

# 汇丰晋信龙腾混合型 证券投资基金

## 更新招募说明书 (2019 年第 1 号)

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 【重要提示】

汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2006 年 8 月 16 日证监基金字【2006】157 号文批准发起设立。本基金基金合同于 2006 年 9 月 27 日正式生效。

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

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2019 年 3 月 27 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

# 目录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	10
四、基金托管人.....	20
五、相关服务机构.....	25
六、基金的募集.....	46
七、基金合同的生效.....	50
八、基金份额的申购与赎回.....	51
九、基金的转换.....	61
十、基金的非交易过户与转托管.....	62
十一、基金份额的冻结、解冻及质押.....	63
十二、定期定额投资计划.....	64
十三、基金的投资.....	65
十四、基金的业绩.....	78
十五、基金的财产.....	81
十六、基金财产的估值.....	83
十七、基金的收益与分配.....	91
十八、基金的费用和税收.....	93
十九、基金的会计与审计.....	95
二十、基金的信息披露.....	96
二十一、风险揭示.....	100
二十二、基金合同的终止和基金财产的清算.....	103
二十三、基金合同的内容摘要.....	105
二十四、基金托管协议的内容摘要.....	122
二十五、对基金份额持有人的服务.....	138
二十六、其他应披露事项.....	141
二十七、招募说明书的存放及查阅方式.....	142
二十八、备查文件.....	143

## 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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)以及《汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。基金投资人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。基金投资人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

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：**指汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金；
- 基金合同** 指《汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金基金合同》及对该合同的任何有效修订和补充；
- 招募说明书或本招募说明书：**指《汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金招募说明书》；
- 更新的招募说明书** 指汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金更新的招募说明书，即按相关法律法规的规定对招募说明书进行的更新；
- 托管协议：**指《汇丰晋信龙腾混合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；
- 业务规则** 指《汇丰晋信基金管理有限公司基金业务规则》；
- 发售公告：**指《汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金基金份额发售公告》；
- 中国证监会：**指中国证券监督管理委员会；
- 中国银监会：**指中国银行业监督管理委员会；
- 《基金法》：**指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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，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》及立法机关对其不时做出的修订；
- 《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》；
- 《销售办法》：**指中国证监会2013年3月15日颁布、同年7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》;
- 《流动性风险管理规定》:** 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 元:** 指人民币元;
- 基金合同当事人:** 指受本基金合同约定, 根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体, 包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人;
- 基金管理人:** 指汇丰晋信基金管理有限公司;
- 基金托管人:** 指交通银行股份有限公司;
- 基金份额持有人:** 指依照法律法规或基金合同合法取得基金份额的投资人;
- 注册登记业务:** 指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务。具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算和结算、基金销售业务交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;
- 注册登记人:** 指办理基金注册登记业务的机构, 本基金的注册登记人为汇丰晋信基金管理有限公司;
- 投资人:** 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者;
- 个人投资者:** 指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人;
- 机构投资者:** 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织;
- 合格境外机构投资者:** 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定, 经中国证监会批准可以投

资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者；

**基金份额持有人大会：**指按照基金合同之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；

**基金募集期：**指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月；

**基金合同生效日：**指基金募集期满，基金募集的基金份额总额超过核准的最低募集份额总额，并且基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；

**基金合同终止日：**指本基金合同规定的合同终止事由出现后按照本基金合同规定的程序终止基金合同的日期；

**存续期：**指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；

**工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

**认购：**指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；

**申购：**指在本基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为；

**赎回：**指基金份额持有人按本基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；

**巨额赎回：**指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日本基金总份额10%的情形；

**流动性受限资产：**指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在

10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；

- 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的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为；
- 转托管：**指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金份额从一个销售机构托管转移到另一销售机构的行为；
- 费用类别：**指将基金份额持有人持有的基金份额依据其选择以前端或后端收费方式缴纳认购/申购费用所划分成的不同份额级别类型；
- 投资指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
- 代销机构：**指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构；
- 销售机构：**指基金管理人及本基金代销机构；
- 基金销售网点：**指基金管理人的投资理财中心及基金代销机构的代销网点；
- 指定媒体：**指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；
- 基金账户：**指注册登记人为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：**指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 开放日：**指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的



	日期;
<b>T 日:</b>	指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期;
<b>T+n日:</b>	指T日后(不包括T日)第n个工作日
<b>基金收益:</b>	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入;
<b>基金资产总值:</b>	基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。
<b>基金资产净值:</b>	指基金资产总值减去基金负债后的价值;
<b>基金份额净值</b>	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数后得出的基金份额的财产净值;
<b>基金财产估值:</b>	指计算评估基金财产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;
<b>法律法规:</b>	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
<b>不可抗力:</b>	指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

## 三、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

法定代表人：杨小勇

成立时间：2005年11月16日

电话：021-20376868

联系人：周慧

注册资本：2亿元人民币

股权结构：山西信托股份有限公司（以下简称“山西信托”）持有51%的股权，HSBC Global Asset Management (UK) Limited（汇丰环球投资管理（英国）有限公司）持有49%的股权。

### （二）主要人员情况

#### （1）董事会成员

杨小勇先生，董事长，硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资（集团）公司副总经理，山西光信实业有限公司副董事长，山西省国信投资（集团）公司党委书记、山西信托副董事长，晋商银行股份有限公司党委副书记、副行长（正职待遇）。现任山西金融投资控股集团有限公司专职党委副书记、副总经理（正职待遇）。

郭晋普先生，董事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司房地产开发部、投资实业总部副总经理，太原万丰房地产发展有限公司总经理，山西国际贸易中心有限公司总经理、董事长，山西信托董事长，山西国信投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

柴宏杰先生，董事，本科学历。曾任长治银监分局办公室主任、党委办公室主任，晋商银行股份有限公司董事会办公室主任、大同分行行长，山西省国信投

资（集团）公司董事会办公室主任兼党委办公室主任、中合盛资本管理有限公司董事、董事长，山西国信投资集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理，山西金融投资控股集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理，山西省国有资本投资运营有限公司总经理助理兼资本运营部负责人。现任山西省国有资本投资运营有限公司总经理助理兼资本运营部负责人。

李选进，董事，硕士学历。曾任怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监，汇丰投资管理（香港）董事兼亚太区企业拓展及中国事业主管，汇丰晋信基金管理有限公司总经理、董事。现任汇丰中华证券投资信托股份有限公司董事长。

巴培卓（Pedro Augusto Botelho Bastos）先生，董事。曾任汇丰环球投资管理（巴西）行政总裁、汇丰环球投资管理（拉丁美洲）首席投资官、行政总裁。现任汇丰环球投资管理亚太行政总裁。

王栋先生，董事。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师（CFA）。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理。

常修泽先生，独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长，国家发改委经济研究所常务副所长、教授、博士研究生导师。现任清华大学中国经济研究中心研究员。

梅建平先生，独立董事，博士学历。曾任纽约大学金融学副教授、芝加哥大学访问副教授、阿姆斯特丹大学访问副教授、清华大学特聘教授、长江商学院EMBA项目副院长、金融学教授。现任长江商学院金融学教授。

叶迪奇，独立董事，硕士学历。曾担任汇丰银行（美国）西岸业务副总裁，汇丰银行（香港）零售部主管、汇丰银行中国总代表处中国业务总裁、交通银行副行长、国际金融协会（IIF）亚太区首席代表。现任星展银行（香港）有限公司独立董事。

## （2）监事会成员基本情况：

焦杨先生，监事，硕士学历。曾任山西信托副总经理兼资金管理部经理，常

务副总经理，山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理。现任山西金融投资控股集团有限公司运营总监兼资本运营部总经理，山西证券股份有限公司监事会主席，山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席。

廖宜建，监事，本科学历。曾任职于日本兴业银行（现为瑞穗国际），1997年加入汇丰负责大中华区及新加坡的本地外汇、利率及债券市场业务，后先后担任汇丰中国地区司库、汇丰中国环球银行及资本市场总监、汇丰银行（中国）有限公司副行长。现任汇丰银行（中国）有限公司行长兼行政总裁。

曹菁女士，监事，硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理、汇丰晋信基金管理有限公司人事经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

侯玉琦先生，监事，硕士学历。曾任山西信托及山西省国信投资（集团）公司担任交易员及投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员，现任汇丰晋信基金管理有限公司股票基金经理。

### （3）总经理及其他高级管理人员基本情况：

王栋先生，总经理，硕士学历。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师（CFA）。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。

闫太平先生，副总经理，本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托副处长、国际金融部经理。

王立荣先生，副总经理，硕士学历。曾任山西信托固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监；上海万方投资管理有限公司副总经理；汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

赵琳女士，副总经理，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金注册部副总监；中银基金管理有限公司基金运营部总监；汇丰晋信基金管理有限公司基金运营部总监；现任汇丰晋信基金管理有限公司首席运营官。

张毅杰先生，副总经理，硕士学历。曾任招商基金管理有限公司华东业务发展经理、天同基金管理有限公司机构理财部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司

总经理助理、直销业务部总监。

古韵女士，督察长，硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理，国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

#### (4) 本基金基金经理

严瑾女士，法国瓦尔省土伦大学经济管理学院硕士、法国图卢兹一大经济管理学院硕士。曾任上海日月明集团投资有限公司投资项目经理、富邦证券有限公司上海代表处行业研究员。2008 年至今，历任汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级研究员、投资经理、QFII（合格境外机构投资者）投资咨询副总监。现任汇丰晋信龙腾基金基金经理兼 QFII（合格境外机构投资者）投资咨询总监。

本基金历任基金经理：

林彤彤先生，于 2006 年 9 月 27 日至 2014 年 1 月 11 日期间，曾管理本基金。

王春先生，于 2013 年 12 月 28 日至 2015 年 5 月 23 日期间，曾管理本基金。

王品女士，于 2015 年 5 月 23 日至 2016 年 4 月 30 日期间，曾管理本基金。

曹庆先生，于 2016 年 4 月 30 日至 2018 年 8 月 31 日期间，曾管理本基金。

#### (5) 投资委员会成员的姓名和职务

王栋，总经理；郑宇尘，投资总监。基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

(6) 上述人员之间不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

(2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(3) 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；

(4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

(5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

(6) 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、分别记帐，进行证券投资；

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；

(8) 接受基金托管人依法进行的监督；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(10) 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；

(11) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不得向他人泄露；

(12) 按基金合同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；

(13) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

(14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(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记录、帐册、报表和其他相关资料；

(17) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(18) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；

(19) 保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(20) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变

现和分配；

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其财产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(22) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(23) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(24) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

(25) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资源分配；

(26) 以基金管理人的名义，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；

(27) 法律法规及基金合同规定的其他职责。

#### **(四) 基金管理人的承诺**

(1) 基金管理人将严格遵守法律法规和基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

(2) 基金管理人不得从事违反《基金法》及其他法律法规的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- 1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- 2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- 3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- 4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5) 用基金财产承销证券；
- 6) 用基金财产向他人贷款或提供担保；
- 7) 用基金财产从事无限责任的投资；
- 8) 用基金财产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- 9) 以基金财产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 10) 以基金财产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或

者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

- 11) 用基金财产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 12) 基金财产参与股票发行申购，所申报的金额超过基金的总财产，基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 13) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值超过本基金资产净值的10%；
- 14) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，超过该证券的10%；
- 15) 违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；
- 16) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

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

- 1) 越权或违规经营；
- 2) 违反基金合同或托管协议；
- 3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- 4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- 5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6) 玩忽职守、滥用职权；
- 7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- 9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- 10) 贬损同行，以提高自己；
- 11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；



- 12) 以不正当手段谋求业务发展；
- 13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- 14) 法律法规禁止的其他行为。

(4) 基金经理承诺

- 1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。
- 2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- 3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。
- 4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

**(五) 基金管理人的内部控制制度**

(1) 内部控制的目标

- 1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。
- 2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。
- 3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

(2) 内部控制的原则

- 1) 健全性原则。内部控制应当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、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；
- 4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
- 5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### （3）内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章组成。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，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度。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、操作守则等的具体说明。

公司制定内部控制制度遵循了以下原则：

- 1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。
- 2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。
- 3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。
- 4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

### （4）内部控制系统

公司的内部控制系统是一个分工明确、相互牵制、完备严密的系统。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，各个业务部门负责本部门的内部控制，督察长和监察稽核部负责检查公司的内部控制措施的执行情况。具体而言，包括如下组成部分：

#### 1) 董事会

负责制定公司的内部控制大纲，对公司内部控制负完全的和最终的责任。

#### 2) 督察长

负责公司及其业务运作的监察稽核工作，对公司内部控制的执行情况进行监督检查。督察长对董事会负责，将定期和不定期向董事会报告公司内部控制的执行情况，并定期向中国证监会呈送监察稽核报告。

### 3) 监察稽核部

监察稽核部负责对公司各部门内部控制的执行情况进行监督。监察稽核部对总经理负责，将定期和不定期对各业务部门内部控制制度的执行情况和遵守国家法律法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议。

### 4) 业务部门

内部控制是每一个业务部门的责任。各部门总监对本部门的内部控制负直接责任，负责履行公司的内部控制制度，并负责建立、执行和维护本部门的内部控制措施。

### (5) 基金管理人关于内部控制的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：彭纯

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.63亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2018年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第11位，连续五年跻身全球银行20强；根据2018年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第168位，较上年提升3位。

截至2018年12月31日，交通银行资产总额为人民币95,311.71亿元。2018年1-12月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币736.30亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发

向上的资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事，2013年10月至2018年1月任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015年10月至2018年6月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014年7月至2016年11月任中国银行副行长，2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

## （三）基金托管业务经营情况

截至2018年12月31日，交通银行共托管证券投资基金400只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的识别、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最

佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。



## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### (1) 直销机构

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

电话：021-20376868

传真：021-20376989

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

客户服务中心电话：021-20376888

#### (2) 代销机构

交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：王菁

客服电话：95559

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

中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

传真：010-66218888

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66106912

传真：021-66107914

联系人：田耕

客户服务电话：95588

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

中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

传真：（010）85109219

联系人：蒋浩

客户服务电话：95599

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

中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：陈四清

电话：（010）66109330

传真：（010）66109144

联系人：刑然

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

汇丰银行（中国）有限公司

注册地址：上海市世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 22 层

办公地址：上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层

法定代表人：廖宜建

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

客服电话：400-880-5688（汇丰尚玉客户）

400-820-8828（卓越理财客户）

400-820-8878（运筹理财客户）

上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：汤嘉惠、虞谷云

客户服务热线：95528

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

中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：丰靖

电话：010-65557013

传真：010-65550827

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

民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

电话：010-58357666

传真：010-83914283

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：翟鸿祥

联系人：马旭

传真：010-85238680

客户服务中心电话：95577

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

光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：010-68098778

传真：010-68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

电话：（0755）83195834，82090060

传真：（0755）83195049，82090817

客户服务电话：95555

联系人：刘薇

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

平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

温州银行股份有限公司

住所、办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：（0577）88990082

传真：（0577）88995217

客服电话：（0577）96699

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

宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

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

渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联络人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客服电话：95541

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

上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：021-38576666

传真：021-50105124

客服电话：021-962999

公司网址：<http://www.srcb.com>

洛阳银行股份有限公司

注册地址：洛阳市洛南新区开元大道 256 号洛阳银行大厦

办公地址：洛阳市洛南新区开元大道 256 号洛阳银行大厦

法定代表人：王建甫

客服电话：96699

公司网址：<http://www.bankofluoyang.com.cn>

山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城东路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

联系电话：021-38676161

传真：021-38670161

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼

法定代表人：霍达

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636 客服电话：400-8888-111、95565

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

中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：4008888108

电话：010-85130577

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：<http://www.csc108.com>

广发证券股份有限公司

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

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

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点

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

中国银河证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888或95551

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

光大证券股份有限公司



注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：10108998、4008888788、或拨打各城市营业网点咨询电话

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

海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点电话

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

华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客户服务电话：95597

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

兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

联系人：杨盛芳

电话：0591—87613888

传真：0591-87546058

客户服务电话：400-8888-123

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

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 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82133066

传真：0755-82133302

客户服务电话：95536

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

中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

客服电话：010-84588888

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

中信证券（山东）有限责任公司

法定代表人：杨宝林

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

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 20 层

基金业务联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

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

国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

电话：0551-2207938

传真：0551-2207965

客服电话：4008-888-777、95578

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

中国国际金融股份有限公司

注册地址：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 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇 陈曦

客服电话：400 910 1166

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

安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴  
注册资本：15.1 亿元人民币  
开放式基金咨询电话：4008001001  
开放式基金业务传真：0755-82558355  
联系人：陈剑虹  
联系电话：0755-82558305  
网址：www.essence.com.cn

天相投资顾问有限公司  
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701  
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层  
法定代表人：林义相  
联系人：林爽  
电话：010-66045529  
传真：010-66045500  
客服电话：010-66045678  
公司网址：www.txsec.com、 www.txjijin.com

东方证券股份有限公司  
注册地址：上海市中山北路318号2号楼21-29楼  
办公地址：上海市中山北路318号2号楼21-29楼  
法定代表人：潘鑫军  
联络人：吴宇、沈燕  
电话：021-63325888  
传真：021-63326173  
客服电话：95503  
公司网址：www.dfzq.com.cn

国金证券股份有限公司  
注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：雷波

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

客户服务电话：95310

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

深圳众禄金融控股股份有限公司

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

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：张玉静

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

上海天天基金销售有限公司

注册地点：上海浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客户服务电话：400-1818-188

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

蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地点：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000766123

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

上海好买基金销售有限公司

注册地点：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：薛年

客户服务电话：400-700-9665

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

浙江同花顺基金销售有限公司

注册地点：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系人：杨翼

公司网站：[www.10jqka.com.cn](http://www.10jqka.com.cn)

客服电话：95105-885 0571-56768888

诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地点：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

联系人：姚思轶

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

客服电话：400-821-5399

东海证券有限责任公司

注册地点：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：汪汇

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

客服电话：400-8888-588

中泰证券股份有限公司

注册地点：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889518

公司网站：www.zts.com.cn

客服电话：95538

浙商证券股份有限公司

地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大厦 7C-80

邮编 310020

法定代表人：吴承根

联系人：胡宗伟

联系电话：0571-87903360

公司网站：www.stocke.com.cn

客服电话：（浙江省内）967777

华鑫证券有限责任公司

注册地点：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：陈敏

公司网站：www.cfsc.com.cn

客服电话：021-32109999；029-68918888

信达证券股份有限公司

注册地点：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

公司网址：www.cindasc.com

客服电话：400-800-8899

和讯信息科技有限公司

注册地点：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：周轶

公司网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

客服电话：4009-200-022

北京展恒基金销售股份有限公司

注册地点：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公区地址为：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

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

客服电话：400-888-6661

华安证券股份有限公司

注册地点：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

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

客服电话：400-809-6518

恒生银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号恒生银行大厦 34 楼、36 楼  
及上海浦东南路 528 号证券大厦 27 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号恒生银行大厦 34 楼、36 楼  
及上海浦东南路 528 号证券大厦 27 楼

法定代表人：李慧敏

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

客服电话：8008308008/4008308008



长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：021-68751929

联系人：李良

客户服务电话：95579

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555147

客户服务电话：4008888993

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦  
20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦  
20楼2005室

法定代表人：李季

联系人：唐岚

电话：010-88085258

传真：010-88013605

中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座  
13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13  
层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩 钰

客服电话：400-990-8826

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

北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

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

客服电话：400 893 6885

上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：鲍东华

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

客服电话：4008219031

珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

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

客服电话：020-89629066

广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

法定代表人：王继康

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

客服电话：95313

平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号平安金融大厦 26 楼

法定代表人：曹实凡

联系人：石静武

电话：021-38631117

传真：021-58991896

客服电话：95511-8

公司网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：400-619-9059/010-56251471

传真：010-62680827

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

客服电话：400-619-9059

北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人：江卉

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

公司网站: fund.jd.com

客服电话: 95118

## (二) 注册登记人

名称: 汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

法定代表人: 杨小勇

联系人: 赵琳

联系电话: 021-20376892

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 北京市金杜律师事务所

地址: 北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

负责人: 王玲

电话: 010-58785588

传真: 010-58785599

联系人: 宋萍萍

联系电话: 0755-22163307

经办律师: 靳庆军、宋萍萍

## (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)

住所: 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人: 杨绍信

联系电话: 021-2323 8888

传真电话: 021-2323 8800

经办注册会计师: 薛竞、赵钰

联系人：赵钰

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

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，并于2006年8月16日经中国证监会证监基金字【2006】第157号文核准募集。

### （二）基金存续期间

不定期

### （三）基金类型

混合型证券投资基金

### （四）募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售，具体情况和联系方法详见基金份额发售公告。

### （五）募集期限

本基金于2006年8月28日起通过各销售机构向社会公开募集，截止2006年9月22日，本基金募集工作已顺利结束。

### （六）募集对象

本基金份额的发售对象为中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （七）募集场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售，详情见基金份额发售公告。

### （八）基金的最高募集规模

本基金不设最高募集规模。

### （九）基金份额面值、认购价格、费用及认购份额计算公式

（1）基金份额面值：1.00 元人民币

（2）基金份额认购价格：1.00 元人民币

（3）认购费用

本基金采用金额认购方法，认购费用以认购金额为基数采用比例费率计算，投资人可选择在认购本基金或赎回本基金时缴纳认购费用。投资人选择在认购时缴纳的称为前端认购费用，投资人选择在赎回时缴纳的称为后端认购费用。

① 前端认购费率如下：

认购金额（万元）	前端认购费率
A < 50	1.2%
50 ≤ A < 100	1.0%
100 ≤ A < 500	0.6%
A ≥ 500	每笔 1000 元

② 后端认购费率如下：

持有时间	后端认购费率
T < 1 年	1.5%
1 年 ≤ T < 2 年	1.2%
2 年 ≤ T < 4 年	0.5%
T ≥ 4 年	0

注：上表中，1 年以 365 天计算。

（4）认购份额的计算

1) 投资人选取前端费用方式认购的，前端费用类别下的认购份额的计算方法如下：

前端认购费用 = 认购金额 × 前端认购费率

净认购金额 = 认购金额 - 前端认购费用

认购份额 = (净认购金额 + 认购金额产生的利息) / 基金份额面值

2) 投资人选取后端费用方式认购的，后端费用类别下的认购份额的计算方法如下：

认购份额 = (认购金额 + 认购金额产生的利息) / 基金份额面值

上述计算结果（包括认购份额）以四舍五入的方法保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

认购费用主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期发生的各项费用，不列入基金财产。

例一：假定某投资人投资 10,000 元认购本基金，认购金额在募集期产生的利息为 3 元。如果其选择缴纳前端认购费用，则其可得到的认购份额计算如下：

$$\text{前端认购费用} = 10,000 \times 1.2\% = 120 \text{ 元}$$

$$\text{净认购金额} = 10,000 - 120 = 9,880 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (9,880 + 3) / 1.00 = 9,883 \text{ 份}$$

即投资人投资 10,000 元认购本基金，如果选择缴纳前端认购费用，可得到 9,883 份基金份额（含利息折份额部分）。

例二：假定某投资人投资 10,000 元认购本基金，认购金额在募集期产生的利息为 3 元。如果其选择缴纳后端认购费用，则其可得到的认购份额计算如下：

$$\text{认购份额} = (10,000 + 3) / 1.00 = 10,003 \text{ 份}$$

即投资人投资 10,000 元认购本基金，如果选择缴纳后端认购费用，可得到 10,003 份基金份额（含利息折份额部分），但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端认购费率缴纳后端认购费用。

## （十）投资人对基金份额的认购

### （1）认购时间安排

本基金募集期为 2006 年 8 月 28 日至 2006 年 9 月 22 日，共 26 天。

### （2）投资人认购应提交的文件和办理的手续

基金投资人可在募集期间到基金销售网点认购本基金，按照销售机构的规定办理基金认购手续，填写认购申请书，并足额缴纳认购款（具体请参见基金份额发售公告）。首次认购之前必须持有效证件开立汇丰晋信基金管理有限公司基金账户和销售机构交易账户。

### （3）认购的方式及确认

投资人在募集期内可多次认购基金份额，认购申请一经受理，不得撤销。

投资人在 T 日规定时间内提交的认购申请，可于 T+2 日后在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心查询认购申请是否被成功受理。



投资人可于基金合同生效后在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心查询认购确认份额。

#### (4) 认购限额

在本基金募集期内，对于本基金同一费用类别，投资人首次单笔认购的最低金额为 2,000 元，追加认购的最低金额 1,000 元。

#### (5) 超比例的处理方式

本基金募集期间内不设最高认购份额限制。

### (十一) 募集资金利息的处理方式

认购款项在基金募集期产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。认购利息以注册登记人的记录为准。

**(十二) 基金募集行为结束前，投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户，任何人不得动用。**

本次募集有效认购总户数为24,287户，按照每份基金份额1.00元人民币计算，募集发售期募集的有效份额为1,436,170,384.95份基金份额，利息结转的基金份额为218,330.94份基金份额，两项合计共1,436,388,715.89份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

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

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

基金备案获中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

### （二）基金募集失败的处理方式

（1）募集期满，未达到基金合同生效条件，或募集期内发生使基金合同无法生效的不可抗力，则基金募集失败。

（2）本基金募集失败，基金管理人应当以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，将投资人已缴纳的认购款项加计银行同期存款利息在募集期限届满后 30 日内返还基金认购人。

### （三）基金存续期内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和报送解决方案；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人有权根据法律法规及本基金合同规定的程序，报中国证监会批准后宣布本基金合同终止。

中国证监会另有规定的，按其规定办理。

### （四）本基金基金合同已于 2006 年 9 月 27 日生效。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

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

条件成熟时，投资人可以通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法另行公告。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### （1）开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资人办理基金申购、赎回等业务的上海，深圳证券交易所交易日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并提前公告，同时报中国证监会备案。

#### （2）申购的开始时间

本基金自基金合同生效日后不超过 3 个月时间内开始办理申购，具体开始办理时间在本基金开放申购公告中规定。本基金已于 2006 年 10 月 10 日起开始办理日常申购业务。

#### （3）赎回的开始时间

本基金自基金合同生效日后不超过 3 个月时间内开始办理赎回，具体开始办理赎回时间在本基金开放赎回公告中规定。本基金已于 2006 年 12 月 27 日起开始办理日常赎回业务。

（4）基金管理人开始办理申购、赎回业务时应当按照基金合同的规定进行公告并办理备案手续。

（5）基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回

或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

### （三）申购与赎回的原则

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

（2）“金额申购、份额赎回”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）基金份额持有人赎回基金份额，对于其持有的同一费用类别下的基金份额，基金管理人按照“先进先出”的原则处理，即对基金份额持有人在销售机构托管的同一费用类别份额进行赎回处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定赎回份额所适用的申购费率；

（4）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销，在基金管理人规定的时间之后不得撤销；

（5）基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施 2 日前在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### （1）申购与赎回申请的提出

基金投资人须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

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

#### （2）申购与赎回申请的确认

本基金注册登记人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，并在 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 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

#### （3）申购与赎回申请的款项支付

申购时，采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购无

效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

赎回时，当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，款项的支付办法按照本基金合同有关条款处理。

## (五) 申购和赎回的数额和价格

### (1) 申购金额、赎回份额及余额的处理方式

- 1) 对于本基金同一费用类别，投资人首次申购最低金额 2,000 元(已认购本基金同一费用类别的基金份额，不受首次申购最低金额限制)；追加申购每次最低金额 1,000 元。各代销机构对最低申购限额有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。基金投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。
- 2) 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 500 份基金份额；每个交易账户的最低基金份额余额不得低于 500 份，基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 500 份的，需一次全部赎回。如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于 500 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。
- 3) 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见定期更新的招募说明书。
- 4) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

基金管理人可根据市场情况，调整以上申购金额、赎回份额及最低持有份额的数量限制，并于调整前 2 日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

### (2) 申购赎回费率

#### 1) 申购费率：

投资人申购本基金需缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

① 前端申购费率如下：

申购金额（万元）	前端申购费率
$A < 50$	1.5%
$50 \leq A < 100$	1.2%
$100 \leq A < 500$	0.8%
$A \geq 500$	每笔 1000 元

② 后端申购费率如下：

持有时间	后端申购费率
$T < 1$ 年	1.8%
$1 \text{ 年} \leq T < 2$ 年	1.5%
$2 \text{ 年} \leq T < 4$ 年	0.5%
$T \geq 4$ 年	0%

注：上表中，1 年以 365 天计算。

2) 赎回费率

持有期限	赎回费率
$T < 7$ 天	1.5%
$T \geq 7$ 天	0.3%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额 25% 的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

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，在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资者调低基金申购费率、赎回费率。

### (3) 申购份额的计算

1) 投资人选取前端费用方式申购的，前端费用类别下的申购份额的计算方法如下：

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

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

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

2) 投资人选取后端费用方式申购的，后端费用类别下的申购份额的计算方法如下：

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

以上计算结果（包括申购份额）以四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例三，假定某投资人申购本基金 10,000 元，T 日本基金的基金份额净值分别为 1.2 元。如投资人选择缴纳前端申购费用，则每笔申购的申购费用及获得的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{ 元}$$

$$\text{前端申购费用} = 10,000 - 9852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.20 = 8210.18 \text{ 份}$$

例四，假定某投资人申购本基金 10,000 元，T 日本基金的基金份额净值为 1.1 元。如投资人选择缴纳后端申购费用，则投资人获得的申购份额计算如下：

$$\text{申购份额} = 10,000 / 1.1 = 9,090.91 \text{ 份}$$

### (4) 赎回金额的计算

1) 投资人在认购/申购本基金时选择前端费用方式的，本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

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

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

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

2) 投资人在认购/申购本基金时选择后端费用方式的，本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用加上后端认购/申购费用之和之后的余额。其中，

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

赎回费用=赎回总额×赎回费率

后端认购/申购费用 = 赎回份额×认购/申购申请日的基金份额净值  
×该部份对应的后端认购/申购费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用-后端认购/申购费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例五，假定某投资人在 T 日赎回其持有的前端费用类别下的基金份额 10,000 份，T 日的基金份额净值为 1.2 元，基金份额持有期超过 7 日，则投资人获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000×1.2=12,000 元

赎回费用=12,000×0.3%=36 元

赎回金额=12,000-36=11,964 元

例六，假定某投资人选择以后端收费方式申请申购，经确认，获得后端费用类别下的基金份额 20,000 份，申购申请当日的基金份额净值为 1.2 元。1 年后该投资人申请赎回 10,000 份，赎回当日（T 日）的基金份额值为 1.5 元，该笔赎回扣除的赎回费用、后端申购费用和获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000×1.5=15,000 元

赎回费用=15,000×0.3%=45 元

后端申购费用=10,000×1.2×1.5%=180 元

赎回金额=15,000-45-180=14,775 元

#### (5) 基金份额净值的计算公式

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

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日基金份额的余额数量

### (六) 申购与赎回的注册登记

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



(2) 投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

(3) 投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

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

## (七) 巨额赎回的认定及处理方式

### (1) 巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

### (2) 巨额赎回的处理方式

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

- 1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的全部赎回申请和基金间转换时，按正常赎回程序执行。
- 2) 部分延期赎回：当基金管理人认为该基金兑付投资者的全部赎回及转出申请有困难，或认为为实现投资者的赎回、转出申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回及转出的比例不低于上一日该基金总份额 10% 的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回及转出申请，应当按单个账户赎回或转出申请量占该基金赎回及转出申请总量的比例，确定当日受理的赎回或转出份额；未受理部分除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的该基金的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

3) 本基金发生巨额赎回的, 在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的大额赎回申请情形下, 如果基金管理人认为支付全部投资人的赎回申请有困难或认为因支付全部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, 基金管理人可以延期办理赎回申请。具体分为两种情况:

①如果基金管理人认为有能力支付其他投资人的全部赎回申请, 为了保护其他赎回投资人的利益, 对于其他投资人的赎回申请按正常程序进行。对于单个投资人超过基金总份额 20%以上的大额赎回申请, 基金管理人在剩余支付能力范围内对其按比例确认当日受理的赎回份额, 未确认的赎回部分作自动延期处理。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该类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选择取消赎回的, 则当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

②如果基金管理人认为仅支付其他投资人的赎回申请也有困难时, 则对于所有投资人的赎回申请(包括单个投资人超过基金总份额 20%以上的大额赎回申请和其他投资人的赎回申请), 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, 具体按照上述“(2) 部分延期赎回”的约定办理。

当发生巨额赎回并延期办理时, 基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人, 说明有关处理方法, 并在 2 日内编制临时报告书予以公告, 并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

(3) 暂停接受和延缓支付: 本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回, 如基金管理人认为有必要, 可暂停接受赎回申请; 已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项, 但不得超过正常支付时间 20 个工作日。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时, 基金管理人应当在 2 日内编制临时报告书, 予以公告, 并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出

机构备案。

#### （八）拒绝或暂停接受申购、暂停赎回的情形及处理

（1）在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请；
- 2) 证券交易所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- 4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- 5) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响；
- 6) 接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50%以上的；
- 7) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值并采取暂停接受基金申购申请的措施。
- 8) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1)、2)、3)、4)、7)、8)项情形时，基金管理人应向中国证监会备案并公告。

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）在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

- 1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2) 证券交易所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3) 发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的

情况；

- 4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- 5) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
- 6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1)、2)、3)、4)、5)、6) 项情形时，基金管理人应向中国证监会备案及公告。

已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

(3) 暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

- 1) 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放申购或赎回日在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值；
- 2) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 1 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值；
- 3) 如果发生暂停的时间超过 2 周，基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在中国证监会指定媒体上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新的基金份额净值。

## 九、基金的转换

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的其它开放式基金份额的行为。

基金管理人在基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换业务开始前 2 天至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并按有关规定报中国证监会备案。

基金管理人已于 2008 年 5 月 8 日在汇丰晋信基金直销中心和汇丰晋信基金电子交易系统开通旗下基金的转换业务。

基金管理人已于 2009 年 2 月 9 日在交通银行开通旗下基金的转换业务。

## 十、基金的非交易过户与转托管

(一) 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行，及基金注册与过户登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

(1) “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。

(2) “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

(3) “强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金注册登记人可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

(二) 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册登记人或其指定的机构申请办理。

(三) 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构(网点)时，投资人可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 十一、基金份额的冻结、解冻及质押

(一) 基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益(包括现金分红和红利再投资)一并冻结。

(二) 在不违反届时有效的法律法规的条件下,基金注册登记人将可以办理基金份额的质押业务或其他业务,公布并实施相应的业务规则。

## 十二、定期定额投资计划

本基金管理人可为基金投资人提供定期定额投资计划服务,具体实施方法以基金管理人届时公布的业务规则和公告为准。

基金管理人已于2006年10月25日起正式推出本基金的定期定额投资计划。



## 十三、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过精选受益于中国经济持续高速增长而呈现出可持续竞争优势、未来良好成长性以及盈利持续增长潜力的上市公司，追求超越比较基准的投资回报和中长期稳定的资产增值。

### （二）投资范围

投资于上市交易的股票、债券和国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种。主要包括：股票（A股及监管机构允许投资的其他种类和其他市场的股票）、债券（包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债等）、短期金融工具（包括到期日在一年以内的债券、债券回购、央行票据、银行存款、短期融资券等）、现金资产、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：股票占基金资产的60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的5%-40%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年期以内的国债的比例合计不低于基金资产净值的5%。同时，为有效管理投资组合，基金可投资于经法律法规或中国证监会允许的各种金融衍生产品，如期权、期货、权证、资产支持证券以及其他相关的衍生工具。

股票投资主要集中于具有独特且可持续竞争优势，未来有良好成长性和持续盈利增长潜力的上市公司，辅助投资于资产价值被低估的上市公司。

在基金实际管理过程中，本基金具体配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下，基金管理人可对上述比例做适度调整。

### （三）投资理念

注重成长、精选个股、长期投资。具体来说，包含以下三方面的内容。

#### （1）追求高成长性

中国经济在未来相当长的时间内都将保持较快的增长速度，作为支撑经济增长的三大“支柱”——投资、消费、出口贸易所涵盖的行业或公司必然更多的体现为高成长性，投资于这些具有良好成长性的上市公司的股票，将最大程度地分享国民经济高速发展带来的财富增长。

从企业盈利的高增长性和可持续成长性两方面寻找投资机会是本基金的根本投资理念。同时，本基金坚持成长投资并不意味着摒弃价值投资。价值源于成长，成长成就价值，只有持续的增长才是股价增长的源动力。

(2) 研究创造价值

中国证券市场仍属新兴市场，其特点是市场的非完全有效性，股票价格并未完全反映所有信息。本基金认为，通过专业的研究可以获得信息的优势，挖掘上市公司内在投资价值，并规避上市公司的道德及信用风险。

同时，本基金将避开股票价格波动的表象，按照“成长特征→具备核心竞争力、内生增长型→持续的成长特性”的选股步骤，专注于具有核心竞争力、良好公司治理、有持续盈利增长潜力的上市公司，通过积极的主动管理努力为投资者获取超越比较基准的投资回报。

(3) 长期投资

公司价值（即未来净现金流的净现值）的长期稳定增长不仅可以规避市场的短期波动，长期因业绩持续增长而带来的复利效应也是股价上涨的推动力。

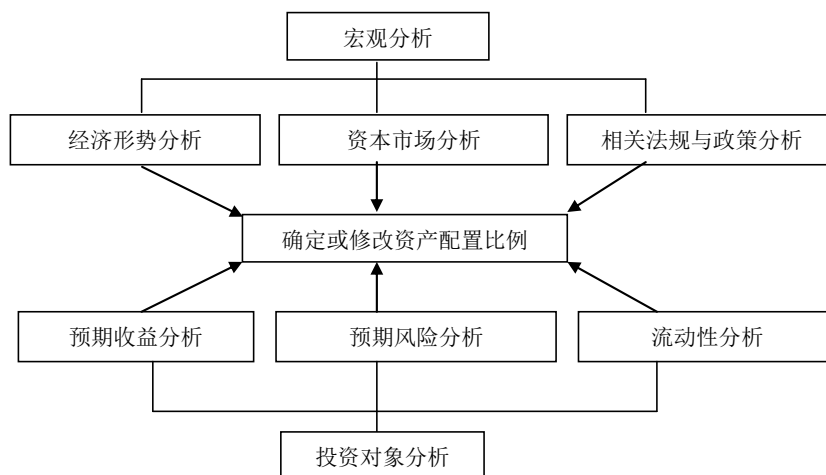
因此，本基金通过借鉴汇丰集团 CFROI 模型和上市公司评分体系的运用方法，在合理控制非系统风险、降低交易成本的基础上，致力于保持投资的长期一贯性。

(四) 投资策略

(1) 资产配置策略

根据本基金所奉行的“注重成长、精选个股、长期投资”的投资理念和“自下而上”的股票精选策略，在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。

本基金资产配置的决策流程如下图所示：



本基金采用指标筛选和个股精选确定的股票组合，完全是以自下而上方式构建而成的。这样的组合可能在单一行业集中度较高，造成组合的非系统风险较高。因此，本基金将通过对产业环境、产业政策和竞争格局的分析和预测，确定行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值并据此对组合成份股的行业分布加以适当调整。

## (2) 股票投资策略

### 1) 股票初选库

根据本基金的投资理念和目标客户的特征，本基金的股票初选库需经过成长性指标筛选。在排除 ST 类和 PT 类的所有上市公司后，本基金按照一定换手率标准对上市公司进行初步筛选，大于此换手率标准的股票进入基金初步选择范围，小于此换手率标准的股票予以剔除；并根据目标选择数量标准加以调整。在此基础上，本基金采用成长性指标对股票进行筛选：根据过往 3 年年报数据，统计其主营业务利润增长率和主营业务收入增长率的表现，并经研究员定性分析后，符合本基金成长性指标标准的股票进入基金股票初选库范围，每季度核对个股的成长性指标，根据个股成长性指标的变化对股票初选库加以调整。

### 2) 以成长指标为核心的个股精选体系

本基金在明确的成长性评估体系基础上，对初选股票给予全面的成长性分析，成长性指标包括：主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、市盈率(P/E)、净资产收益率(ROE)等，优选出具有可持续竞争优势，未来有良好成长性和盈利持续增长潜力的上市公司。

各项指标的标准设置原则如下：

#### ■ 主营业务收入增长率

以 GDP 的增长率作为评价指标的参照物：处在持续增长阶段的上市公司，考察其过往 3 年增长率，并预测今后 2 年的增长率。处在增长启动阶段的上市公司，考察其未来 3 年的增长趋势及可能实现的概率水平。

#### ■ 主营业务利润增长率

以 GDP 的增长率作为评价指标的参照物：处在持续增长阶段的上市公司，考察其过往 3 年增长率，并预测今后 2 年的增长率。处在增长启动阶段的上市公司，考察其未来 3 年的增长趋势及可能实现的概率水平。

#### ■ 市盈率 (P/E)

以 1 年期银行定期存款税后收益率的倒数作为评价指标的参照物，根据市场平均市盈率 (P/E) 水平和上市公司的整体业绩增长情况，确定市盈率 (P/E) 的上限。

#### ■ 净资产收益率 (ROE)

以 1 年期银行定期存款税后收益率作为评价指标的参照物，根据 GDP 的增长

速度和上市公司整体的净资产收益率情况，确定净资产收益率（ROE）的下限。

### 3) 以 CFROI（投资现金回报率）指标为核心的财务分析和估值体系

本基金借鉴股东汇丰投资集团的全球化投资经验，建立了以 Cash Flow Return on Investment (CFROI)，即投资现金回报率为核心指标的上市公司财务分析和估值体系。本基金将集中分析上市公司的盈利水平和盈利的持续能力、将利润转换成现金流的能力、产生现金流所需的资本等，也就是重点分析投资现金回报率，并在此基础上对其投资价值形成判断，重点如下：

- 企业的价值即是其全部资产的经营所产生的未来现金流的净现值，因此对上市公司估值的重点在于预测公司未来的现金流并确定适当的贴现率；
- 一个赢利的公司如果没有足够的现金流量满足其流动性需求，公司仍然会有倒闭的可能，因此稳定的现金流远比会计利润更能反映公司的真实运营状况；
- 不同公司间会计政策的不一致导致了他们各自的会计利润不具有可比性，而给予现金流的分析可以调整对会计利润的扭曲。

现金流的基本驱动因素在于投资资本、经济回报、再投资比率、行业竞争力、公司经营和治理水平，因此以投资现金回报率(CFROI)分析为基础的上市公司估值公式如下：

$$\text{Price} = \sum_{t=1}^n \frac{\text{Net Cash Receipts}_t}{(1 + \text{Discount Rate}_t)^t} + \frac{\text{Realizable Value of Non-Operating Assets}}$$

此外，本基金的财务分析体系还包括：相对估值指标分析、财务约束分析、现金分红分析。根据公司的不同特征，本基金管理人还将予以其它财务指标的分析，以构建一个完善的财务分析体系。

### 4) 公司治理评估与实地调研

通过借鉴汇丰投资关于上市公司评分体系的运用方法，本基金建立了全面的公司治理评估体系，对公司的治理水平进行全面评估；评估不合格的公司坚决予以规避。同时，本基金通过实地调研对综合评估结果做出实际验证，确保最大程度规避投资风险。

公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定公司盈利能力能否持续的重要因素。在国内上市公司较普遍存在治理结构缺陷的情况下，本基金管理人对个股的选择将尤为注重对上市公司治理结

构的评估，以期为投资者挑选出具备持续盈利能力的股票。本基金管理人将主要通过以下五个方面对上市公司治理水平进行评估：

- 产业结构；
- 行业展望；
- 股东价值创造力；
- 公司战略及管理质量；
- 公司治理。

### （3）债券投资策略：

本基金投资债券类资产的主要目的是为了能够更好地控制投资风险，同时保持必要的灵活性和运作空间。当股票市场风险显著增大时，本基金将降低股票投资的仓位，增加对债券类资产的投资，在保证资产安全性、流动性的基础上获得稳定收益。

#### ■ 利率走势分析

密切关注宏观经济运行状况、以及货币政策、财政政策、汇率政策等因素的变化，把握利率走向。

#### ■ 收益率曲线变动分析

收益率曲线反映了债券的期限与收益率之间的关系，投资部门通过预测收益率曲线形状的变化，据此调整债券投资组合长短期品种的比例。

#### ■ 收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同品种之间（比如国债与金融债）、不同市场的同一品种、不同市场的不同品种之间的收益率利差基础上，投资部门采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。

#### ■ 公司基本面分析

对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析，并结合实际调研结果，在研究分析的基础上，准确评价债券的信用程度。

### （4）权证投资策略

本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。基金的权证投资策略主要包括以下几个方面：

1) 综合衡量权证标的股票的合理内在价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率 and 无风险收益率等要素，运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。

2) 根据权证的合理内在价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理内在价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理内在价值的考量，决策买入、持有或沽出权证。

3) 通过权证与证券的组合投资, 利用权证衍生工具的特性, 来达到改善组合风险收益特征的目的。

#### (5) 资产支持证券投资策略

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下, 秉持稳健投资原则, 综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略, 在严格控制风险的情况下, 通过信用研究和流动性管理, 选择风险调整后收益较高的品种进行投资, 以期获得基金资产的长期稳健回报。

### (五) 业绩比较基准

业绩比较基准 = MSCI 中国 A 股在岸指数\*75%+一年期银行定期存款利率(税后)\*25%

注:2018年3月1日, MSCI 中国 A 股指数更名为 MSCI 中国 A 股在岸指数。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 本基金管理人有权对此基准进行调整并及时公告。

本基金为混合型基金, 在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后, 我们选定 MSCI 中国 A 股指与 1 年期银行定期存款利率(税后)作为本基金的业绩基准。

本基金的股票投资比例为 60%-95%。在正常的市场情况下, 预计基金的平均股票仓位约为 75%。所以, 业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

### (六) 风险收益特征

本基金是一只混合型基金, 其预期收益及风险水平低于股票型基金, 高于债券型基金及货币市场基金, 属于中高风险收益特征的基金品种。

### (七) 投资禁止行为与限制

#### (1) 禁止用本基金财产从事以下行为

- 1) 承销证券;
- 2) 向他人贷款或者提供担保;
- 3) 从事承担无限责任的投资;
- 4) 买卖其他基金份额, 但是国务院另有规定的除外;
- 5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- 6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者

与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

- 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

(2) 基金投资组合比例限制

- 1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- 3) 本基金股票投资比例为 60-95%；
- 4) 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；
- 5) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- 6) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- 7) 基金的投资组合中保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- 8) 权证投资比例遵照《关于股权分置改革中证券投资基金投资权证有关问题的通知》（证监基金字[2005]138 号）及相关规定执行；
- 9) 资产支持证券投资比例遵照《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》（证监基金字[2006]93 号）及相关规定执行；
- 10) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- 11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- 12) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交

易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

13) 法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

(3) 法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时,本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

#### (八) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述“(2) 基金投资组合比例限制”中的第 7)、11)、12) 项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

#### (九) 基金管理人代表基金行使股东权利处理原则和方法

- (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) 按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金投资人利益。

#### (十) 基金的投资组合报告

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

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19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。

本基金投资组合报告的报告期为2019年01月01日起至2019年03月31日止。本报告中的财务资料未经审计。

#### 10.1 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	619,946,793.86	84.74
	其中:股票	619,946,793.86	84.74



2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,401,600.00	4.84
	其中：债券	35,401,600.00	4.84
	资产支持 证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	19,000,000.00	2.60
	其中：买断式回购 的买入返售金融 资产	-	-
7	银行存款和结算 备付金合计	14,374,757.78	1.96
8	其他资产	42,850,547.40	5.86
9	合计	731,573,699.04	100.00

#### 10.2 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	11,083,800.00	1.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	330,692,195.13	47.37
D	电力、热力、燃气及水生产 和供应业	-	-
E	建筑业	3,481,263.00	0.50
F	批发和零售业	-	-
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	20,529,787.82	2.94
J	金融业	115,266,257.93	16.51
K	房地产业	97,355,353.71	13.95

L	租赁和商务服务业	7,977,837.12	1.14
M	科学研究和技术服务业	22,236,259.15	3.19
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	11,324,040.00	1.62
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	619,946,793.86	88.81

### 10.3 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	600036	招商银行	1,339,658	45,441,199.36	6.51
2	601318	中国平安	535,618	41,296,147.80	5.92
3	600519	贵州茅台	47,786	40,808,766.14	5.85
4	002475	立讯精密	1,199,627	29,750,749.60	4.26
5	002449	国星光电	1,879,882	26,995,105.52	3.87
6	002463	沪电股份	2,080,317	23,986,055.01	3.44
7	002773	康弘药业	447,150	22,768,878.00	3.26
8	601155	新城控股	488,245	22,044,261.75	3.16
9	000401	冀东水泥	1,175,661	20,679,876.99	2.96
10	000858	五粮液	212,700	20,206,500.00	2.89

### 10.4 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	3,977,600.00	0.57
2	央行票据	-	-

3	金融债券	30,051,000.00	4.30
	其中：政策性金融债	30,051,000.00	4.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,373,000.00	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,401,600.00	5.07

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

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	180407	18农发07	300,000	30,051,000.00	4.30
2	020280	19贴债03	40,000	3,977,600.00	0.57
3	128061	启明转债	6,060	606,000.00	0.09
4	127012	招路转债	4,900	490,000.00	0.07
5	110053	苏银转债	2,770	277,000.00	0.04

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 10.7 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

本基金本报告期末未持贵金属。

## 10.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 10.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 10.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 10.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11.11 投资组合报告附注

11.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 11.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	544,921.74
2	应收证券清算款	27,148,132.94
3	应收股利	-
4	应收利息	1,041,422.37

5	应收申购款	14,116,070.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,850,547.40

#### 11.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 11.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十四、基金的业绩

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

### (一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2006/9/27-2006/12/31	31.77%	0.88%	36.77%	1.04%	-5.00%	-0.16%
2007/1/1-2007/12/31	128.36%	1.87%	103.74%	1.71%	24.62%	0.16%
2008/1/1-2008/12/31	-52.88%	2.45%	-49.12%	2.28%	-3.76%	0.17%
2009/1/1-2009/12/31	77.03%	1.56%	71.49%	1.57%	5.54%	-0.01%
2010/1/1-2010/12/31	7.58%	1.36%	-1.35%	1.22%	8.93%	0.14%
2011/1/1-2011/12/31	-25.49%	1.10%	-21.29%	1.00%	-4.20%	0.10%
2012/1/1-2012/12/31	0.79%	1.10%	4.48%	1.06%	-3.69%	0.04%
2013/1/1-2013/12/31	24.97%	1.38%	0.00%	1.02%	24.97%	0.36%
2014/1/1-2014/12/31	55.01%	1.51%	19.27%	0.84%	35.74%	0.67%
2015/1/1-2015/12/31	17.06%	2.56%	15.71%	1.84%	1.35%	0.72%
2016/1/1-2016/12/31	0.72%	1.51%	-9.58%	1.15%	10.30%	0.36%
2017/1/1-2017/12/31	17.53%	0.77%	10.05%	0.51%	7.48%	0.26%
2018/1/1-2018/12/31	-21.90%	1.30%	-21.52%	1.02%	-0.38%	0.28%
2019/1/1-2019/3/31	23.89%	1.47%	22.75%	1.15%	1.14%	0.32%

### (二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1.按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的5%-40%，其中现金或到期日在一年期以内的国债的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金自基金合同生效日起不超过6个月内完成建仓。截止2007年3月27日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2.基金合同生效日（2006年9月27日）起至2015年3月31日，本基金的业绩比较基准为“75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×1年期银行定期存款利率（税后）”。自2015年4月1日起，本基金的业绩比较基准调整为“75%×MSCI中国A股指数+25%×1年期银行定期存款利率（税后）”。

3.上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含富时中国A600成长指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

4.2010年12月16日，新华富时600成长指数正式更名为富时中国A600成长指数。

5.自2015年8月7日起，本基金更名为“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”，基金简称变更为“汇丰晋信龙腾混合”，基金股票投资比例不发生变更。

6、2018年3月1日，MSCI中国A股指数更名为MSCI中国A股在岸指数。



## 十五、基金的财产

### （一）基金财产的构成

#### （1）基金资产总值

基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴存的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购基金款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

#### （2）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （二）基金财产的账户

本基金以“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”的名义在基金托管人营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户、以“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

### **(三) 基金财产的保管及处分**

(1) 本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

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

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

(4) 非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十六、基金财产的估值

### （一）估值目的

基金财产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产及负债。

### （四）估值方法

#### （1）股票估值方法

1) 上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

#### 2) 未上市股票的估值：

①首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第1)条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该

上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

④ 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(D1-Dr)/D1$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## (2) 债券估值方法

- 1) 在证券交易所市场挂牌交易的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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。
- 2) 在证券交易所市场挂牌交易的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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

- 3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。
- 4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。
- 5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### (3) 权证估值方法

- 1) 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。
- 2) 首次发行未上市的权证，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) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。
- 4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收

盘价低于配股价，则估值为零。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### (4) 资产支持证券的估值方法

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

2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### (5) 股票指数期货合约的估值方法：

1) 股票指数期货合约以结算价格进行估值。

2) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### (6) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(7) 在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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。

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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （六）暂停估值的情形

- （1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- （2）因不可抗力或其他情形致使基金管理人、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- （3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- （4）如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- （5）当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
- （6）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### （七）基金份额净值的计算

$$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日基金资产净值} / T \text{ 日基金总份额余额}$$

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

### （八）估值错误的处理

（1）当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

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财产估值的

准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误实际发生时，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；计价错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

## （2）差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记人、代销销售机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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

## （3）差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

- 1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；



- 2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责, 不对间接损失负责, 并且仅对差错的有关直接当事人负责, 不对第三方负责;
- 3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责, 如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失, 则差错责任方应赔偿受损方的损失, 并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利; 如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方, 则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方;
- 4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式;
- 5) 如果因基金管理人原因造成基金财产损失时, 基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿, 如果因基金托管人原因造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人 and 托管人之外的第三方造成基金财产的损失, 由基金管理人负责向差错方追偿;
- 6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿, 并且依据法律、行政法规、本基金合同或其他规定, 基金管理人或基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任, 则基金管理人或基金托管人有权向出现差错的当事人进行追索, 并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失;
- 7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### (4) 差错处理程序

差错被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

- 1) 查明差错发生的原因, 列明所有当事人, 根据差错发生的原因确定差错责任方;
- 2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;
- 3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正

和赔偿损失；

- 4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记人的交易数据的，由基金注册登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
- 5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

#### **(九) 特殊情形的处理**

(1) 基金管理人按第(四)项第(7)条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十七、基金的收益与分配

### （一）收益的构成

（1）基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

（2）因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

（3）基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

（1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；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；

（2）每一基金份额享有同等分配权；

（3）基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

（4）基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

（5）如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

（6）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多4次；

（7）每次基金收益分配比例不得低于可分配收益的50%。基金合同生效不满3个月，收益可不分配。

（8）分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红。

（9）法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

#### （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人应在2日内公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

#### （五）收益分配中发生的费用

（1）收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或其他公告中列示。

（2）收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，或者现金红利低于基金管理人规定的数额的，注册登记人自动将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日经除权后的基金份额净值为计算基准转为基金份额。

## 十八、基金的费用和税收

### (一) 基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费率为 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### (2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第(一)款第(3)至第(7)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### (三) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### (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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

### (五) 其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

### (六) 税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十九、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

（1）基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日，如果基金成立少于 2 个月，可以并入下一个会计年度。

（2）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

（3）会计制度按国家有关的会计制度执行。

（4）本基金独立建账、独立核算。

（5）本基金会计责任人为基金管理人。

（6）基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金年度审计

（1）基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

（2）会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案；

（3）基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应在更换会计师事务所后在 2 日内公告。

## 二十、基金的信息披露

### （一）披露原则

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。

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报刊和网站披露，并保证投资人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。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （二）基金募集信息披露

（1）基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体上；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各自公司网站上。

（2）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）基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体上登载基金合同生



效公告。

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

### (三) 定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制,由基金托管人复核。基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。

(1) 基金年度报告:基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

(2) 基金半年度报告:基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

(3) 基金季度报告:基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体上。

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。

本基金持续运作过程中,应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

### (四) 基金资产净值公告、基金份额净值公告和基金份额累计净值公告

基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至

少每周在指定媒体上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，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。

### （五）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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) 变更基金代销机构;
- (20) 更换基金注册登记人;
- (21) 基金开始办理申购、赎回;
- (22) 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- (23) 基金发生巨额赎回并延期支付;
- (24) 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- (25) 基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- (26) 本基金发生涉及申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项;
- (27) 中国证监会规定的其他事项。

#### **(六) 澄清公告**

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

#### **(七) 中国证监会规定的其他信息**

#### **(八) 信息披露文件的存放与查阅**

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,投资人可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,投资人可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 二十一、风险揭示

### （一）市场风险

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

#### （1）政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### （2）经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### （3）利率风险

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

#### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

#### （5）通货膨胀风险

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

#### （6）债券收益率曲线变动的风险

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

### （7）再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

## （二）信用风险

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

## （三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

## （四）流动性风险

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

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

## （五）操作和技术风险

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

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构、证券交易所和证券登记结

算机构等。

#### **(六) 合规性风险**

指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### **(七) 本基金特有的风险**

本基金主要投资于具有可持续竞争优势、未来良好成长性以及持续盈利增长潜力的优秀上市公司,投资策略上也相对以中长期持有为主,保持股票仓位的相对稳定。因此本基金特有的风险主要包括:首先,在选股策略上本基金特有的风险主要来自两个方面:一是对企业成长性及上市公司的基本面研究是否准确、深入,二是所采用的估值方法是否科学、合理。基本面研究及估值过程中存在的缺陷及错误均可能导致所选择的证券不能完全符合本基金的预期目标。其次,在投资策略方面本基金特有的风险主要在于:不同时期市场可能会有不同的偏好和热点,本基金相对侧重于中长期持有的投资策略可能使基金表现在特定时期落后于大市或其它股票基金。

#### **(八) 其他风险**

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

(2) 因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险;

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

(4) 其他意外导致的风险。

## 二十二、基金合同的终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金的基金合同终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新的基金管理人、基金托管人承接的；
- （3）法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （二）基金财产的清算

（1）基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### （2）基金财产清算组

- 1) 自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。
- 2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
- 3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### （3）清算程序

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金清算组作出清算报告；

- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计;
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会;
- 9) 公布基金清算公告;
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (4) 清算费用

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

#### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用;
- 2) 缴纳基金所欠税款;
- 3) 清偿基金债务;
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (6) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会批准并公告。

#### (7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十三、基金合同的内容摘要

### (一) 基金合同当事人及权利义务

#### (1) 基金管理人的权利与义务

基金管理人的权利:

- 1) 依法募集基金, 办理基金备案手续;
- 2) 自基金合同生效之日起, 基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产;
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定, 制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费;
- 5) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下, 决定本基金的相关费率结构和收费方式;
- 6) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额, 收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它法律法规规定的费用;
- 7) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的, 应及时呈报中国证监会和中国银监会, 以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
- 8) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;
- 9) 自行担任基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构, 办理基金注册登记业务, 并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;
- 10) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;
- 11) 在法律法规允许的前提下, 为基金份额持有人的利益依法为基金

进行融资；

- 12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
- 13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
- 14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- 15) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- 16) 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；
- 17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- 18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

基金管理人的义务：

- 1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2) 办理基金备案手续；
- 3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；
- 6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；
- 7) 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资产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记帐，进行证券投资；
- 8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；

- 9) 接受基金托管人依法进行的监督;
- 10) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按照有关规定计算并公告基金份额净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
- 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,应予以保密,不得向他人泄露;
- 13) 按基金合同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) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回和分红款项;
- 15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
- 16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会,或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- 17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料;
- 18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;
- 19) 编制中期和年度基金报告;
- 20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料,在规定时间内发出;保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并得到有关资料的复印件;
- 21) 组织并参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 22) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
- 23) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合

- 法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 24) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；
- 26) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资源分配；
- 27) 以基金管理人的名义，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；
- 28) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (2) 基金托管人的权利与义务

### 基金托管人的权利：

- 1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- 4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

### 基金托管人的义务：

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- 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资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名册登记、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》、本基金合同及其他有关规定外，不以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
  - 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
  - 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
  - 7) 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；
  - 8) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
  - 9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；
  - 10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
  - 11) 对基金财务会计报告、中期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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
  - 12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料，保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上；
  - 13) 根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；
  - 14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - 15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
  - 16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
  - 17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

- 18) 参加基金财产清算组, 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、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会和银行监管机构, 并通知基金管理人;
- 20) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 基金托管人应为基金向基金管理人追偿;
- 21) 因违反基金合同导致基金财产的损失, 应承担赔偿责任, 其责任不因其退任而免除;
- 22) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动;
- 23) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### (3) 基金份额持有人的权利与义务

#### 基金份额持有人的权利:

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

#### 基金份额持有人的义务:

- 1) 遵守基金合同;
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用;
- 3) 在持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动;
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;
- 7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会

本基金的基金份额持有人大会, 由本基金的基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

### (1) 召开事由

有以下事由情形之一时, 应召开基金份额持有人大会:

- 1) 修改或终止基金合同, 但基金合同另有约定的除外;
- 2) 转换基金运作方式, 但基金合同另有约定的除外;
- 3) 更换基金托管人;
- 4) 更换基金管理人;
- 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
- 6) 本基金与其它基金的合并;
- 7) 变更基金类别;
- 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) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

以下情况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) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
- 3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
- 4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

(2) 召集人和召集方式

- 1) 除法律法规或本基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集。
- 2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
- 3) 代表基金份额 10%以上(含 10%, 以基金管理人收到提议当日的基金份额计算, 下同)的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额 10%以上(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。
- 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基金份额持有人大会, 但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。
- 5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的, 基金管理



人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

- 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。

### (3) 通知

- 1) 召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

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

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

- 3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

### (4) 基金份额持有人出席会议的方式

- 1) 会议方式

- ① 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

- ② 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。
- ③ 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。
- ④ 会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

## 2) 召开基金份额持有人大会的条件

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

- ① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；
- ② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

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

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

- ① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；
- ② 召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；
- ③ 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；
- ④ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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

#### (5) 议事内容与程序

##### 1) 议事内容及提案权

- ① 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。
- ② 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。
- ③ 对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

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

- ④ 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上（含 10%）的基金

份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。

- ⑤ 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2) 议事程序

### ① 现场开会

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

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上（含 50%）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### ② 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

- 3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (6) 表决

- 1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。
- 2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### ① 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以

上（含 50%）通过方为有效，除下列②所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

## ② 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议方式通过。

- 3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。
- 4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 5) 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。

## (7) 计票

### 1) 现场开会

- ① 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。
- ② 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。
- ③ 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。
- ④ 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

## 2) 通讯方式开会

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

## (8) 生效与公告

- 1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。
- 2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。
- 3) 基金份额持有人大会决议应自核准或备案后 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体公告。

## (三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (1) 基金合同的变更

以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- ① 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- ② 更换基金托管人；
- ③ 更换基金管理人；
- ④ 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- ⑤ 变更基金类别；
- ⑥ 变更基金投资目标、范围或策略；
- ⑦ 变更基金份额持有人大会程序；
- ⑧ 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它事项。

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

除上述第①项-第⑧项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在2日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

## (2) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

- 1) 基金份额持有人大会决定终止；
- 2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

## (3) 基金财产的清算

- 1) 基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

### 2) 基金财产清算组

- ① 自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。
- ② 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
- ③ 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 3) 清算程序

- ① 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ② 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③ 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- ④ 对基金财产进行评估和变现；
- ⑤ 基金清算组作出清算报告；
- ⑥ 会计师事务所对清算报告进行审计；

- ⑦ 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- ⑧ 将基金清算结果报告中国证监会；
- ⑨ 公布基金清算公告；
- ⑩ 对基金剩余财产进行分配。

#### 4) 清算费用

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

#### 5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- ① 支付基金财产清算费用；
- ② 缴纳基金所欠税款；
- ③ 清偿基金债务；
- ④ 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 6) 基金财产清算的公告

清算小组成立后两日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会批准并公告。

- 7) 基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存十五年以上。

#### (4) 争议的处理

- 1) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。
- 2) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商或调解方式解决，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，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。
- 3) 除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。



(5) 基金合同存放地及投资者取得基金合同的方式

- 1) 基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。
- 2) 基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。
- 3) 基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 二十四、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：汇丰晋信基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

法定代表人：杨小勇

成立时间：2005年11月16日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]172号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务。

注册资本：2亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### （2）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）

法定代表人：彭纯

成立时间：1987年3月30日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：489.94 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

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

（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，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金的投资对象为上市交易的股票、债券和国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种，主要包括：

- 股票；
- 债券；
- 短期金融工具；
- 现金资产、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出以上范围的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

（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。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

- 1) 基金的投资组合比例为：股票占基金资产的 60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中现金或者到期日在一年以内的国债的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
- 2) 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%；
- 3) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不

超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；

- 4) 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；
- 5) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- 6) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- 7) 权证投资比例遵照《关于股权分置改革中证券投资基金投资权证有关问题的通知》（证监基金字[2005]138 号）及后续相关规定执行；
- 8) 资产支持证券投资比例遵照《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》（证监基金字[2006]93 号）及后续相关规定执行；
- 9) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- 10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- 11) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- 12) 法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

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。除上述第（1）项中“现金或者到期日在一年以内的国债的比例合计不低于基金资产净值的 5%”及第（10）、（11）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金相应修改其投资组合限制规定。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出有关法律法规的规定及基金合同

的约定的基金投融资比例限制的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

(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，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

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

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金合同生效后 2 个工作日内，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者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

基金托管人发现基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

(4) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

- 1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管

理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，基金托管人于收到名单后2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

- 2) 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

(5) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，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，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

- 1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。
- 2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。
- 3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、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。
- 4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

(6) 基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资其他方面进行监督。

(7) 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认、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。

(8) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，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。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正，并通知基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，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 10 个工作日内，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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、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

时向中国证监会报告。

### （三）基金管理人

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人

对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人

安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户/证券账户和债券托管账户、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。

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资

产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反

《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金

托管人在 10 个工作日内纠正，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 10 个工作日内，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

10 个工作日内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时

通知基金托管人在 10 个工作日内纠正。

### （四）基金财产的保管

#### （1）基金财产保管的原则

- 1) 基金托管人应安全保管基金财产。
- 2) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 3) 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账
- 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
- 整和独立。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的指令，不得自



行运用、处分、分配基金的任何资产。

对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

### (2) 基金合同生效时募集资产的验证

基金募集期满之日起 10 日内，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，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有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金募集的证券存放在基金托管人为基金开立的证券账户和债券托管账户下，基金托管人在收到资金和证券当日出具相关证明文件。

### (3) 基金的银行存款账户的开立和管理

- 1) 基金托管人应负责汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金银行存款账户的开立和管理。
- 2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、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，均需通过本基金的银行存款账户进行。
- 3) 本基金银行存款账户的开立和使用，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基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。
- 4) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。
- 5) 基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户、及时

核查基金银行存款账户余额。

#### (4) 基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人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立证券账户。

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和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

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

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于证券交易资金的结算。

基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### (5) 债券托管账户的开立和管理

- 1) 募集资金经验资后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。
- 2) 基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### (6) 基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### (7) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托

管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时，应尽可能保证持有二份以上的正本，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，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## （五）基金资产净值计算和会计核算

### （1）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。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交易结束后计算当日的基金资产净值，盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核盖章后，将复核结果以加密传真通知基金管理人，由基金管理人将基金资产净值和基金份额净值予以公布。待条件成熟后，双方可协商采用电子对账方式。

本基金按以下方法估值：

#### 股票的估值

- 1) 任何已上市流通的股票，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。
- 2) 未上市的股票应区分两种情况处理：
  - ① 首次公开发行的股票，按成本估值；
  - ② 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。
- 3) 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零。
- 4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 债券的估值

- 1) 在证券交易所市场挂牌交易的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，按最近交易日的收盘价估值；
- 2) 在证券交易所市场挂牌交易的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，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；
- 3) 未上市债券按其成本价估值；
- 4) 在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值；
- 5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 权证估值方法

- 1) 上市流通权证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；
- 2) 处于未上市期间的权证或者不存在活跃市场的权证，基金管理人可在与基金托管人商定后，采用恰当的估值技术如 B-S 模型等，按最能反映公允价值的价格估值。
- 3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素，如银行间债券市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等的基础上，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。

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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

## (2) 净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

- 1) 如采用本协议第八章“基金资产估值、基金资产净值计算与复核”中股票估值方法的第 1) -3)、债券估值方法的第 1) -4)、权证估值方法的第 1) -2) 进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，由双方共同承担赔偿责任，其中基金管理人承担 70%，基金托管人承担 30%；
- 2) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；
- 3) 如基金管理人和基金托管人协商一致，采用股票估值方法的第 4) 项或债券估值方法的第 5) 项、权证估值方法的第 3) 项规定的方法确定一个价格进行估值的情形下，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金或基金份额持有人损失的，由双方共同承担赔偿责任，其中基金管理人承担 70%，基金托管人承担 30%；
- 4) 基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第 4) 项或债券估值方法的第 5) 项、权证估值方法的第 3) 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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。

针对净值差错处理,如果法律法规或证监会有新的规定,则按新的规定执行;如果行业有通行做法,在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下,相关各方当事人应本着平等互利的原则重新协商确定处理原则。

### (3) 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、登录和保管本基金的全套账册,对相关各方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证基金资产的安全。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。

### (4) 会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目,如发现双方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

### (5) 基金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。定期报告文件应按中国证监会公布的《证券投资基金信息披露管理办法》要求公告。季度报表的编制,应于每季度终了后 15 个工作日内完成;更新的招募说明书在本基金合同生效后每 6 个月公告一次,于截止日后的 45 日内公告。半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告;年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。

基金管理人在月度报表完成当日,对报表加盖公章后,以加密传真方式将有关报表提供基金托管人;基金托管人在 2 个工作日内进行复核,并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日,对报表加盖公章后,以加密传真方式将有关报表提供基金托管人;基金托管人在 5 个工作日内进行复核,并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完成当日,将有关报告提供基金托管人,基金托管人在收到 15 个工作日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人,基金托管人在收到后 20 个工作日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基

金托管人，基金托管人在收到后 30 个工作日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务报表、季度报告、半年度报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### **(六) 基金份额持有人名册的保管**

基金管理人可委托基金注册与过户登记人登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于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、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册与过户登记人负责编制和保管，并对持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### **(七) 争议解决方式**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## （八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （1）基金托管协议的变更

本协议相关各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。修改后的新协议，应报中国证监会核准。

### （2）基金托管协议的终止

- 1) 《基金合同》终止；
- 2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
- 3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。
- 4) 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### （3）基金财产的清算

#### 1) 基金财产清算组

在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

① 基金财产清算组组成：基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册与过户登记人、具有从事相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

② 基金财产清算组职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2) 基金财产清算程序

- ① 《基金合同》终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ② 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③ 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；



- ④ 对基金财产进行评估和变现；
- ⑤ 基金清算组作出清算报告；
- ⑥ 会计师事务所对清算报告进行审计；
- ⑦ 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- ⑧ 将基金清算报告中国证监会；
- ⑨ 公布基金清算公告；
- ⑩ 对基金剩余财产进行分配。

### 3) 清算费用

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

### 4) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

- ① 支付基金财产清算费用；
- ② 缴纳基金所欠税款；
- ③ 清偿基金债务；
- ④ 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会批准并公告。

### 6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十五、对基金份额持有人的服务

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

### (一) 账单服务

本基金管理人默认的对账单方式为电子对账单,电子对账单包括电子邮件形式对账单(月度、季度)和短信账单(月度)。对于已订制电子邮件形式对账单的基金持有人,我公司将继续发送电子邮件对账单;对于没有订制电子邮件对账单的客户,默认向预留有效手机号码的基金持有人发送短信账单,向预留有效电子邮箱的基金客户发送电子邮件对账单。

若基金持有人因特殊原因需获取某段时间的纸质对账单,可拨打本基金管理人客服电话021-20376888按0转人工服务,客服人员核对姓名、开户证件或基金账号、交易信息、邮寄地址及邮编等信息无误后,将为基金持有人免费邮寄纸质对账单。

### (二) 基金间转换服务

基金管理人已于2008年5月8日在汇丰晋信基金直销中心和汇丰晋信基金电子交易系统开通旗下基金的转换业务。

基金管理人已于2009年2月9日在交通银行开通旗下基金的转换业务。

### (三) 定期投资计划

基金管理人已于2006年10月25日起正式推出本基金的定期定额投资计划。

### (四) 网络在线服务

投资人可以通过发送邮件至本基金管理人网站公示的客户服务电子信箱,实现咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息,投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站将为投资人提供基金账户查询、交易明细查询、修改查询密码等服务。

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

电子信箱：[services@hsbcjt.cn](mailto:services@hsbcjt.cn)

### **（五）信息定制服务**

汇丰晋信将为客户提供各类资讯服务，包括市场资讯，理财资讯，旗下基金信息等。基金持有人可以通过汇丰晋信网站、客户服务热线提交资讯定制的申请，基金管理人通过手机短信和 E-MAIL 方式定期发送持有人定制的信息。可定制的信息包括：基金净值、公司最新公告提示，各类定期及不定期的市场报告、理财资讯等。

除了发送持有人定制的上述信息之外，基金管理人也会不定期向留有手机和留有 EMAIL 地址的客户发送节日及生日问候、产品推广等信息。如持有人不希望接受到该类信息，可以通过客户服务热线取消该项服务。

### **（六）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务**

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日 9：00-18：00 为投资人提供服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

客服电话：021-20376888

传真：021-20376998

### **（七）投诉受理**

投资人可以拨打汇丰晋信基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回

复的投诉，基金管理人承诺在2个工作日之内对投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日进行回复。

## 二十六、其他应披露事项

(一) 2018年9月28日至2019年3月27日未发生涉及基金管理人、基金财产和基金托管人托管业务的诉讼、仲裁事项。

(二) 2018年9月28日至2019年3月27日本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未有受到任何处分。

(三) 2018年9月28日至2019年3月27日相关公告事宜列示如下，下列公告刊登在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报和汇丰晋信基金管理有限公司网站上。

披露时间	公告内容
2018-09-29	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告
2018-10-26	旗下基金 2018 年第 3 季度报告
2018-11-10	龙腾更新招募说明书（2018 年第 2 号）
2018-12-29	关于提请投资者及时补充、更新账户信息资料并接受或重新接受风险承受能力评估的公告
2019/1/2	汇丰晋信旗下开放式基金净值公告
2019/1/4	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过农业银行进行公募基金申购、基金组合购买和定期定额投资费率优惠活动的公告
2019/1/11	汇丰晋信关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为汇丰晋信龙腾混合型基金、汇丰晋信双核策略混合型基金代销机构的公告
2019/1/11	汇丰晋信关于通过腾安基金销售（深圳）有限公司开办汇丰晋信龙腾混合型基金、汇丰晋信双核策略混合型基金定期定额投资业务的公告
2019/1/11	关于汇丰晋信龙腾混合型基金、汇丰晋信双核策略混合型基金 A 通过腾安基金销售（深圳）有限公司开展申购和定期定额投资费率优惠活动的公告
2019/1/21	旗下基金 2018 年第 4 季度报告

## 二十七、招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 二十八、备查文件

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

- （一）中国证监会核准汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金募集的文件；
- （二）《汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《汇丰晋信龙腾混合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、营业执照；
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （七）《汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇一九年五月十一日