份额的基金份额净值，下同）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。

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、或投资者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。

### (六) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场、外汇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估值时间点计算基金资产净值和各类基金份额净



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，由基金管理人按约定对基金资产净值和各类基金份额净值予以公布。

#### （八）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

3、由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在本基金管理人和本基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。

4、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司或数据供应商发送的数据错误等原因，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应免除赔偿责任。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或减轻由此造成的影响。

## 十二、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；

2、本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对某一基金份额类别，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则美元份额以美元进行现金分红，人民币份额以人民币进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按除息日（具体以届时的基金分红公告为准）该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；

4、基金收益分配后人民币份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日人民币份额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；对于美元份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后美元份额的基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；

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 日内在指定媒介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）基金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。

## 十三、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日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 十四、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》、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介上；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注册后，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》摘要登载在指定媒介上；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介上。

## 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介上登载《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各类基金份额的基金份额净值。

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估值日后2个工作日内，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额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各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

## 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各类基金份额申购、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介上。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介上。

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介上。

《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 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、境外托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人、境外托管人的法定名称、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) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

- (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办理；
- (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) 本基金增设除人民币、美元以外币种的基金份额；
- (27) 基金推出新业务或服务；
- (28) 中国证监会规定的和基金合同约定的其他事项。

## 8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介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，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

## 10、中国证监会规定的其他信息。

本基金投资股指期货，基金管理人应当在基金季度报告、基金半年度报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持



证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （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、各类基金份额净值、各类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介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介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，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 10 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。

## 十五、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。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自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告，并在决议生效5日内报中国证监会备案。

### （二）《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。

### （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) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 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。

(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。

## 十六、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。于 2014 年末，中国建设银行市值约为 2,079 亿美元，居全球上市银行第四位。

于 2014 年末，本集团资产总额 167,441.30 亿元，较上年增长 8.99%；客户贷款和垫款总额 94,745.23 亿元，增长 10.30%；客户存款总额 128,986.75 亿元，增长 5.53%。营业收入 5,704.70 亿元，较上年增长 12.16%；其中，利息净收入增长 12.28%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入占营业收入比重为 19.02%；成本收入比为 28.85%。利润总额 2,990.86 亿元，较上年增长 6.89%；净利润 2,282.47 亿元，增长 6.10%。资本充足率 14.87%，不良贷款率 1.19%，拨备覆盖率 222.33%。

客户基础进一步夯实，全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增 11 万户和 68 万户，个人有效客户新增 1,188 万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到 1.37 万个，综合柜员占比达到 80%，综合营销团队 1.75 万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过 1.45

万个营业网点 30 类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高 60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销 3,989.83 亿元，承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增 188.32 亿元和 62.34 万户。投资托管业务规模增幅 38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破 1 万个、结算量达 1.46 万亿元。信用卡累计发卡量 6,593 万张，消费交易额 16,580.81 亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长 14.18%，金融资产增长 18.21%。

2014 年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。在英国《银行家》杂志 2014 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额位列全球第 2；在英国《金融时报》全球 500 强排名第 29 位，新兴市场 500 强排名第 3 位；在美国《福布斯》杂志 2014 年全球上市公司 2000 强排名中位列第 2；在美国《财富》杂志世界 500 强排名第 38 位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总

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

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年6月末，中国建设银行已托管514只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

#### （二）基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

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

##### 2、内部控制组织结构

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

##### 3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职

责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督方法

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

#### 2、监督流程

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

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

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

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

## 十七、境外托管人

### （一）境外托管人的基本情况

名称：道富银行 State Street Bank and Trust Company

注册地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

办公地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

法定代表人：Joseph L. Hooley

成立时间：1792 年

最近一个会计年度（截至 2014 年 12 月 31 日）所有者权益（Shareholder's Equity）：  
214.73 亿美元

### （二）托管资产规模、国际信用评级和托管业务

道富银行的全球托管业务由美国道富集团全资拥有。道富银行始创于 1792 年，自 1924 年成为美国第一个共同基金的托管人后，道富银行已成为一家具有领导地位的国际托管银行。截至 2014 年 12 月 31 日，道富银行的托管和管理资产总规模为 28.2 万亿美元，长期存款信用评级为 AA-（标准普尔）及 Aa3（穆迪投资），实力雄厚。

道富银行在全球 29 个国家或地区设有办事处，并拥有超过 2 万 9 千多名富有经验的员工为客户提供全方位的托管服务。在亚洲开设了四个全方位的营运中心：香港、新加坡、东京及悉尼，提供全球托管、基金会计、绩效评估、投资纲领监察报告、外汇交易、证券出借、基金转换管理、受托人和注册登记等服务。

### （三）境外托管人的职责

- 1、安全保管受托财产；
- 2、计算境外受托资产的资产净值；
- 3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- 4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
- 5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
- 6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；
- 7、其他由基金托管人委托其履行的职责。



## 十八、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）直销柜台

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：郑安国

直销柜台电话：021-38505731、38505732、021-38505888-301 或 302

直销柜台传真：021-50499663、50988055

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

##### （2）直销 e 网金

投资者可以通过华宝兴业基金管理有限公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的认/申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅华宝兴业基金管理有限公司网站公告。网上交易网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)。

#### 2、其他销售机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（2）其它销售机构情况详见基金份额发售公告及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

### （二）登记机构

名称：华宝兴业基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

电话：021—38505888

传真：021—38505777

联系人：章希

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国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：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：张勇

经办注册会计师：汪棣、张勇

## 十九、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金管理人

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) 依法募集资金；
- (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) 按照规定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检查；
- (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) 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；
- (14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (15) 在符合有关法律、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，开通人民币、美元之外的其他销售币种基金份额的申购、赎回等

业务；

- (16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 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) 依法募集资金，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；基于谨慎的原则，控制基金资产的流动性风险，保证基金资产正常运作；
    - (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) 确保基金管理人发送的交易数据符合《基金法》、《试行办法》、《基金合同》及其他有关规定，并保证该数据真实、准确、完整；
    - (10) 确保基金管理人向基金托管人发送的基金认购、申购和赎回数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据的真实、准确和完整；
    - (11) 委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；
    - (12) 与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行；
    - (13) 进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；
    - (14) 如需在基金托管人选择的机构之外保管、登记基金财产，应严格审查，保证基金财产的安全，以及相关资产收益准确、按时归入基金财产；

- (15) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
- (16) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- (17) 编制季度、半年度和年度基金报告;
- (18) 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;
- (19) 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;
- (20) 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;
- (21) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- (22) 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;
- (23) 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;
- (24) 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;
- (25) 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;
- (26) 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;
- (27) 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;
- (28) 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;
- (29) 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;
- (30) 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;
- (31) 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;

- (32) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (33) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (34) 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

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》的规定安全保管可以保管的基金财产；

(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) 选择、更换或撤销境外托管人；

(8) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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、各类基金份额申购、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) 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议；

(22) 对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；

(23) 保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

(24) 安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取应得收入；

(25) 每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，

并按相关规定进行国际收支申报；

(26) 办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

(27) 保存基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(28) 按照规定监督基金管理人的投资运作，确保基金按照有关法律法规和基金合同约定的投资目标和限制进行管理；

(29) 按照有关法律法规和基金合同的约定执行基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

(30) 确保基金的份额净值按照有关法律法规和基金合同规定的方法进行计算；

(31) 确保基金按照有关法律法规和基金合同的规定进行申购、认购、赎回等日常交易；

(32) 确保基金根据有关法律法规和基金合同确定并实施收益分配方案；

(33) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务以及外管局根据审慎监管原则规定的基金托管人的其他职责。

### (三) 基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼



或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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议；

(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。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 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（法律法规、中国证监会另有规定约定的除外）；

(6) 变更基金类别（《基金合同》另有约定的除外）；

(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（法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；

- (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、调低赎回费率或在现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (6) 不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，本基金通过指定的销售机构开通除人民币、美元以外的其他销售币种基金份额的申购、赎回等业务；
- (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。

## （二）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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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，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。

### （三）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 30 日，在指定媒介公告。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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）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等法律法规或监管机构允许的其他方式召开，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，基金管理人或基金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二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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会议通知载明的形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。

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，在两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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，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二分之一（含二分之一）。若本人直接出具意见或授权他人代表出具意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分

之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具意见或授权他人代表出具意见；

（4）上述第（3）项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具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，并与基金登记机构记录相符。

3、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行，具体方式由会议召集人在会议通知中列明。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

5、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。

#### （五）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二分之一以上（含二分之一）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 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 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。

## （六）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二分之一以上（含二分之一）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》、与其他基金合并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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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。

## （七）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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会按照《基金法》第八十七条的规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。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。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### (一) 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。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自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告，并在决议生效5日内报中国证监会备案。

## （二）《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。

## （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）对基金剩余财产进行分配。

### 5、基金财产清算的期限为6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。

#### （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。

### 四、争议解决方式

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，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，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《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、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

名称：华宝兴业基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200122

法定代表人：郑安国

成立日期：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理

收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为依法发行上市的股票、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、创业板及其他依法上市的股票）、股指期货、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、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷；证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF）；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生品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相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于互联网主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有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%。

本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场，其中境外市场包括：美国和中国香港特别行政区。其中，投资各个市场股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例上限如下：境内市场为 95%，美国为 95%，香港特别行政区为 95%。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

### （1）组合限制：

1) 本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于互联网主题相关股

票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

2) 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；

3) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 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%；

5) 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%；

6) 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%；

7) 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%；

8) 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%；

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

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

11) 本基金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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

12) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

13) 本基金在境内投资中，参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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

b) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

d) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

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

14) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中境外投资中，银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

15) 本基金在境外投资中，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

16) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前述非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

17) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。持有货币市场基金可以不受上述限制；

18) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

19) 本基金境外投资中，投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

a) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

b) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%；

c) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

① 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

② 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③ 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

④ 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告；

⑤ 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

20) 本基金境外投资中，可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

a) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；

b) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%;

c) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。

一旦借方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要;

d) 除中国证监会另有规定外, 担保物可以是以下金融工具或品种:

① 现金;

② 存款证明;

③ 商业票据;

④ 政府债券;

⑤ 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证;

e) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券;

f) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

21) 本基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易, 并且应当遵守下列规定:

a) 所有参与正回购交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级;

b) 参与正回购交易, 应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要;

c) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红;

d) 参与逆回购交易, 应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要;

e) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

22) 基金参与证券借贷交易、正回购交易, 所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前述比例限制计算, 基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

23) 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 10%; 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 2%。

24) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前, 应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的, 本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行; 法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的, 则基金管理人应与基金托管协商一致后, 可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行, 而无需基金份额持有人大会审议决定, 但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前, 应并向监管机关更新本基金注册或备案, 并在实施前向投资者履行信息披露义务。

因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人根据《托管协议》对基金的投资进行监督和检查, 对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 对本托管协议第十七条第九款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

4、基金托管人履行本条第 2 项及第 3 项监督义务的方式为事后监督。于估值日结束且相关数据齐备后, 对基金管理人基金投资禁止行为进行交易后的投资监督和报告。即基金托管人履行上述监督义务的方式仅限于在发现基金管理人已经执行完毕的投资指令违反上述约定后, 按照本协议约定通知基金管理人和/或监管部门。

5、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先的原则, 防范利益冲突, 符合中国证监会的规定, 并事先得到基金托管人的同意。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分

配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

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

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

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

### （三）基金管理人对其基金托管人的业务核查

1、基金管理人对其基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值、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、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《试行办法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事



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

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

#### （四）基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

- （1）基金财产应保管于基金托管人或基金托管人委托或同意存放的机构处。
- （2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人的固有财产。
- （3）基金托管人应安全保管基金财产。
- （4）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。
- （5）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。
- （6）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，并按指令进行结算，如有特殊情况双方可另行协商解决。

（7）基金托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘或破产等原因进行终止清算时，不得将托管证券及其收益归入其清算财产；基金管理人和基金托管人理解现金于存入现金账户时构成基金托管人、境外托管人的等额债务，除非法律法规及撤销或清盘程序明文许可该等现金不归于清算财产外，该等现金归入清算财产并不构成基金托管人违反托管协议的规定。

（8）基金托管人自身，并尽商业上的合理努力尽量确保境外托管人不得自行运用、处分、分配托管证券。

（9）除非根据基金管理人书面同意，基金托管人自身，并应尽商业上的合理努力尽量确保境外托管人不得在任何基金资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等，但根据基金财产所在地法律法规的规定而产生的担保权利除外。

##### 2、基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

（2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份

额持有人人数符合《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《试行办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

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

### 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。基金托管人可委托境外托管人开立资金账户（境外），境外托管人根据基金托管人的指令办理境外资金收付。

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

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监督管理机构的有关规定。

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

### 4、基金证券账户的开立和管理

基金托管人委托境外托管人在境外，根据当地市场法律法规规定，开立和管理基金证券账户。

### 5、其他账户的开立和管理

(1) 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助基金托管人或其委托机构根据投资所在国家或地区有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。

(2) 投资所在国家或地区法律法规对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

### 6、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的境外有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人委托境

外托管人存放于保管库。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 7、基金财产投资银行存款的保管责任与风险提示

(1) 基金管理人负责对本基金存款银行的评估与研究，建立健全银行定期存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。

1) 基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。

2) 基金管理人负责控制流动性风险，并承担因控制不力而造成的损失。流动性风险主要包括基金管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取而存款银行未能及时兑付的风险、基金投资银行存款不能满足基金正常结算业务的风险、因全部提前支取或部分提前支取而涉及的利息损失影响估值等涉及到基金流动性方面的风险。

3) 基金管理人须加强内部风险控制制度的建设。如因基金管理人员的个人行为导致基金财产受到损失的，需由基金管理人承担由此造成的损失。

4) 基金管理人投资银行存款时，应就相关事宜在更新招募说明书中予以披露，进行风险揭示。

基金托管人负责对本基金银行定期存款业务的监督与核查，审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(2) 基金管理人在投资银行存款之前，需与存款银行总行(本基金托管人除外)或其授权分行签订总体合作协议。如将资金存放于存款银行总行，则应与其签订具体存款协议；如将资金存放于其授权分行书面指定的分支机构，则存款银行总行应出具承诺函确认对存款承担偿付义务，承诺函中需明确定期存款的金额、期限、利率、具体存款银行名称等与基金定期存款有重要关系的事项，并由存款银行签订具体存款协议。具体存款协议应包括但不限于以下内容：

1) 存款账户必须以基金名义开立，并加盖本基金公章和基金管理人公章，账户名称为基金名称。

2) 协议须约定存款类型、期限、利率、金额、账号、起止时间，存款银行经办行名称、地址及进款账户。

3) 协议须约定基金托管人经办行名称、地址和账户，且本基金账户为唯一回款账户。

4) 资金汇划须通过人民银行支付结算系统，存款银行经办行须满足基金托管人的查询

要求，在查复内容中须明确资金到账时间、金额、所入账户名称、账号。

5) 定期存款存续期间，存款银行经办行须向基金托管人提供实时查询定期存款余额的途径并确保查询。

6) 未支取存款受损责任由存款银行承担。

7) 如办理定期存款凭证挂失，须由经基金管理人和基金托管人分别授权的人员持授权委托书共同办理。

8) 为防范特殊情况下的流动性风险，存款银行须提供部分提前支取时的支付保证承诺和利息计付等具体安排。

9) 需要由存款银行提供上门送、取单服务的，应在存款协议中明确，存款银行对存款证实书的真实性负责，并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。

(3) 办理基金投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取，可采取以下方式：

1) 由基金管理人和基金托管人的授权代表持授权委托书共同全程办理，基金管理人上述事项被授权人员与基金管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。

2) 由存款银行提供上门送、取单服务。存款银行要事先指定经办人员，提供经办人员的姓名、身份证号码。在上门送、取单时，存款银行经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便资产托管人进行核查。

(4) 本基金投资于银行存款后，基金管理人全部提前支取、部分提前支取或到期支取时，需提前发送投资指令到基金托管人处，以便基金托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。如基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款，基金管理人负责补足已提取资金部分的息差(即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额)。如发生逾期支取，基金托管人不承担相应利息损失及逾期支取手续费。

(5) 本基金投资定期存款的期限不得超过一年(含一年)，且到期后不得展期。

(6) 本基金投资于银行存款时，应本着便于基金的安全保管和日常监督核查的原则，尽量选择基金托管人营业地址所在地的分支机构。

(7) 基金管理人选择的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、

与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。基金管理人与期货经纪商签订的有关金融衍生产品的合同，应该发送复印件给基金托管人，以便基金托管人保存完整的基金档案资料。

#### （五）基金资产净值计算与复核

##### 1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债的金额。基金份额净值是按照每个估值日基金资产净值除以基金份额的余额数量计算，人民币基金份额净值和美元基金份额净值的计算分别精确到 0.001 元和 0.001 美元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

##### （2）复核程序

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的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估值日估值时间点计算基金资产净值并发送给基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。

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

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

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

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

规另有规定，有权机关另有要求。

#### （七）争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

#### （八）托管协议的修改与终止

##### 1、托管协议的变更程序

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

##### 2、基金托管协议终止出现的情形

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

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人有权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及内容。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

投资者更改个人信息资料，请及时到原开立华宝兴业基金账户的销售网点更改。

在从销售机构获取准确的客户地址、邮编和电子邮箱地址的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

#### 1、基金投资者对账单

基金管理人将在每月度结束后的3个工作日内，向已经定制了电子对账单服务的基金份额持有人提供电子对账单。如基金份额持有人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打基金管理人客服电话400-700-5588（免长途话费）、021-38924558，按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金份额持有人免费邮寄纸质对账单。

#### 2、其他相关的信息资料

基金管理人以说明或电子形式向投资者寄送基金其他信息资料。

### （二）红利再投资

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

### （三）定期定额投资计划

本基金可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务，即投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则将在本基金开放申购赎回后公告。

### （四）基金转换

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

### （五）在线服务

基金管理人利用基金管理人的网站（www.fsfund.com）为基金投资者提供网上查询、网

上资讯服务。

#### （六）资讯服务

1、投资者如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人如下电话：

电话呼叫中心：4007005588，021-38924558该电话可转人工座席。

直销柜台电话：021-38505888-301或302、38505731、38505732

传真：021-50499663、50988055

#### 2、互联网站

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

电子信箱：[fsf@fsfund.com](mailto:fsf@fsfund.com)

#### （七）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉。

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人客户服务热线。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。



## 二十二、其他应披露事项

暂无。

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书公布后，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。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

- (一) 中国证监会准予华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

2015年8月19日